



PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES  
PLC

# Halbjahresbericht

30. Juni 2025



ALLGEMEINE KENNDATEN

**Fondstyp:**

OGAW

**Anzahl an Fonds der Gesellschaft:**

56 Fonds

**Zum 30. Juni 2025 angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft\*:**

Institutional

Institutional AUD (Hedged)

Institutional BRL (Hedged)

Institutional CAD (Hedged)

Institutional CHF (Hedged)

Institutional CHF (Partially Hedged)

Institutional CZK (Hedged)

Institutional EUR (Currency Exposure)

Institutional EUR (Hedged)

Institutional EUR (Partially Hedged)

Institutional EUR (Unhedged)

Institutional GBP (Currency Exposure)

Institutional GBP (Hedged)

Institutional GBP (Partially Hedged)

Institutional GBP (Unhedged)

Institutional HKD (Unhedged)

Institutional ILS (Hedged)

Institutional JPY (Hedged)

Institutional MXN (Hedged)

Institutional NOK (Hedged)

Institutional NOK (Partially Hedged)

Institutional NZD (Hedged)

Institutional RMB (Hedged)

Institutional RMB (Unhedged)

Institutional SEK (Hedged)

Institutional SGD (Hedged)

Institutional USD (Currency Exposure)

Investor

Investor AUD (Hedged)

Investor CAD (Hedged)

Investor CHF (Hedged)

Investor EUR (Hedged)

Investor GBP (Hedged)

Investor HKD (Unhedged)

Investor JPY (Hedged)

Investor NOK (Hedged)

Investor RMB (Hedged)

Investor SEK (Hedged)

Investor SGD (Hedged)

Investor USD (Unhedged)

Administrative

Administrative AUD (Hedged)

Administrative CHF (Hedged)

Administrative EUR (Hedged)

Administrative GBP (Hedged)

Administrative HKD (Unhedged)

Administrative JPY (Hedged)

Administrative SEK (Hedged)

Administrative SGD (Hedged)

BE Retail

BM Retail

BM Retail, dekulmlierend

E Class

E Class AUD (Hedged)

E Class CHF (Hedged)

E Class EUR (Currency Exposure)

E Class EUR (Hedged)

E Class EUR (Partially Hedged)

E Class EUR (Unhedged)

E Class GBP (Hedged)

E Class HKD (Unhedged)

E Class HUF (Hedged)

E Class JPY (Hedged)

E Class RMB (Hedged)

E Class SGD (Hedged)

E Class USD (Currency Exposure)

G Retail EUR (Hedged)

H Institutional

H Institutional USD (Currency Exposure)

M Retail

M Retail AUD (Hedged)

M Retail CHF (Hedged)

M Retail EUR (Hedged)

M Retail, dekulmlierend

M Retail GBP (Hedged)

M Retail HKD (Unhedged)

M Retail JPY (Hedged)

M Retail RMB (Hedged)

M Retail SGD (Hedged)

N Retail

R Class

R Class AUD (Hedged)

R Class EUR (Hedged)

Class R EUR (Unhedged)

R Class GBP (Hedged)

T Class

T Class EUR (Hedged)

UM Retail

UM Retail SGD (Hedged)

W Class

W Class CHF (Hedged)

W Class EUR (Hedged)

W Class GBP (Hedged)

W Class NOK (Hedged)

W Class SGD (Hedged)

Z Class

Z Class AUD (Hedged)

Z Class EUR (Hedged)

**Anteilsarten:**

Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile), ausschüttende Anteile II (Anteile, die eine höhere Rendite liefern sollen) und dekulmlierende Anteile (Anteile, die Ausschüttungen über das Einkommen hinaus bieten sollen) ausgeben.

**Nettovermögen (Angaben in Tausend):**

209.982.633 USD

**Mindestbestand:**

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

\* Eine vollständige Liste aller während des aktuellen und vorangegangenen Berichtszeitraums ausgegebenen Anteilsklassen ist Erläuterung 16 zu entnehmen. Eine Liste aller für die einzelnen Fonds angebotenen Anteilsklassen ist dem Verkaufsprospekt zu entnehmen.

**ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)**

**Handelstag:**

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

Ungeachtet der vorangehenden Ausführungen ist ein Tag für einen Fonds kein Handelstag, wenn es entweder aufgrund von Feiertagen oder einer Markt- bzw. Börsenschließung in jeglichem Rechtsgebiet schwierig ist, (i) einen Fonds zu verwalten oder (ii) einen Teil des Fondsvermögens zu bewerten. Weitere Einzelheiten über geplante Schließungen von Fonds während des Jahres können von Anteilinhabern und potenziellen Anlegern beim Administrator erfragt oder dem Feiertagskalender der Fonds entnommen werden (eine Kopie desselben kann beim Administrator angefordert werden).

**Funktionswährung der Fonds:**

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

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

**Zulassung in Hongkong:**

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

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

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

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

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

**Zulassung in Singapur**

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

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

**Reuters-Seite:**  
PAFPPLC

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



|                                                           | Seite |
|-----------------------------------------------------------|-------|
| Markteinblicke*                                           | 4     |
| Wichtige Angaben zu den Fonds                             | 5     |
| Beschreibungen der Vergleichsindizes                      | 70    |
| Finanzstatus                                              | 76    |
| Betriebsergebnisrechnung                                  | 96    |
| Ausweis der Nettovermögensänderungen                      | 116   |
| Aufstellung der Wertpapieranlagen                         | 122   |
| Erläuterungen zum Abschluss                               | 886   |
| Wesentliche Änderungen in der<br>Portfoliozusammensetzung | 946   |
| Begriffsbestimmungen                                      | 1005  |
| Allgemeine Informationen                                  | 1007  |

| FONDS                                               | Teilfondsüberblick | Aufstellung der<br>Wertpapieranlagen |
|-----------------------------------------------------|--------------------|--------------------------------------|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     | 7                  | 122                                  |
| Asia Strategic Interest Bond Fund                   | 8                  | 133                                  |
| PIMCO Balanced Income and Growth<br>Fund            | 9                  | 143                                  |
| PIMCO Capital Securities Fund                       | 11                 | 171                                  |
| PIMCO Climate Bond Fund                             | 13                 | 180                                  |
| Commodity Real Return Fund                          | 14                 | 189                                  |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund                | 15                 | 199                                  |
| Diversified Income Fund                             | 16                 | 211                                  |
| Diversified Income Duration Hedged Fund             | 18                 | 236                                  |
| Diversified Income ESG Fund                         | 19                 | 251                                  |
| Dynamic Bond Fund                                   | 20                 | 261                                  |
| Emerging Local Bond Fund                            | 21                 | 281                                  |
| Emerging Local Bond ESG Fund                        | 22                 | 302                                  |
| Emerging Markets Bond Fund                          | 23                 | 317                                  |
| Emerging Markets Bond ESG Fund                      | 24                 | 337                                  |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund                | 25                 | 353                                  |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities<br>Fund        | 26                 | 363                                  |
| Emerging Markets Short-Term Local<br>Currency Fund  | 27                 | 380                                  |
| PIMCO ESG Income Fund                               | 28                 | 395                                  |
| Euro Bond Fund                                      | 29                 | 409                                  |
| Euro Credit Fund                                    | 30                 | 419                                  |
| Euro Income Bond Fund                               | 31                 | 428                                  |
| Euro Long Average Duration Fund                     | 32                 | 441                                  |
| Euro Short-Term Fund                                | 33                 | 449                                  |
| PIMCO European High Yield Bond Fund                 | 34                 | 455                                  |
| PIMCO European Short-Term<br>Opportunities Fund     | 35                 | 463                                  |
| Global Advantage Fund                               | 36                 | 471                                  |
| Global Bond Fund                                    | 37                 | 489                                  |
| Global Bond ESG Fund                                | 39                 | 515                                  |
| Global Bond Ex-US Fund                              | 40                 | 533                                  |
| Global High Yield Bond Fund                         | 41                 | 551                                  |
| Global High Yield Bond ESG Fund                     | 42                 | 563                                  |
| Global Investment Grade Credit Fund                 | 43                 | 569                                  |
| Global Investment Grade Credit ESG<br>Fund          | 45                 | 592                                  |
| Global Low Duration Real Return Fund                | 46                 | 609                                  |
| Global Real Return Fund                             | 47                 | 619                                  |
| Income Fund                                         | 48                 | 631                                  |
| Income Fund II                                      | 51                 | 676                                  |
| Inflation Multi-Asset Fund                          | 52                 | 685                                  |
| Low Average Duration Fund                           | 53                 | 696                                  |
| Low Duration Global Investment Grade<br>Credit Fund | 54                 | 706                                  |
| Low Duration Income Fund                            | 55                 | 718                                  |

| FONDS                                      | Teilfondsüberblick | Aufstellung der Wertpapieranlagen |
|--------------------------------------------|--------------------|-----------------------------------|
| Low Duration Opportunities Fund            | 56                 | 737                               |
| Low Duration Opportunities ESG Fund        | 57                 | 750                               |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund     | 58                 | 756                               |
| Mortgage Opportunities Fund                | 59                 | 759                               |
| StocksPLUS™ Fund                           | 60                 | 771                               |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                  | 61                 | 782                               |
| Strategic Income Fund                      | 62                 | 789                               |
| Total Return Bond Fund                     | 63                 | 813                               |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 64                 | 829                               |
| UK Corporate Bond Fund                     | 65                 | 839                               |
| UK Long Term Corporate Bond Fund           | 66                 | 849                               |
| US High Yield Bond Fund                    | 67                 | 856                               |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund    | 68                 | 865                               |
| US Short-Term Fund                         | 69                 | 878                               |

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

\* Dieses Dokument enthält die Meinungen der Gesellschaft, und diese Meinungen können sich ohne Vorankündigung ändern. Dieses Material wurde ausschließlich zu Informationszwecken verteilt. Prognosen, Schätzungen und bestimmte hierin enthaltene Informationen beruhen auf firmeneigenem Research und sollten nicht als Anlageberatung oder Empfehlung eines bestimmten Wertpapiers, einer bestimmten Strategie oder eines bestimmten Anlageprodukts erachtet werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. Die hierin enthaltenen Informationen wurden aus Quellen bezogen, die als verlässlich erachtet werden. Eine diesbezügliche Garantie wird jedoch nicht abgegeben. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne ausdrückliche schriftliche Zustimmung in jedweder Form reproduziert werden, und es ist ebenso untersagt, in anderen Veröffentlichungen darauf Bezug zu nehmen. PIMCO ist in den USA und weltweit ein Warenzeichen von Allianz Asset Management of America LLC. ©2025, PIMCO.

Sehr geehrte Anteilinhaber,

Dieser Halbjahresbericht umfasst den am 30. Juni 2025 abgeschlossenen zwölfmonatigen Berichtszeitraum (der „Berichtszeitraum“). Auf den nachfolgenden Seiten finden Sie Einzelheiten zu den Anlageergebnissen.

Mehrere Zentralbanken senkten die Zinssätze, da die Inflation während des Berichtszeitraums zurückging. Derweil wirkten sich das allgemein robuste globale Wirtschaftswachstum, geopolitische Probleme und Sorgen über US-Handelszölle auf die Märkte aus.

Mehrere Zentralbanken passen die Geldpolitik weiterhin an

Die Inflationszahlen verbesserten sich in vielen großen Volkswirtschaften, blieben jedoch generell über den Zielen der Zentralbanken. Der Handelskrieg in den USA erweckte Befürchtungen im Zusammenhang mit einer höheren Inflation. Vor diesem Hintergrund beließ die US-Notenbank (die „Fed“) die Zinsen bei ihren Sitzungen im Januar, März, Mai und Juni 2025 aufgrund der Ungewissheit hinsichtlich des Inflationsausblicks unverändert. Die Europäische Zentralbank senkte die Zinssätze im Berichtszeitraum aufgrund von Wachstumssorgen viermal. Die Bank of England senkte die Zinsen im Februar und Mai 2025. Die Bank of Japan bildete unter den großen entwickelten Märkten die Ausnahme. Sie erhöhte im Januar 2025 ihren kurzfristigen Leitzins, änderte diesen jedoch seitdem nicht.

Die Finanzmärkte lieferten im Allgemeinen solide Renditen

Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen während des Berichtszeitraums war rückläufig. Die Renditen 10-jähriger Staatsanleihen in vielen anderen entwickelten Märkten waren gemischt. Der globale Rentenmarkt erlebte Phasen der Volatilität, lieferte jedoch positive Renditen, wobei Anleihen mit niedrigerem Rating im Allgemeinen besser abschnitten als Anleihen mit höherem Rating. Die globalen Aktienrenditen waren robust, allen voran Europa und die Schwellenmärkte. Am Rohstoffmarkt stieg der Goldpreis im April 2025 auf ein Allzeithoch, während andere Preise uneinheitlich schlossen. Am Währungsmarkt wertete der US-Dollar gegenüber dem Euro, dem britischen Pfund und dem japanischen Yen ab.

Mit unserem bewährten Anlageprozess zielen wir bei PIMCO darauf ab, die strukturellen Vorteile eines aktiven Anleihenmanagements zugunsten unserer Kunden zu nutzen. Wir arbeiten weiterhin sorgfältig daran, durch die dynamischen globalen Märkte zu navigieren und die Vermögenswerte, die Sie uns anvertraut haben, zu verwalten. Wir empfehlen Ihnen, mit Ihrem Finanzberater über Ihre Ziele zu sprechen und unsere neuesten Erkenntnisse auf [global.pimco.com](http://global.pimco.com) zu lesen.

Mit freundlichem Gruß



Craig A. Dawson  
Vorsitzender

Zum 30. Juni 2025. Quelle: Trading Economics

Aussagen über Finanzmarktrends basieren auf aktuellen Marktbedingungen, die schwanken werden. Es kann nicht garantiert werden, dass diese Anlagestrategien unter allen Marktbedingungen funktionieren oder für alle Anleger geeignet sind. Jeder Anleger sollte seine langfristige Anlagefähigkeit prüfen, insbesondere in Zeiten eines Marktabschwungs. Ausblick und Strategien können sich ohne Vorankündigung ändern.

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

| Gesamtrenditen bestimmter Anlageklassen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2025                                                                       |         |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|
| Anlageklasse (gemessen am, Währung)                                                                                                                      | Rendite |
| US-amerikanische Large-Cap-Aktien (S&P 500 Index, USD)                                                                                                   | 6,20 %  |
| Globale Aktien (MSCI World Index, USD)                                                                                                                   | 9,47 %  |
| Europäische Aktien (MSCI Europe Index, EUR)                                                                                                              | 14,22 % |
| Schwellenmarktakten (MSCI Emerging Markets Index, EUR)                                                                                                   | 7,45 %  |
| Japanische Aktien (Nikkei 225 Index, JPY)                                                                                                                | 1,49 %  |
| Lokale Schwellenmarktanleihen (JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, USD Unhedged)                                   | 0,46 %  |
| Auslandsschulden von Schwellenländern (JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, USD Hedged)                                                   | 6,03 %  |
| Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade (ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged)                  | 5,60 %  |
| Globale Anleihen mit Investment-Grade-Rating (Bloomberg Global Aggregate Credit Index, USD Hedged)                                                       | 3,25 %  |
| Festverzinsliche, auf Lokalwährung lautende staatliche Schuldtitel von Ländern mit Investment-Grade-Rating (Bloomberg Global Treasury Index, USD Hedged) | 1,91 %  |

Zum 30. Juni 2025. QUELLE: PIMCO.

US-amerikanische Large-Cap-Aktien, gemessen am S&P 500 Index, globale Aktien, gemessen am MSCI World Index, europäische Aktien, gemessen am MSCI Europe Index, Schwellenmarktakten, gemessen am MSCI Emerging Markets Index, japanische Aktien, gemessen am Nikkei 225 Index, lokale Schwellenmarktanleihen, gemessen am JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, Auslandsschulden von Schwellenländern, gemessen am JPMorgan Emerging Markets Bond Index, Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade, gemessen am ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, globale Anleihen mit Investment Grade-Rating, gemessen am Bloomberg Global Aggregate Credit Index, auf Lokalwährung lautende staatliche Schuldtitel von Ländern mit Investment Grade-Rating, gemessen am Bloomberg Global Treasury Index.

Nur zu Informations- und Marktkontextzwecken. Sofern nicht im Verkaufsprospekt und den relevanten wesentlichen Anlegerinformationen/den Basisinformationsblättern erwähnt, werden die vorgenannten Indizes bei der aktiven Verwaltung eines Fonds nicht verwendet.

## Wichtige Angaben zu den Fonds

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

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

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

Bestimmte Fonds können eine ESG-Anlagestrategie (Environmental, Social and Governance; Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) verfolgen, die Wertpapiere bestimmter Emittenten in der Regel aus anderen Gründen als der finanziellen Wertentwicklung auswählt oder ausschließt. Diese Strategie birgt das Risiko, dass die Wertentwicklung eines Fonds von ähnlichen Fonds, die keine ESG-Anlagestrategie verwenden, abweicht. Die Anwendung dieser Strategie könnte sich beispielsweise auf das Engagement eines Fonds in bestimmten Sektoren oder Anlagearten auswirken, was die Wertentwicklung eines Fonds beeinträchtigen könnte. Es besteht keine Garantie, dass die vom Anlageberater verwendeten Faktoren die Meinungen eines bestimmten Anlegers widerspiegeln, und die vom Anlageberater verwendeten Faktoren können von den Faktoren abweichen, die ein bestimmter Anleger bei der Beurteilung der ESG-Praktiken eines Emittenten für relevant hält. Die zukünftige ESG-Entwicklung und -Regulierung können sich auf die Umsetzung der Anlagestrategie eines Fonds auswirken. Darüber hinaus können sich Kosten aus ESG-bezogenen Sorgfaltsprüfungen, zunehmender Berichterstattung und der Inanspruchnahme externer ESG-Datenanbieter ergeben.

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

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

Bestimmte Instrumente, in die die Fonds investieren können, haben sich in der Vergangenheit auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“) bezogen, um unter anderem Zahlungsverpflichtungen, Finanzierungsbedingungen, Absicherungsstrategien oder den Anlagewert zu bestimmen. Der LIBOR war ursprünglich ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmte und den sich Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel berechneten. Zum 30. Juni 2023 wurde festgestellt, dass der LIBOR nicht mehr repräsentativ ist, aber bestimmte Bedingungen des LIBOR wurden bis 30. September 2024 synthetisch veröffentlicht. Die Veröffentlichung aller LIBOR-Bedingungen wurde seitdem dauerhaft eingestellt. In den meisten wichtigen Währungen wurden alternative Referenzzinssätze zum LIBOR festgelegt, und die Märkte für diese neuen Zinssätze entwickeln sich weiter (z. B. der Secured Overnight Financing Rate (SOFR) für den USD-LIBOR). Der Übergang vom LIBOR wurde zwar im Wesentlichen abgeschlossen, es bestehen jedoch weiterhin Restrisiken in Verbindung mit dem Übergang, die sich auf Märkte oder bestimmte Anlagen auswirken können. Daher können die vollständigen Auswirkungen des Übergangs auf die Fonds oder die Finanzinstrumente, in die die Fonds investieren, noch nicht vollständig bestimmt werden. So haben beispielsweise sogenannte „Tough Legacy“-Verträge LIBOR-Zinsbestimmungen ohne Ausweichklauseln, die die dauerhafte Einstellung des LIBOR in Erwägung ziehen, oder Ausweichklauseln, die möglicherweise nicht effektiv zu einer Abkehr vom LIBOR vor dem Ersetzungsdatum des LIBOR geführt haben, oder anderweitig unzureichende Ausweichklauseln. Am 15. März 2022 wurde der Adjustable Interest Rate (LIBOR) Act verabschiedet. Dieses Gesetz sieht einen gesetzlich vorgeschriebenen Ausweichmechanismus auf nationaler Basis vor, um den LIBOR durch einen Referenzzinssatz zu ersetzen, der vom Board of Governors des Federal Reserve System auf der Grundlage von SOFR für „Tough Legacy“-Verträge nach US-Recht ausgewählt wird. Am 27. Februar 2023 ist die letzte Regelung des US-Notenbanksystems in Verbindung mit diesem Gesetz in Kraft getreten und es wurden Benchmark-Ersetzungen auf Basis von SOFR und Term SOFR (eine zukunftsgerichtete Messung der Markterwartungen von SOFR, die von bestimmten Derivatmärkten impliziert werden) für geltende „Tough Legacy“-Verträge festgelegt. Bei bestimmten Anlagen der Fonds kann es sich um individuelle „Tough Legacy“-Verträge handeln, die dem Adjustable Interest Rate (LIBOR) Act oder dem synthetischen LIBOR unterliegen können, und es kann nicht zugesichert werden, dass diese Maßnahmen die beabsichtigten Auswirkungen gehabt haben werden.

Die Überblicksseiten der einzelnen Fonds in diesem Halbjahresbericht bieten eine Tabelle über die Netto-Wertentwicklung, in der die Wertentwicklung – davon ausgehend, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wieder angelegt wurden – gemessen wird. In den Erträgen ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber auf (i) Ausschüttungen des Fonds oder (ii) die Rückgabe von Investmentanteilen des Fonds zu zahlen hat, nicht berücksichtigt. In der Tabelle mit der Netto-Wertentwicklung wird die Wertentwicklung jedes Fonds im Vergleich zur Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarktindex (Vergleichsindex) gemessen. Die Wertentwicklung jedes Fonds in der Vergangenheit vor und nach Steuern ist nicht unbedingt ein Indikator dafür, wie sich der Fonds in der Zukunft entwickeln wird. Anlagen in einem Fonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von der Federal Deposit Insurance Corporation oder einer anderen behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Es besteht die Möglichkeit, bei Anlagen in die Fonds Geld zu verlieren. Der Wert der Anteile und die Einkünfte aus den Anteilen am Fonds können steigen oder sinken und eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Fonds investierten Betrag zurück.

## Wichtige Angaben zu den Fonds (Forts.)

---

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)              | 4,14 %   | 0,87 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)               | 4,22 %   | 0,88 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021)                    | 4,12 %   | (2,96 %)              |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)                    | 4,03 %   | (1,32 %)              |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)              | 3,81 %   | 0,38 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020)                    | 3,72 %   | (1,04 %)              |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)                     | 3,77 %   | (0,02 %)              |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)            | 4,12 %   | (2,17 %)              |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)             | 3,95 %   | (2,19 %)              |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)                 | 3,80 %   | (0,01 %)              |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)                    | 4,55 %   | 1,55 %                |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index                             | 4,05 %   | 1,16 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)  | 4,04 %   | (2,48 %)              |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2020)       | 3,84 %   | (2,02 %)              |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (AUD Hedged)                | 3,97 %   | (1,49 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020) | 2,21 %   | (3,83 %)              |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)  | 2,21 %   | (3,80 %)              |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Okt. 2020)       | 1,65 %   | (4,68 %)              |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2020)        | 1,77 %   | (4,66 %)              |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CHF Hedged)                | 2,02 %   | (3,43 %)              |
| <b>Auf CNH lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)       | 2,99 %   | (1,94 %)              |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CNH Hedged)                | 2,93 %   | (1,22 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020) | 3,26 %   | (2,46 %)              |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)  | 3,30 %   | (2,43 %)              |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Sep. 2020)       | 3,09 %   | (3,14 %)              |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)       | 2,90 %   | (3,31 %)              |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Sep. 2020)        | 2,86 %   | (3,33 %)              |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (EUR Hedged)                | 3,19 %   | (2,54 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2021) | 4,18 %   | (2,05 %)              |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Mai 2021)   | 4,14 %   | (2,84 %)              |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (GBP Hedged)                | 4,11 %   | (2,37 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)      | 4,83 %   | 0,00 %                |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)  | 4,80 %   | (0,01 %)              |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (HKD Unhedged)              | 5,15 %   | 1,17 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)  | 3,25 %   | (2,58 %)              |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)       | 3,01 %   | (2,15 %)              |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)        | 2,92 %   | (0,79 %)              |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)    | 3,01 %   | (0,79 %)              |
| JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (SGD Hedged)                | 3,14 %   | 0,20 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                     | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                     |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)              | 4,07 %   | 6,72 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 04. Sep. 2020)              | 4,15 %   | 0,64 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)                   | 3,91 %   | 6,38 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2023)                   | 3,95 %   | 7,82 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 04. Sep. 2020)                   | 3,67 %   | (0,23 %)              |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)                    | 3,68 %   | 2,85 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Dez. 2020)                   | 4,49 %   | 1,03 %                |
| JPMorgan Asia Credit Index <sup>3</sup>                             | 3,83 %   | 3,59 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                     |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023) | 3,17 %   | 4,86 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Mrz. 2021) | 3,26 %   | (1,37 %)              |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)      | 2,83 %   | (2,21 %)              |
| JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>                | 2,86 %   | (1,17 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                 |          |                       |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2011)    | (8,60 %) | 2,81 %                |
| JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) <sup>3</sup>              | (8,41 %) | 3,97 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                     |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Aug. 2021) | 4,13 %   | (0,31 %)              |
| JPMorgan Asia Credit Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>                | 3,84 %   | (0,04 %)              |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                     |          |                       |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Sep. 2020)     | 4,75 %   | 0,04 %                |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)    | 4,68 %   | 1,71 %                |
| JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) <sup>3</sup>              | 4,97 %   | 2,71 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                     |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020) | 3,24 %   | (0,06 %)              |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Okt. 2020)       | 2,77 %   | (0,91 %)              |
| JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged) <sup>3</sup>                | 2,88 %   | (0,23 %)              |

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

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

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

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



Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                    | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)                                            | 9,92 %   | 6,38 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 06. Jun. 2025)                                             | —        | —                     |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2024)                                          | 9,96 %   | 8,53 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)                                                 | 9,70 %   | 4,81 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Jan. 2025)                                           | —        | 10,80 %               |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 03. Mrz. 2025)                                            | —        | 6,11 %                |
| Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 07. Okt. 2024)                                         | 9,72 %   | 8,96 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2009)                                                  | 9,27 %   | 4,92 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)                                                   | 9,24 %   | 3,76 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)                                          | 9,74 %   | 8,52 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2022)                                           | 9,78 %   | 8,54 %                |
| BM Retail, dekumulierend (Auflegung: 10. Apr. 2024)                                                | 9,00 %   | 12,68 %               |
| M Retail, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                                 | 9,52 %   | 16,70 %               |
| M Retail, dekumulierend (Auflegung: 10. Apr. 2024)                                                 | 9,43 %   | 13,76 %               |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                                  | 9,57 %   | 16,72 %               |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                               | 9,61 %   | 16,74 %               |
| UM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 29. Apr. 2024)                                              | 9,65 %   | 15,09 %               |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)                                                  | 10,46 %  | 8,50 %                |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>              | 7,70 %   | 8,28 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2025)                               | —        | —                     |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 27. Jun. 2025)                             | —        | —                     |
| M Retail AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 09. Sep. 2024)                                  | 7,64 %   | 10,01 %               |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (AUD Hedged) <sup>3</sup> | 5,82 %   | 8,24 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| M Retail CHF (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 09. Sep. 2024)                                  | 5,74 %   | 7,00 %                |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (CHF Hedged) <sup>3</sup> | 3,84 %   | 5,11 %                |
| <b>Auf CNH lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                               | 7,15 %   | 14,73 %               |
| Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                | 7,15 %   | 14,73 %               |
| M Retail RMB (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 09. Sep. 2024)                                  | 6,81 %   | 8,63 %                |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (RMB Hedged) <sup>3</sup> | 4,88 %   | 11,93 % <sup>2</sup>  |
| <b>Auf CNH lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                                                |          |                       |
| Institutional RMB (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                             | 7,23 %   | 17,70 %               |
| Institutional RMB (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                              | 7,20 %   | 17,67 %               |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>              | 5,08 %   | 15,11 %               |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)                               | 7,19 %   | 5,35 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 27. Jun. 2025)                             | —        | —                     |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Mrz. 2025)                            | —        | 5,46 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009)                            | 6,55 %   | 3,89 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Jun. 2011)                                      | 6,53 %   | 2,64 %                |
| M Retail EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Feb. 2025)                                  | —        | 3,39 %                |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged) <sup>3</sup> | 5,06 %   | 7,05 % <sup>2</sup>   |

Der PIMCO Balanced Income and Growth Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Anlageklassen beteiligt, einschließlich Aktien, Rentenwerte, Rohstoffe und Immobilien (wie in der Ergänzung des Fonds beschrieben). Der Fonds kann (gemäß dem Verkaufsprospekt) auch in anderen PIMCO-Fonds und anderen Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen.

## PIMCO Balanced Income and Growth Fund (Forts.)

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

|                                                                                                    | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)                                | 8,18 %   | 4,96 %                |
| M Retail GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 09. Sep. 2024)                                  | 7,74 %   | 10,32 %               |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged) <sup>3</sup> | 6,07 %   | 6,74 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Jun. 2025)                              | —        | —                     |
| Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 07. Okt. 2024)                          | 10,76 %  | 10,12 %               |
| M Retail HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                  | 10,79 %  | 17,10 %               |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                   | 10,72 %  | 17,09 %               |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                | 10,69 %  | 17,06 %               |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index <sup>3</sup>              | 8,84 %   | 15,25 % <sup>2</sup>  |
| <b>Auf JPY lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional JPY (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 27. Jun. 2025)                             | —        | —                     |
| M Retail JPY (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 05. Jul. 2024)                                  | 5,76 %   | 6,26 %                |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (JPY Hedged) <sup>3</sup> | 3,93 %   | 4,17 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                                                    |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2025)                               | —        | —                     |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Jun. 2025)                                | —        | —                     |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 27. Jun. 2025)                             | —        | —                     |
| Administrative SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Aug. 2025)                              | —        | 11,80 %               |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 07. Okt. 2024)                            | 6,86 %   | 6,88 %                |
| M Retail SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                    | 6,89 %   | 14,61 %               |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                     | 6,88 %   | 14,65 %               |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 30. Nov. 2023)                                  | 6,91 %   | 14,60 %               |
| UM Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Apr. 2024)                                 | 6,99 %   | 12,36 %               |
| 60% MSCI All Country World Index/40% Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (SGD Hedged) <sup>3</sup> | 4,99 %   | 12,50 % <sup>2</sup>  |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                        | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)                | 4,84 %   | 5,77 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)                 | 4,81 %   | 5,14 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)                      | 4,71 %   | 4,70 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)                       | 4,64 %   | 4,70 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)               | 4,60 %   | 5,18 %                |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)                | 4,62 %   | 5,18 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)                      | 4,39 %   | 4,59 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)                        | 4,35 %   | 4,13 %                |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)                   | 4,45 %   | 4,42 %                |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)                       | 4,71 %   | 5,00 %                |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                       | 4,17 %   | 4,05 %                |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)                       | 5,26 %   | 6,33 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                        | 2,20 %   | 1,91 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Apr. 2024)   | 4,84 %   | 10,63 %               |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Mrz. 2024)    | 4,80 %   | 9,29 %                |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)          | 4,57 %   | 3,61 %                |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)          | 5,21 %   | 5,42 %                |
| Bloomberg AusBond Bank Bills Index                                     | 2,10 %   | 2,04 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf BRL lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)   | 23,32 %  | 1,98 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (BRL Hedged) <sup>3</sup>           | 20,52 %  | 0,51 %                |
| <b>Auf CAD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)         | 3,86 %   | 4,19 %                |
| Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) <sup>4</sup>                      | 1,45 %   | 2,32 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)   | 2,87 %   | 3,17 %                |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jun. 2014)         | 2,39 %   | 1,34 %                |
| ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>5</sup>                       | 0,14 %   | (0,38 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)   | 3,99 %   | 3,99 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)    | 3,88 %   | 3,99 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014) | 3,96 %   | 3,21 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)        | 3,82 %   | 3,78 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)  | 3,65 %   | 3,46 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)         | 3,50 %   | 2,87 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)          | 3,45 %   | 2,30 %                |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)          | 3,86 %   | 2,96 %                |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)         | 3,32 %   | 2,07 %                |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>                        | 1,24 %   | 0,53 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)   | 4,93 %   | 4,90 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)    | 4,90 %   | 4,97 %                |
| Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)         | 4,75 %   | 2,78 %                |
| M Retail GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Mai 2024)          | 4,42 %   | 9,26 %                |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)          | 4,93 %   | 3,91 %                |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>7</sup>                       | 2,25 %   | 1,48 % <sup>2</sup>   |

Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf preislich attraktive Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamtrendite an, in Übereinstimmung mit der Kapitalerhaltung und umsichtigen Anlageverwaltung durch die Anlage in einem aktiv verwalteten, aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) und anderen Wertpapieren bestehenden Portfolio, das gemäß den in der Ergänzung des Fonds angegebenen Richtlinien mindestens zu 80 % in Capital Securities angelegt wird. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, verfolgt jedoch kein nachhaltiges Anlageziel.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

|                                                                     | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                     |          |                       |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)    | 5,57 %   | 3,92 %                |
| 3 Month HIBOR Index                                                 | 2,08 %   | 2,42 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                     |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021) | 3,99 %   | 1,90 %                |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)       | 3,89 %   | 3,81 %                |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)   | 3,45 %   | 3,91 %                |
| SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average <sup>8</sup>        | 1,15 %   | 1,58 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

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

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

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                       | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)               | 4,51 %   | 0,89 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2025)                    | —        | 2,00 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)                     | 4,80 %   | 1,43 %                |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)                          | 2,21 %   | (0,92 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)   | 4,50 %   | 5,59 %                |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (AUD Hedged)                          | 2,05 %   | 4,80 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Nov. 2020)  | 2,41 %   | (2,39 %)              |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)                          | 0,06 %   | (4,29 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)  | 3,55 %   | (0,79 %)              |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)   | 3,68 %   | (1,00 %)              |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2025)       | —        | —                     |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024) | 3,31 %   | 4,13 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)       | 3,13 %   | (1,67 %)              |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)                          | 1,26 %   | (2,65 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)  | 4,62 %   | 0,42 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)   | 4,64 %   | 0,38 %                |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)                          | 2,23 %   | (1,49 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2021)  | 3,47 %   | (1,07 %)              |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021) | 3,21 %   | (1,61 %)              |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (SEK Hedged)                          | 1,18 %   | (2,77 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)  | 3,65 %   | (0,12 %)              |
| Bloomberg MSCI Green Bond Index (SGD Hedged)                          | 1,25 %   | (1,87 %)              |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                        | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)                | 6,71 %   | (0,07 %)              |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)                     | 6,44 %   | (1,22 %)              |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)                      | 6,20 %   | (1,32 %)              |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)              | 6,57 %   | (4,65 %)              |
| Bloomberg Commodity Index Total Return                                 | 5,53 %   | (1,22 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)   | 5,44 %   | (0,62 %)              |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)         | 5,08 %   | (2,83 %)              |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)                    | 4,56 %   | (1,59 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                    |          |                       |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2021) | (5,92 %) | 5,43 %                |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged)                  | (6,88 %) | 6,31 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)   | 6,34 %   | 3,44 %                |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)                    | 5,62 %   | 3,02 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                    |          |                       |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Nov. 2022)  | (2,53 %) | (5,92 %)              |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Unhedged)                  | (3,53 %) | (5,80 %)              |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2021)         | 5,15 %   | 2,25 %                |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (SGD Hedged)                    | 4,63 %   | 4,41 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)              | 3,90 %   | 3,73 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)                    | 3,49 %   | 2,33 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2024)            | 3,77 %   | 8,27 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2024)                    | 4,30 %   | 4,40 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                      | 2,20 %   | 1,71 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012) | 1,72 %   | 0,95 %                |
| ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>4</sup>                     | 0,14 %   | (0,37 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011) | 2,93 %   | 2,32 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)       | 2,40 %   | 0,82 %                |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>5</sup>                      | 1,24 %   | 0,55 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jan. 2025) | —        | 4,20 %                |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index                                  | —        | 2,12 %                |

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

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

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

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

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

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



Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

|                                                                                                                                                                                                                                | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)                                                                                                                                                                        | 4,73 %   | 5,43 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)                                                                                                                                                                         | 4,77 %   | 5,49 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)                                                                                                                                                                             | 4,62 %   | 3,09 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)                                                                                                                                                                              | 4,60 %   | 3,09 %                |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)                                                                                                                                                                        | 4,56 %   | 3,78 %                |
| BM Retail, dekumulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)                                                                                                                                                                            | 3,87 %   | 5,91 %                |
| BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)                                                                                                                                                                          | 3,83 %   | 3,10 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)                                                                                                                                                                              | 4,26 %   | 4,45 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)                                                                                                                                                                               | 4,20 %   | 4,52 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)                                                                                                                                                                      | 4,64 %   | 4,11 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2020)                                                                                                                                                                       | 4,67 %   | 2,62 %                |
| M Retail, dekumulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)                                                                                                                                                                             | 4,26 %   | 6,86 %                |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)                                                                                                                                                                              | 4,29 %   | 3,57 %                |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)                                                                                                                                                                           | 4,33 %   | 3,02 %                |
| N Retail, ausschüttend II (Auflegung: 30. Okt. 2020)                                                                                                                                                                           | 4,25 %   | 0,64 %                |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                                                                                                                                                                              | 4,10 %   | 2,45 %                |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                                                                                                                                                                               | 4,16 %   | 2,46 %                |
| Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                              | 4,89 %   | 1,43 %                |
| Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                               | 4,86 %   | 1,41 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged <sup>3</sup> | 4,48 %   | 5,26 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung: 19. Dez. 2012)                                                                                                                                                                  | 4,28 %   | 2,75 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, AUD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, AUD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, AUD Hedged <sup>3</sup> | 4,31 %   | 3,67 %                |
| <b>Auf CAD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)                                                                                                                                                           | 4,02 %   | 2,43 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CAD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CAD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CAD Hedged <sup>3</sup> | 3,62 %   | 2,65 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)                                                                                                                                                           | 2,72 %   | 2,02 %                |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)                                                                                                                                                            | 2,64 %   | 1,41 %                |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)                                                                                                                                                                | 2,28 %   | (1,88 %)              |
| Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                 | 2,79 %   | (1,67 %)              |
| Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                  | 2,72 %   | (1,67 %)              |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CHF Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CHF Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CHF Hedged <sup>3</sup> | 2,29 %   | 2,08 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)                                                                                                                                                           | 3,84 %   | 4,10 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)                                                                                                                                                            | 3,80 %   | 4,12 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)                                                                                                                                                                | 3,65 %   | 3,88 %                |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)                                                                                                                                                                 | 3,69 %   | 1,58 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)                                                                                                                                                          | 3,62 %   | 3,72 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)                                                                                                                                                                 | 3,38 %   | 3,33 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)                                                                                                                                                                  | 3,46 %   | 2,84 %                |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)                                                                                                                                                                 | 3,21 %   | 0,54 %                |

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

|                                                                                                                                                                                                                                | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)                                                                                                                                                                  | 3,19 %   | 0,54 %                |
| Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                 | 3,91 %   | (0,33 %)              |
| Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                  | 4,01 %   | (0,32 %)              |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged <sup>3</sup> | 3,49 %   | 3,74 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)                                                                                                                                                            | 4,83 %   | 5,11 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)                                                                                                                                                            | 4,78 %   | 5,05 %                |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)                                                                                                                                                           | 4,61 %   | 3,15 %                |
| Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                 | 4,92 %   | 0,89 %                |
| Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                  | 4,96 %   | 0,90 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged <sup>3</sup> | 4,49 %   | 4,75 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf JPY lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)                                                                                                                                                          | 2,51 %   | (4,09 %)              |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, JPY Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, JPY Hedged; und JPMorgan EMBI Global, JPY Hedged <sup>3</sup> | 2,35 %   | (2,92 %)              |
| <b>Auf MXN lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Dez. 2020)                                                                                                                                                           | 7,69 %   | 6,71 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, MXN Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, MXN Hedged; und JPMorgan EMBI Global, MXN Hedged <sup>3</sup> | 7,20 %   | 7,61 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                                                                                                                                                           | 3,72 %   | 4,39 %                |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2020)                                                                                                                                                          | 3,48 %   | (1,66 %)              |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SEK Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SEK Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SEK Hedged <sup>3</sup> | 3,39 %   | 4,03 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)                                                                                                                                                            | 3,79 %   | 1,11 %                |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)                                                                                                                                                            | 3,64 %   | 1,30 %                |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Okt. 2019)                                                                                                                                                                  | 3,35 %   | 0,18 %                |
| Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                                                                                                                                                                  | 4,01 %   | 0,52 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SGD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SGD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SGD Hedged <sup>3</sup> | 3,49 %   | 2,16 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

## Diversified Income Duration Hedged Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                                                                                                                                                | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)                                                                                                                                                                         | 3,61 %   | 4,30 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)                                                                                                                                                                             | 3,39 %   | 3,60 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)                                                                                                                                                                              | 3,15 %   | 3,13 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)                                                                                                                                                                                | 3,13 %   | 3,39 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged <sup>3</sup> | 3,44 %   | 4,14 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)                                                                                                                                                           | 2,68 %   | 3,12 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)                                                                                                                                                         | 2,63 %   | 2,40 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)                                                                                                                                                                 | 2,16 %   | 2,29 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2013)                                                                                                                                                                   | 2,17 %   | 1,23 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged <sup>3</sup> | 2,44 %   | 3,08 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)                                                                                                                                                           | 3,69 %   | 4,09 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)                                                                                                                                                            | 3,54 %   | 3,15 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged <sup>3</sup> | 3,44 %   | 3,95 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Duration Hedged Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 09. November 2015: Bogey 4309 (Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch High Yield BB-B Rated Developed Markets Constrained (USD Hedged), JPMorgan EMBI Global; seit dem 10. November 2015: Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 25 Jahren: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged).

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                                                                                                                                                                         | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                                         |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                                                                                                                                                                                 | 4,62 %   | 6,43 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                                                                                                                                                                                       | 4,19 %   | 5,51 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified                                        | 4,51 %   | 6,61 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                                         |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                                                                                                                                                                    | 3,76 %   | 4,27 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                                                                                                                                                                          | 3,19 %   | 3,31 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (EUR Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (EUR Hedged) | 3,51 %   | 4,27 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                                         |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                                                                                                                                                                    | 4,70 %   | 5,85 %                |
| jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (GBP Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (GBP Hedged) | 4,52 %   | 5,78 %                |

Der Diversified Income ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Instrumenten mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds versucht, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Merkmale zu bewerben, wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt, und versucht, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                         | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)                 | 4,26 %   | 2,94 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)                  | 4,26 %   | 2,69 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)                      | 4,15 %   | 2,08 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)                       | 4,04 %   | 2,06 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)                | 4,03 %   | 2,16 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)                        | 3,80 %   | 1,66 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)                         | 3,82 %   | 1,67 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)               | 4,23 %   | 2,91 %                |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                       | 4,20 %   | 2,21 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)                       | 4,66 %   | 3,08 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                         | 2,20 %   | 1,36 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CAD lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)    | 3,44 %   | 2,40 %                |
| Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) <sup>4</sup>                       | 1,45 %   | 2,24 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)    | 2,11 %   | 0,43 %                |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011) | 1,75 %   | (0,50 %)              |
| ICE BofA SARON Overnight Rate Index <sup>5</sup>                        | 0,14 %   | (0,18 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)     | 3,30 %   | 1,87 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)     | 3,29 %   | 1,53 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)         | 3,09 %   | 0,89 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)   | 3,06 %   | 0,97 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)          | 2,81 %   | 0,62 %                |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)          | 2,87 %   | 0,37 %                |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>6</sup>                         | 1,24 %   | 0,52 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)    | 4,25 %   | 2,30 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)     | 4,33 %   | 2,11 %                |
| Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)          | 3,84 %   | 1,30 %                |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>7</sup>                        | 2,25 %   | 1,24 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)    | 4,24 %   | 2,40 %                |
| 1 Month NIBOR Rate Index                                                | 2,30 %   | 1,81 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)   | 2,92 %   | 1,03 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (SEK Hedged) <sup>3</sup>            | 1,06 %   | 0,74 %                |

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

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

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

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

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

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                         | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                         |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)                                 | 13,73 %  | 2,92 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)                                  | 13,71 %  | 2,76 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)                                      | 13,57 %  | 1,45 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)                                       | 13,11 %  | 3,49 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2010)                                        | 13,15 %  | 1,09 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)                               | 13,59 %  | 3,52 %                |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)                                        | 14,19 %  | 5,38 %                |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)     | 12,26 %  | 2,43 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                         |          |                       |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)                  | 0,26 %   | 2,95 %                |
| Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)                   | 0,30 %   | 2,47 %                |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)                        | (0,18 %) | 3,18 %                |
| Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)                         | (0,20 %) | 3,32 %                |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | (0,97 %) | 3,64 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                         |          |                       |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)                  | 3,87 %   | 5,25 %                |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged) | 2,60 %   | 4,71 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                             | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                             |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                     | 13,81 %  | 11,08 %               |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                      | 13,84 %  | 11,10 %               |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                           | 13,28 %  | 10,01 %               |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                                            | 13,31 %  | 10,01 %               |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)                                           | 14,34 %  | 13,48 %               |
| JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index                | 13,24 %  | 10,12 % <sup>2</sup>  |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                             |          |                       |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                      | 0,43 %   | 5,60 %                |
| Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                       | 0,45 %   | 5,63 %                |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                            | 0,00 %   | 4,58 %                |
| Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)                             | (0,13 %) | 4,56 %                |
| JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | (0,11 %) | 4,68 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                             |          |                       |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jun. 2023)                       | 4,09 %   | 4,07 %                |
| JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged) | 3,49 %   | 3,11 %                |

Der Emerging Local Bond ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds legt grundsätzlich mindestens 80 % seiner Vermögenswerte in Rentenwerten an, die auf Währungen von Schwellenmarktländern lauten. Der Fonds versucht, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Merkmale zu bewerben, wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt, und versucht, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

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

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



Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                        | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)                | 6,72 %   | 7,66 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)                 | 6,71 %   | 7,10 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)                     | 6,55 %   | 6,40 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)                | 6,47 %   | 5,44 %                |
| BM Retail, dekumulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)                    | 5,78 %   | 8,34 %                |
| BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)                  | 5,79 %   | 4,82 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                      | 6,26 %   | 4,30 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)                       | 6,23 %   | 4,42 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)              | 6,64 %   | 7,23 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Sep. 2020)               | 6,55 %   | 1,53 %                |
| M Retail, dekumulierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)                     | 6,26 %   | 9,30 %                |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)                      | 6,25 %   | 3,35 %                |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)                   | 6,38 %   | 2,99 %                |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)                       | 7,16 %   | 7,49 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global                     | 5,48 %   | 6,78 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung: 19. Dez. 2012)          | 6,20 %   | 2,15 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (AUD Hedged)        | 5,32 %   | 2,64 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)    | 4,65 %   | 3,00 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (CHF Hedged)        | 3,28 %   | 2,91 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)   | 5,80 %   | 5,65 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)    | 5,72 %   | 2,86 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)        | 5,62 %   | (0,07 %)              |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)         | 5,31 %   | 2,93 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Hedged)        | 4,50 %   | 5,32 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                    |          |                       |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018) | (5,84 %) | 3,86 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged)      | (6,95 %) | 3,13 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)   | 6,79 %   | 5,54 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)    | 6,76 %   | 4,69 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (GBP Hedged)        | 5,51 %   | 5,49 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Mrz. 2025)   | —        | 2,61 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (NOK Hedged)        | —        | 2,51 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2025)   | —        | 2,80 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (SEK Hedged)        | —        | 2,44 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)   | 5,88 %   | 2,94 %                |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)         | 5,38 %   | 3,32 %                |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (SGD Hedged)        | 4,50 %   | 4,28 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)                                        | 5,84 %   | 3,92 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)                                         | 5,92 %   | 1,65 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2019)                                       | 5,62 %   | 1,16 %                |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)                                        | 5,54 %   | 1,14 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2021)                                              | 5,38 %   | (0,95 %)              |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 05. Feb. 2021)                                               | 5,41 %   | (0,97 %)              |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)                                              | 6,28 %   | 11,39 %               |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified <sup>3</sup>                | 5,37 %   | 4,14 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                                                |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Apr. 2021)                           | 3,84 %   | (2,64 %)              |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged) <sup>3</sup>   | 3,17 %   | (3,20 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)                           | 5,00 %   | 1,40 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)                            | 4,96 %   | (0,01 %)              |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024)                          | 4,73 %   | 8,80 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)                                 | 4,47 %   | 0,06 %                |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged) <sup>3</sup>   | 4,39 %   | 1,54 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)                            | 5,78 %   | 0,57 %                |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged) <sup>3</sup>   | 5,40 %   | (0,19 %)              |
| <b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                                            |          |                       |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2020)                          | (3,28 %) | (0,75 %)              |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged) <sup>3</sup> | (3,70 %) | (1,20 %)              |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                                                |          |                       |
| Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)                                | 5,76 %   | 2,16 %                |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged) <sup>3</sup>   | 5,43 %   | 2,38 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                                                |          |                       |
| Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)                                | 4,61 %   | 1,13 %                |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)                          | 4,53 %   | (2,07 %)              |
| JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged) <sup>3</sup>   | 4,30 %   | 1,54 % <sup>2</sup>   |

Der Emerging Markets Bond ESG Fund beabsichtigt, den maximal möglichen Gesamtertrag bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen zu erzielen (indem er ausdrücklich Umwelt-, soziale und Unternehmensführungsfaktoren in den Anlageprozess integriert, wie in der Ergänzung näher beschrieben), indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Fondsnachtrag näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen nachhaltigkeitsbezogenen Auswahlverfahren des Anlageberaters ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, ESG-Faktoren (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) zu berücksichtigen, und das unter anderem eine Ausschlussstrategie umfasst, das der sozial verantwortliche Berater (wie im Verkaufsprospekt definiert) regelmäßig vorgibt.

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                         | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)                 | 4,20 %   | 3,97 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)                       | 3,74 %   | 2,32 %                |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)      | 4,22 %   | 5,16 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)           | 1,71 %   | 0,07 %                |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged) | 2,07 %   | 2,08 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)    | 3,31 %   | 2,53 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)          | 2,86 %   | 1,51 %                |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged) | 3,26 %   | 3,65 % <sup>2</sup>   |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                                                             | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                                                             |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)                                                                                     | 10,77 %  | 5,17 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 02. Okt. 2023)                                                                                           | 10,32 %  | 14,21 %               |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 02. Okt. 2023)                                                                                            | 10,29 %  | 14,21 %               |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2022)                                                                                           | 11,25 %  | 10,44 %               |
| 50% JPMorgan EMBI Global Index/50% JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged)                  | 8,84 %   | 2,03 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                                                             |          |                       |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)                                                              | 3,60 %   | 3,16 %                |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2022)                                                                    | 3,18 %   | 4,04 %                |
| 50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | 1,75 %   | 0,66 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                                                             |          |                       |
| Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Mrz. 2022)                                                               | 5,97 %   | 5,70 %                |
| 50 % JPMorgan EMBI Global Index (GBP Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged) | 4,05 %   | 3,33 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                        | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)                      | 11,63 %  | 2,11 %                |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)                  | 10,44 %  | 1,85 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010) | (1,11 %) | 3,10 %                |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)       | (1,52 %) | 2,51 %                |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)              | (2,58 %) | 2,83 % <sup>2</sup>   |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                       | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)               | 4,80 %   | 2,13 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)                | 4,78 %   | 2,14 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)                     | 4,37 %   | 1,22 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)                      | 4,29 %   | 1,21 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2024)                     | 5,16 %   | 6,00 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index                                        | 4,02 %   | (0,52 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Nov. 2021)   | 4,81 %   | 1,17 %                |
| Class R AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)         | 4,59 %   | 0,93 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index                           | 3,87 %   | (1,68 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)  | 2,71 %   | (1,25 %)              |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)         | 2,30 %   | (2,12 %)              |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index                           | 1,85 %   | (4,02 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)  | 3,79 %   | 0,31 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021)    | 3,71 %   | 0,28 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2024) | 3,64 %   | 2,40 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jun. 2021)        | 3,40 %   | (0,71 %)              |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)         | 3,40 %   | (0,59 %)              |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index                           | 3,02 %   | (2,47 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)   | 4,91 %   | 1,62 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index                           | 4,02 %   | (1,19 %)              |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)  | 4,85 %   | 5,15 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index                           | 4,05 %   | 3,51 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Okt. 2021)  | 3,73 %   | 0,29 %                |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2022)  | 3,47 %   | 1,81 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index                           | 2,88 %   | (3,00 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)   | 3,79 %   | 1,07 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index                           | 3,06 %   | (1,68 %)              |

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

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

Der PIMCO ESG Income Fund ist bestrebt, unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltiger Investitionen hohe laufende Erträge zu erzielen (indem er ausdrücklich Umwelt-, soziale und Unternehmensführungsfaktoren (ESG) in den Anlageprozess integriert, wie in der Ergänzung näher beschrieben). Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)              | 1,46 %   | 3,40 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)               | 1,47 %   | 3,10 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)                    | 1,31 %   | 3,01 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                    | 0,99 %   | 1,81 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)                     | 1,05 %   | 1,62 %                |
| FTSE Euro Broad Investment-Grade Index                               | 0,87 %   | 3,17 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006) | 0,22 %   | 1,75 %                |
| FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index                  | (0,38 %) | 1,71 %                |

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

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

#### Anlageziel und Überblick über die Strategie

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



Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                             | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                             |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)     | 2,11 %   | 2,91 %                |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)   | 2,10 %   | 1,84 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)            | 1,60 %   | 1,58 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)   | 2,05 %   | (0,07 %)              |
| H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019) | 2,08 %   | (0,07 %)              |
| Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index                       | 1,27 %   | 2,70 % <sup>2</sup>   |

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

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

#### Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

### Auf EUR lautende Klassen

|                                                          | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)  | 3,00 %   | 3,55 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)   | 2,95 %   | 3,56 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)       | 2,74 %   | 0,87 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)         | 2,78 %   | 3,20 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024) | 2,65 %   | 5,90 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)        | 2,48 %   | 2,62 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)         | 2,41 %   | 2,61 %                |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)        | 2,32 %   | 0,92 %                |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)         | 2,34 %   | 0,93 %                |
| Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index            | 1,72 %   | 1,98 % <sup>2</sup>   |

Der Euro Income Bond Fund beabsichtigt, seine laufenden Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Anleihen und anderen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in einer breiten Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht des Anlageberaters typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen. Der Fonds bewirbt ökologische und soziale Merkmale, verfolgt jedoch kein nachhaltiges Anlageziel.

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                                           | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                           |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)                                   | (4,31 %) | 3,42 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2023)                                         | (4,68 %) | 1,14 %                |
| Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index <sup>3</sup> | (4,92 %) | 2,43 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                          | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                          |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)  | 1,55 %   | 1,39 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2024)       | 1,37 %   | 3,23 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)        | 1,16 %   | 0,63 %                |
| ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index <sup>3</sup> | 1,15 %   | 1,01 % <sup>2</sup>   |

<sup>1</sup> Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.<sup>2</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.<sup>3</sup> Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Short-Term Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; vom 01. Juli 2021 bis zum 31. August 2023: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index; seit dem 01. September 2023: ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                            | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                            |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)                    | 3,28 %   | 3,88 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Dez. 2022)                          | 2,83 %   | 8,70 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)                           | 2,80 %   | 8,64 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)                          | 3,60 %   | 4,44 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index | 2,79 %   | 2,91 % <sup>2</sup>   |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                           | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                           |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)   | 2,57 %   | 1,53 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)         | 2,15 %   | 0,36 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020) | 2,40 %   | 1,23 %                |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>3</sup>           | 1,23 %   | 1,39 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                  | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                  |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)                          | 8,56 %   | 2,75 %                |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)                         | 7,86 %   | 2,15 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                                  |          |                       |
| Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)    | (0,42 %) | 1,18 %                |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close) | (1,11 %) | 0,54 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                  |          |                       |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)    | 0,64 %   | 2,31 %                |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)          | 0,16 %   | 1,30 %                |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close) | (0,15 %) | 1,75 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                                  |          |                       |
| Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)   | 1,63 %   | 3,72 %                |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close) | 0,86 %   | 3,13 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

|                                                                               | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)                       | 3,42 %   | 4,89 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)                        | 3,46 %   | 4,59 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)                            | 3,29 %   | 4,39 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)                             | 3,30 %   | 4,24 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)                      | 3,20 %   | 3,93 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                             | 3,00 %   | 3,43 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)                              | 2,95 %   | 3,39 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)                     | 3,35 %   | 4,28 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)                      | 3,37 %   | 1,17 %                |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)                          | 2,95 %   | 1,69 %                |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                             | 2,83 %   | 1,72 %                |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                              | 2,87 %   | 1,72 %                |
| Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                             | 3,46 %   | 0,93 %                |
| Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                              | 3,54 %   | 0,92 %                |
| Class W, ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)                           | 3,54 %   | 6,14 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index <sup>3</sup>                    | 2,81 %   | 4,14 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                              |          |                       |
| Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2002)   | 7,99 %   | 3,88 %                |
| Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 23. Mrz. 2006)    | 7,99 %   | 3,51 %                |
| Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2010)          | 7,53 %   | 1,75 %                |
| Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2010)           | 7,54 %   | 1,74 %                |
| H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021) | 7,86 %   | (1,59 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>                  | 7,27 %   | 3,00 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2024)          | 3,38 %   | 5,69 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (AUD Hedged) Index <sup>3</sup>                    | 2,65 %   | 5,26 %                |
| <b>Auf CAD lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)          | 2,68 %   | 2,06 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (CAD Hedged) Index <sup>3</sup>                    | 1,94 %   | 1,59 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)           | 1,36 %   | 2,21 %                |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)           | 1,33 %   | 2,25 %                |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)               | 1,18 %   | 1,29 %                |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2018)                | 0,89 %   | (1,30 %)              |
| Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                | 1,35 %   | (2,09 %)              |
| Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                 | 1,40 %   | (2,08 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index <sup>3</sup>                    | 0,65 %   | 1,39 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CNH lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional RMB (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Okt. 2024)         | 0,93 %   | 5,43 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index <sup>3</sup>                    | 0,31 %   | 4,14 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)          | 2,49 %   | 3,33 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)           | 2,54 %   | 3,19 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)               | 2,36 %   | 2,83 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                | 2,04 %   | 2,37 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)                 | 2,00 %   | 0,05 %                |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)                | 2,01 %   | 0,57 %                |



Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

|                                                                                 | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                  | 2,38 %   | 1,21 %                |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)                  | 1,94 %   | 0,00 %                |
| Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                  | 2,66 %   | (0,73 %)              |
| Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                   | 2,51 %   | (0,73 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>                      | 1,83 %   | 2,45 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                                |          |                       |
| Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013) | (4,69 %) | 2,40 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index <sup>3</sup>                    | (5,37 %) | 1,76 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)            | 3,52 %   | 4,37 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)             | 3,51 %   | 4,38 %                |
| Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)                 | 3,35 %   | 3,77 %                |
| Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                  | 3,54 %   | 0,51 %                |
| Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                   | 3,63 %   | 0,51 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index <sup>3</sup>                      | 2,82 %   | 3,54 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                                |          |                       |
| Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018) | (1,29 %) | 0,98 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index <sup>3</sup>                    | (1,96 %) | 0,43 %                |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)             | 4,07 %   | 1,78 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index denominated in HKD <sup>3</sup>   | 3,89 %   | 2,19 %                |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)            | 3,57 %   | 4,31 %                |
| Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)                 | 3,40 %   | 4,24 %                |
| Class W NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Apr. 2021)                  | 3,64 %   | 0,07 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index <sup>3</sup>                      | 2,86 %   | 3,42 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf NZD lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)             | 3,16 %   | 6,06 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index <sup>3</sup>                      | 2,43 %   | 5,15 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)            | 2,43 %   | 3,46 %                |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2021)           | 2,18 %   | (1,53 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index <sup>3</sup>                      | 1,72 %   | 2,51 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)            | 2,57 %   | 4,17 %                |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)             | 2,61 %   | 4,23 %                |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)               | 2,16 %   | 3,29 %                |
| Class W SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)                | 2,65 %   | 4,33 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (SGD Hedged) Index <sup>3</sup>                      | 1,85 %   | 2,75 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)                        | 3,30 %   | 2,38 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Apr. 2020)                         | 3,26 %   | 1,50 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)                             | 3,13 %   | 2,18 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)                               | 2,86 %   | 1,26 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index                                  | 2,81 %   | 2,10 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2025)           | —        | 3,20 %                |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)                  | 3,58 %   | 2,29 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Index (AUD Hedged)                                  | 2,65 %   | 1,47 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)           | 1,28 %   | (0,59 %)              |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2022)                 | 0,82 %   | (0,75 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index                                  | 0,65 %   | (0,92 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)           | 2,48 %   | 0,38 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)            | 2,41 %   | 0,37 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2017)                 | 1,91 %   | (0,50 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index                                  | 1,83 %   | 0,08 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2020)           | 3,41 %   | 0,60 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)            | 3,45 %   | 1,53 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index                                  | 2,82 %   | 1,23 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                               |          |                       |
| Institutional GBP (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 04. Aug. 2022) | (1,48 %) | (1,43 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index                                | (1,96 %) | (2,21 %)              |
| <b>Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                            |          |                       |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2020)          | (5,52 %) | (0,65 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index denominated in GBP               | (6,04 %) | (0,56 %)              |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)           | 3,47 %   | 1,50 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index                                  | 2,86 %   | 1,26 %                |
| <b>Auf NZD lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)            | 3,17 %   | 2,10 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index                                  | 2,43 %   | 1,87 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                                |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Mai 2021)            | 2,32 %   | (1,17 %)              |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mai 2023)           | 2,08 %   | 3,09 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index                                  | 1,72 %   | (1,28 %) <sup>2</sup> |

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

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

Der Global Bond ESG Fund ist bestrebt, seine Erträge bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen zu maximieren (indem er ausdrücklich Umwelt-, soziale und Unternehmensführungsfaktoren in den Anlageprozess integriert, wie in der Ergänzung näher beschrieben). Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Instrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert, die auf führende Weltwährungen lauten.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)              | 2,36 %   | 4,48 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)               | 2,31 %   | 4,54 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)                   | 2,19 %   | 4,14 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)             | 2,09 %   | 4,10 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)                     | 1,94 %   | 3,68 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)            | 2,24 %   | 2,65 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)                    | 2,60 %   | 2,43 %                |
| Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index <sup>3</sup>    | 1,76 %   | 3,55 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                     |          |                       |
| Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 04. Okt. 2016) | 10,20 %  | (0,58 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index <sup>3</sup>  | 10,01 %  | (0,51 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006) | 1,40 %   | 3,63 %                |
| Bloomberg Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index <sup>3</sup>    | 0,80 %   | 2,51 %                |

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

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                               | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                               |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)                                                       | 3,52 %   | 6,09 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)                                                        | 3,53 %   | 6,11 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)                                                            | 3,33 %   | 4,77 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2023)                                                             | 3,33 %   | 11,44 %               |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)                                                      | 3,27 %   | 5,66 %                |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)                                                       | 3,29 %   | 5,01 %                |
| BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)                                                         | 2,68 %   | 4,71 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)                                                             | 3,06 %   | 5,09 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)                                                              | 3,08 %   | 5,15 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)                                                     | 3,48 %   | 6,12 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)                                                      | 3,40 %   | 4,60 %                |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)                                                             | 3,08 %   | 4,69 %                |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)                                                          | 3,09 %   | 3,80 %                |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                                                             | 3,42 %   | 4,70 %                |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                                                             | 2,90 %   | 3,56 %                |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                                                              | 2,92 %   | 3,56 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD <sup>3</sup> | 4,43 %   | 6,45 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                                                               |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)                                          | 1,46 %   | 3,92 %                |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)                                           | 1,51 %   | 2,76 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF <sup>3</sup> | 2,20 %   | 4,27 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                               |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)                                           | 2,61 %   | 4,69 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)                                           | 2,66 %   | 4,88 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)                                               | 2,42 %   | 3,66 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                                                | 2,18 %   | 3,86 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)                                                 | 2,18 %   | 2,12 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR <sup>3</sup> | 3,41 %   | 5,06 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                               |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)                                           | 3,56 %   | 4,74 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)                                           | 3,74 %   | 5,70 %                |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)                                                 | 3,16 %   | 5,50 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP <sup>3</sup> | 4,43 %   | 5,92 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                                                               |          |                       |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)                                                 | 2,25 %   | 3,49 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD <sup>3</sup> | 3,41 %   | 4,83 %                |

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

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                                                                                                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)                                                                                                                                                                              | 3,72 %   | 8,39 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 17. Jun. 2024)                                                                                                                                                                                     | 3,26 %   | 7,44 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)                                                                                                                                                                                    | 4,09 %   | 9,06 %                |
| Jeweils 0,25-Jahres-Duration: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index und JPMorgan Emerging Market Bond Index („EMBI“) Global              | 4,62 %   | 9,67 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)                                                                                                                                                                 | 2,89 %   | 6,56 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jun. 2024)                                                                                                                                                                        | 2,39 %   | 5,57 %                |
| Jeweils 0,25-Jahres-Duration: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index und JPMorgan Emerging Market Bond Index („EMBI“) Global (EUR Hedged) | 3,59 %   | 7,67 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2024)                                                                                                                                                                 | 3,82 %   | 8,29 %                |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jun. 2024)                                                                                                                                                                        | 3,40 %   | 7,37 %                |
| Jeweils 0,25-Jahres-Duration: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index und JPMorgan Emerging Market Bond Index („EMBI“) Global (GBP Hedged) | 4,61 %   | 9,49 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                      |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2024)                                                                                                                                                                 | 2,69 %   | 5,98 %                |
| Jeweils 0,25-Jahres-Duration: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index und JPMorgan Emerging Market Bond Index („EMBI“) Global (SEK Hedged) | 3,50 %   | 7,06 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

|                                                                               | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)                       | 3,81 %   | 4,46 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)                        | 3,83 %   | 4,58 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)                            | 3,65 %   | 4,00 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)                             | 3,64 %   | 4,64 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)                      | 3,57 %   | 4,48 %                |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)                       | 3,54 %   | 4,48 %                |
| BM Retail, dekulmlierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)                           | 3,06 %   | 3,82 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)                             | 3,37 %   | 4,24 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)                              | 3,41 %   | 3,48 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)                     | 3,72 %   | 4,41 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)                       | 3,71 %   | 2,23 %                |
| M Retail, dekulmlierend (Auflegung: 21. Dez. 2023)                            | 3,35 %   | 4,70 %                |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)                             | 3,32 %   | 2,12 %                |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)                          | 3,37 %   | 2,31 %                |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                             | 3,65 %   | 2,66 %                |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                              | 3,65 %   | 2,66 %                |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                             | 3,24 %   | 1,54 %                |
| Class W, thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                             | 3,86 %   | 0,47 %                |
| Class W, ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                              | 3,86 %   | 0,48 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)                          | 3,61 %   | 3,89 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                              |          |                       |
| Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2013)   | 7,92 %   | 2,33 %                |
| Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 06. Sep. 2016)    | 7,94 %   | 1,78 %                |
| H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021) | 7,80 %   | (0,77 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)                        | 7,66 %   | 2,16 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2020)           | 3,84 %   | 1,22 %                |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)                | 3,71 %   | 1,18 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged)                          | 3,46 %   | 1,71 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)          | 1,75 %   | 1,98 %                |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)           | 1,80 %   | (0,10 %)              |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)                | 1,60 %   | 0,95 %                |
| Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)                | 1,58 %   | 2,61 %                |
| Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)         | 1,52 %   | 0,02 %                |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)                | 1,28 %   | 0,19 %                |
| Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                | 1,73 %   | (2,58 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)                          | 1,46 %   | 2,22 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CZK lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)            | 3,58 %   | 2,27 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged)                          | 3,22 %   | 2,28 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                               |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)          | 2,93 %   | 3,53 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)           | 2,92 %   | 3,49 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)                | 2,72 %   | 3,03 %                |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)                | 2,71 %   | 3,44 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)         | 2,64 %   | 3,18 %                |

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

|                                                                                 | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)            | 2,67 %   | 3,18 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                  | 2,50 %   | 2,43 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)                   | 2,50 %   | 1,42 %                |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                   | 2,73 %   | 1,05 %                |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)                  | 2,20 %   | (0,24 %)              |
| Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                  | 2,95 %   | (1,24 %)              |
| Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                   | 3,03 %   | (1,23 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)                            | 2,64 %   | 2,81 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                                |          |                       |
| Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012) | (4,78 %) | 2,61 %                |
| Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)        | (5,17 %) | 0,83 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged)                          | (5,03 %) | 2,61 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)            | 3,93 %   | 4,05 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)             | 3,91 %   | 4,22 %                |
| Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)                  | 3,72 %   | 4,19 %                |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)            | 3,65 %   | 4,01 %                |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)                   | 3,38 %   | 3,68 %                |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                   | 3,74 %   | 2,04 %                |
| Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                  | 3,85 %   | (0,02 %)              |
| Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Aug. 2020)                   | 3,85 %   | (0,01 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)                            | 3,63 %   | 3,46 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Mrz. 2024)           | 4,88 %   | 6,55 %                |
| Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)          | 4,63 %   | 1,74 %                |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)                | 4,43 %   | 1,35 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) Index denominated in HKD   | 4,70 %   | 2,48 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)            | 3,97 %   | 3,27 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged)                            | 3,67 %   | 3,00 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)            | 2,86 %   | 3,13 %                |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)           | 2,55 %   | 0,96 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)                            | 2,53 %   | 2,67 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                                 |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)             | 2,90 %   | 2,30 %                |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)                   | 2,75 %   | 1,23 %                |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)           | 2,71 %   | 0,77 %                |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)                   | 2,57 %   | 1,78 %                |
| Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Okt. 2020)                   | 3,03 %   | (0,57 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged)                            | 2,65 %   | 2,52 % <sup>2</sup>   |

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

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



Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                       | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)               | 4,00 %   | 3,00 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)                | 3,99 %   | 1,81 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mai 2021)                     | 3,85 %   | (0,07 %)              |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)                     | 3,53 %   | (0,08 %)              |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)                      | 3,53 %   | (0,08 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)                  | 3,61 %   | 2,71 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)  | 1,85 %   | (0,16 %)              |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)   | 1,89 %   | (2,19 %)              |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)        | 1,44 %   | (3,06 %)              |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)         | 1,33 %   | (3,08 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)                  | 1,46 %   | (0,48 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)  | 3,09 %   | 0,96 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)   | 3,11 %   | (0,90 %)              |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Jan. 2023)        | 2,92 %   | 3,92 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)        | 2,60 %   | (1,81 %)              |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)         | 2,55 %   | (1,82 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)                  | 2,64 %   | 0,65 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)  | 4,06 %   | 2,13 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019)     | 4,03 %   | 1,55 %                |
| Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)        | 3,55 %   | (0,69 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)                  | 3,63 %   | 1,82 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2022)  | 2,95 %   | 5,58 %                |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019) | 2,69 %   | (0,77 %)              |
| Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)                  | 2,53 %   | (0,52 %) <sup>2</sup> |

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

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

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund beabsichtigt, seine Erträge bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, umsichtiger Anlageverwaltung und nachhaltigen Investitionen zu maximieren (indem er ausdrücklich Umwelt-, soziale und Unternehmensführungsfaktoren in den Anlageprozess integriert, wie in der Ergänzung näher beschrieben). Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) investiert.



Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                              | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                              |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)                      | 4,52 %   | 2,77 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)                           | 4,47 %   | 3,14 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)                            | 4,14 %   | 1,85 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) | 3,99 %   | 2,62 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                              |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)         | 2,49 %   | 0,26 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged) | 1,72 %   | 0,04 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                              |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)         | 3,66 %   | 1,11 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)          | 3,57 %   | 1,50 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)               | 3,13 %   | 0,19 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged) | 2,92 %   | 0,94 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                              |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)         | 4,61 %   | 2,67 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)          | 4,66 %   | 2,15 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged) | 3,96 %   | 1,98 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                              |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Sep. 2022)         | 3,71 %   | 4,08 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (SGD Hedged) | 2,99 %   | 3,20 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                             | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                             |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)                     | 3,61 %   | 4,02 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)                      | 3,59 %   | 3,69 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)                          | 3,46 %   | 3,51 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)                           | 3,46 %   | 3,86 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)                    | 3,40 %   | 3,25 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                           | 3,18 %   | 2,89 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)                            | 3,16 %   | 2,80 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)                    | 3,55 %   | 3,82 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index           | 2,88 %   | 3,74 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)</b>                            |          |                       |
| Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017) | 8,63 %   | 1,17 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index         | 7,82 %   | 0,75 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                             |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)         | 1,58 %   | 1,49 %                |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)         | 1,56 %   | (0,14 %)              |
| Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)              | 1,35 %   | 1,81 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index           | 0,67 %   | 1,10 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                             |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)        | 2,73 %   | 2,95 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)         | 2,69 %   | 2,52 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)             | 2,58 %   | 2,49 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)              | 2,27 %   | 1,76 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index           | 1,87 %   | 2,62 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                             |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)        | 3,75 %   | 3,96 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)         | 3,76 %   | 3,55 %                |
| Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)              | 3,66 %   | 1,40 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index           | 2,89 %   | 3,69 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                             |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)        | 2,80 %   | 2,95 %                |
| Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index           | 1,90 %   | 2,69 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                       | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)               | 5,36 %   | 5,26 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                | 5,31 %   | 5,27 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)                    | 5,13 %   | 4,20 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)                     | 5,22 %   | 4,22 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)              | 5,12 %   | 3,70 %                |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)               | 5,10 %   | 4,75 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                     | 4,86 %   | 4,33 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                      | 4,93 %   | 4,33 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)              | 5,23 %   | 4,09 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)               | 5,35 %   | 4,09 %                |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)                     | 5,16 %   | 3,61 %                |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)                      | 5,22 %   | 4,15 %                |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                     | 4,69 %   | 3,09 %                |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                      | 4,72 %   | 3,10 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                     | 5,64 %   | 5,83 %                |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2025)                      | —        | 2,47 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index                                        | 4,02 %   | 1,68 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)  | 5,35 %   | 2,94 %                |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2023)   | 5,34 %   | 7,64 %                |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)         | 5,09 %   | 2,88 %                |
| Administrative AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Aug. 2024) | 5,11 %   | 4,90 %                |
| Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)  | 5,06 %   | 3,32 %                |
| Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)         | 4,85 %   | 2,48 %                |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)      | 5,60 %   | 4,58 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index                           | 3,87 %   | 1,19 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf BRL lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)  | 23,68 %  | 6,59 %                |
| Bloomberg Global Aggregate (BRL Hedged) Index                         | 7,04 %   | 7,94 %                |
| <b>Auf CAD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)  | 4,57 %   | 4,04 %                |
| Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)   | 4,65 %   | 3,74 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)                           | 3,17 %   | 0,90 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)  | 3,26 %   | 1,76 %                |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)   | 3,23 %   | 1,59 %                |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)        | 2,82 %   | 1,07 %                |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)         | 2,65 %   | 1,07 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index                           | 1,85 %   | (0,77 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf CNH lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2023)   | 4,24 %   | 5,84 %                |
| Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)       | 4,06 %   | 3,52 %                |
| Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2013)          | 3,78 %   | 4,58 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index                           | 3,01 %   | 3,00 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)  | 4,40 %   | 3,62 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)   | 4,37 %   | 3,61 %                |

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

|                                                                        | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014) | 4,46 %   | 2,57 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)        | 4,23 %   | 2,05 %                |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)          | 4,16 %   | 2,11 %                |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)       | 4,24 %   | 2,27 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)  | 4,19 %   | 2,02 %                |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)   | 4,03 %   | 1,90 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)         | 3,94 %   | 2,69 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)          | 3,93 %   | 2,69 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)       | 3,86 %   | 1,38 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)     | 3,88 %   | 1,11 %                |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)         | 4,01 %   | 0,85 %                |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2025)          | —        | 2,90 %                |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)          | 4,23 %   | 2,40 %                |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)         | 3,72 %   | 1,24 %                |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)          | 3,73 %   | 1,25 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index                            | 3,02 %   | 0,09 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                    |          |                       |
| Class R EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2025)        | —        | (0,30 %)              |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Unhedged) Index                          | —        | (0,72 %)              |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)   | 5,38 %   | 3,34 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)    | 5,43 %   | 3,95 %                |
| Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)         | 5,25 %   | 2,55 %                |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)  | 5,09 %   | 2,82 %                |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)          | 4,96 %   | 2,22 %                |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)          | 5,26 %   | 4,30 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index                            | 4,02 %   | 1,09 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)  | 6,40 %   | 4,69 %                |
| Investor HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2023)       | 6,29 %   | 10,74 %               |
| Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017) | 6,21 %   | 3,69 %                |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Feb. 2013)        | 6,01 %   | 3,84 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index                          | 5,12 %   | 1,87 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf HUF lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Class E HUF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2024)         | 5,79 %   | 5,90 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (HUF Hedged) Index                            | 4,92 %   | 4,81 %                |
| <b>Auf JPY lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mrz. 2023)   | 3,23 %   | 2,39 %                |
| Institutional JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2024)    | 3,24 %   | 1,77 %                |
| Investor JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jun. 2023)        | 3,06 %   | 2,10 %                |
| Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017)         | 2,81 %   | (0,14 %)              |
| Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Dez. 2022)          | 2,79 %   | 0,85 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index                            | 1,90 %   | (1,85 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)   | 5,45 %   | 2,94 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index                            | 4,05 %   | 0,57 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2024)  | 4,05 %   | 4,06 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index                            | 2,88 %   | 1,05 %                |

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup> (Forts.)

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Jul. 2020) | 4,54 %   | 3,30 %                |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)  | 4,45 %   | 4,02 %                |
| Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2020)      | 4,25 %   | 2,26 %                |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)        | 4,22 %   | 3,03 %                |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 4,26 %   | 4,27 %                |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)        | 4,07 %   | 3,25 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index                          | 3,06 %   | 1,25 % <sup>2</sup>   |

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                 | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                 |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021)         | 5,74 %   | 2,66 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Mrz. 2023)          | 5,70 %   | 7,61 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)                | 5,29 %   | 1,75 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index                                  | 4,02 %   | (0,95 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                 |          |                       |
| Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)   | 5,20 %   | 0,74 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index                     | 3,87 %   | (2,05 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                 |          |                       |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)   | 4,40 %   | (0,08 %)              |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index                     | 3,02 %   | (2,69 %)              |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                 |          |                       |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)   | 5,36 %   | 1,26 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index                     | 4,02 %   | (1,43 %)              |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                 |          |                       |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021) | 6,38 %   | 2,02 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index                   | 5,12 %   | (0,67 %)              |
| <b>Auf JPY lautende Klassen</b>                                 |          |                       |
| Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Nov. 2023)   | 3,21 %   | 2,68 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index                     | 1,90 %   | 1,00 %                |

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

#### Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 7,13 %   | 2,28 %                |
| Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 22. Mrz. 2022)                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 6,86 %   | 1,96 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 6,58 %   | 1,14 %                |
| 45% Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15% JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20% Bloomberg Commodity Total Return Index, 10% FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10% Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (USD Hedged) <sup>3</sup>              | 7,00 %   | 2,09 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2021)                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 3,13 %   | 1,52 %                |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 2,63 %   | 0,12 %                |
| Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 2,65 %   | 0,12 %                |
| 45% Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (EUR Hedged), 15% JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged), 20% Bloomberg Commodity Total Return Index (EUR Hedged), 10% FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged) und 10% Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (EUR Hedged) <sup>3</sup> | 2,94 %   | 1,25 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 4,70 %   | 2,49 %                |
| 45% Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (GBP Hedged), 15% JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (GBP Unhedged), 20% Bloomberg Commodity Total Return Index (GBP Hedged), 10% FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged) und 10% Bloomberg Gold Subindex Total Return Index weighted (GBP Hedged) <sup>3</sup> | 4,62 %   | 2,20 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| Administrative SGD (Partially Hedged) ausschüttend II (Auflegung: 22. Feb. 2022)                                                                                                                                                                                                                                                                               | 4,41 %   | 1,35 %                |
| 45% Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (SGD Hedged), 15% JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (SGD Unhedged), 20% Bloomberg Commodity Total Return Index (SGD Hedged), 10% FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (SGD Unhedged), und 10% Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (SGD Hedged) <sup>3</sup>         | 4,54 %   | 0,68 %                |

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

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)              | 3,09 %   | 2,56 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)               | 3,11 %   | 2,55 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)                    | 2,88 %   | 2,26 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)                    | 2,95 %   | 2,15 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)             | 2,84 %   | 2,07 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)                    | 2,61 %   | 1,52 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)                     | 2,62 %   | 1,75 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)            | 2,96 %   | 1,80 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)             | 3,07 %   | 2,07 %                |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                    | 2,97 %   | 1,30 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index                  | 2,79 %   | 2,02 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012) | 2,14 %   | 0,38 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)  | 2,14 %   | 1,58 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)       | 1,71 %   | 0,05 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (EUR Hedged)     | 1,74 %   | 0,97 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017) | 3,10 %   | 1,09 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)  | 3,19 %   | 1,52 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (GBP Hedged)     | 2,76 %   | 1,00 % <sup>2</sup>   |

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

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

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



## Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)              | 3,56 %   | 2,60 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021)               | 3,56 %   | 2,21 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)       | 3,55 %   | 2,60 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 2,68 %   | 0,95 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)       | 2,14 %   | 0,04 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)       | 2,55 %   | 0,92 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 3,57 %   | 1,97 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)  | 3,58 %   | 1,77 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)       | 3,55 %   | 1,96 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf NOK lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017) | 3,59 %   | 1,74 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)       | 3,56 %   | 1,90 %                |
| <b>Auf SEK lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Aug. 2023) | 2,48 %   | 5,29 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (SEK Hedged)       | 2,43 %   | 5,08 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Dez. 2024) | 2,69 %   | 2,90 %                |
| Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (SGD Hedged)       | 2,58 %   | 2,76 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                       | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)                | 4,92 %   | 4,01 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)                 | 4,91 %   | 4,01 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)                      | 4,37 %   | 3,11 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)                      | 4,50 %   | 3,17 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2020)             | 4,81 %   | 4,23 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Jan. 2022)              | 4,75 %   | 4,53 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index                              | 2,92 %   | 2,28 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Aug. 2024)   | 4,85 %   | 5,91 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (AUD Hedged)                 | 2,77 %   | 3,34 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2023)  | 2,71 %   | 5,67 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged)                 | 0,77 %   | 1,44 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)   | 3,89 %   | 1,98 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2021)   | 3,90 %   | 2,60 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Jan. 2024) | 3,64 %   | 5,63 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)         | 3,55 %   | 1,09 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)          | 3,54 %   | 1,09 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)                 | 1,92 %   | 0,33 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)   | 4,88 %   | 3,15 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)    | 5,05 %   | 3,16 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)                 | 2,93 %   | 1,55 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                       |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2020)  | 3,97 %   | 3,54 %                |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2024)   | 3,94 %   | 6,31 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)                 | 1,96 %   | 0,74 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)              | 4,04 %   | 2,92 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)               | 4,09 %   | 2,81 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                      | 2,20 %   | 2,22 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 3,10 %   | 0,98 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)  | 3,09 %   | 0,85 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)      | 2,90 %   | 0,40 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)       | 2,79 %   | (0,07 %)              |
| Euro Short-Term Rate (ESTER) Index <sup>4</sup>                      | 1,24 %   | 0,60 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 4,10 %   | 2,12 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)  | 4,03 %   | 2,21 %                |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index <sup>5</sup>                     | 2,25 %   | 1,68 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)              | 3,83 %   | 4,58 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)               | 3,84 %   | 4,61 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index                                   | 2,20 %   | 4,83 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022) | 2,87 %   | 2,50 %                |
| Euro Short-Term Rate (ESTER)                                         | 1,23 %   | 2,95 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022) | 3,88 %   | 4,11 %                |
| ICE BofA SONIA Overnight Rate Index                                  | 2,26 %   | 4,55 %                |

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

### Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities ESG Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche langfristige Rendite erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er unter normalen Umständen mindestens zwei Drittel seines Gesamtvermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Instrumenten mit unterschiedlichen Laufzeiten investiert. Die durchschnittliche Portfolioduration dieses Fonds bewegt sich normalerweise zwischen -1 bis 5 Jahren, je nach der Prognose des Anlageberaters für den Zinssatz. Der Fonds versucht, unter normalen Marktbedingungen auf verschiedene Weise ökologische und soziale Merkmale zu bewerben, wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt, und versucht, einen Teil seines Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)              | 5,75 %   | 5,10 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)               | 5,79 %   | 5,09 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2025)                    | —        | (0,30 %)              |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)                     | 5,33 %   | 3,93 %                |
| Alerian MLP Index                                                    | 7,06 %   | 3,12 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 4,65 %   | 3,04 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)  | 4,64 %   | 3,06 %                |
| Alerian MLP Index EUR (Hedged)                                       | 6,45 %   | 1,40 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 5,42 %   | 3,50 %                |
| Alerian MLP Index GBP (Hedged)                                       | 7,40 %   | 1,76 %                |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Die vom Fonds angestrebte „Gesamtrendite“ Besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er unter normalen Umständen zwei Drittel seines Nettovermögens entweder direkt oder indirekt in ein Portfolio aus Aktien anlegt, die verbunden sind mit

(i) börsengehandelten Partnerships, die auch als Master Limited Partnerships („MLPs“) bezeichnet werden, (ii) den General Partners, die Eigentümer oder Manager von MLPs sind, (iii) Spin-Offs (Unternehmen, die nach Beteiligungsverkäufen oder Umstrukturierungen von den MLPs oder General Partner ausgegliedert werden) von MLPs, (iv) Unternehmen, die aufgrund dessen, dass sie in derselben Industrie tätig sind oder mit MLPs konkurrieren, MLPs ähnlich sind, (v) andere juristische Person, die ggf. nicht als börsengehandelte Partnership strukturiert sind, jedoch im Midstream-Energiesektor tätig sind (die Transportkomponente des Energieinfrastruktursektors wie Pipelines, Bahn und Öl sowie Öltanker) und (vi) Zweckgesellschaften (d. h. juristische Personen, die für einen bestimmten Zweck errichtet wurden, die ggf. als Anlagevehikel verwendet werden, um Zugang zu hier beschriebenen Anlagen zu erlangen). Der Fonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                         | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)                 | 4,10 %   | 2,89 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)                  | 4,11 %   | 2,89 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)                       | 3,96 %   | 2,36 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)                       | 3,94 %   | 2,54 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)                       | 3,69 %   | 1,97 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)                        | 3,66 %   | 1,98 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)                | 4,01 %   | 3,04 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 02. Okt. 2023)                | 4,02 %   | 8,22 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Jul. 2022)                       | 4,53 %   | 5,87 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                         | 2,20 %   | 2,54 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CAD lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)    | 3,28 %   | 1,72 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CAD Hedged) <sup>3</sup>            | 1,34 %   | 2,93 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)    | 1,94 %   | (0,05 %)              |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CHF Hedged) <sup>3</sup>            | 0,01 %   | (0,40 %)              |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)    | 3,15 %   | 0,91 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)     | 3,21 %   | 0,91 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,67 %   | 0,00 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>            | 1,19 %   | 0,59 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)    | 4,21 %   | 2,08 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)     | 4,10 %   | 2,07 %                |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>            | 2,19 %   | 1,76 %                |

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

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                            | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                            |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)                    | 5,91 %   | 8,07 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)                     | 5,90 %   | 9,31 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)                         | 5,70 %   | 7,57 %                |
| BE Retail, thesaurierend (Auflegung: 28. Apr. 2022)                        | 5,50 %   | 11,19 %               |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)                          | 5,43 %   | 9,59 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)                  | 5,77 %   | 12,89 %               |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 10. Jan. 2025)                       | —        | 6,50 %                |
| S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)                | 5,99 %   | 7,67 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                            |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)       | 4,72 %   | 11,94 %               |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2017)             | 4,25 %   | 9,72 %                |
| S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)   | 5,03 %   | 11,61 % <sup>2</sup>  |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                        |          |                       |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2024)      | (6,54 %) | 8,81 %                |
| S&P (EUR Unhedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | (6,50 %) | 9,02 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                             | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                             |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)     | 6,56 %   | 14,92 %               |
| S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | 5,99 %   | 14,63 %               |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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



Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                                                   | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                                                   |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)                                                           | 7,63 %   | 4,97 %                |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 28. Aug. 2024)                                                         | 7,62 %   | 7,03 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)                                                                 | 7,15 %   | 4,43 %                |
| Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)                                                               | 7,11 %   | 4,43 %                |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Aug. 2024)                                                              | 7,13 %   | 6,26 %                |
| 75% Bloomberg U.S. Aggregate Index/25% MSCI ACWI High Dividend Yield Index <sup>3</sup>                           | 5,51 %   | 4,00 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                                                   |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)                                              | 5,52 %   | 3,86 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Aug. 2024)                                                   | 5,42 %   | 5,00 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)                                                    | 5,05 %   | 2,91 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)                                                  | 5,03 %   | 2,91 %                |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)                                                    | 4,86 %   | 1,95 %                |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)                                                     | 4,91 %   | 1,96 %                |
| Class Z EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2024)                                                    | 6,04 %   | 7,10 %                |
| 75% Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Hedged)/25% MSCI ACWI High Dividend Yield Index (EUR Hedged) <sup>3</sup> | 3,49 %   | 2,52 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                                                   |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Aug. 2024)                                              | 6,49 %   | 6,70 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jul. 2022)                                               | 6,49 %   | 7,65 %                |
| 75% Bloomberg U.S. Aggregate Index (GBP Hedged)/25% MSCI ACWI High Dividend Yield Index (GBP Hedged) <sup>3</sup> | 4,49 %   | 2,91 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf ILS lautende Klassen</b>                                                                                   |          |                       |
| Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Aug. 2024)                                              | 6,21 %   | 6,00 %                |
| 75% Bloomberg U.S. Aggregate Index (ILS Hedged)/25% MSCI ACWI High Dividend Yield Index (ILS Hedged) <sup>3</sup> | 4,06 %   | 1,92 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                                                                   |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Aug. 2024)                                              | 5,62 %   | 5,20 %                |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Aug. 2024)                                                 | 5,18 %   | 4,48 %                |
| 75% Bloomberg U.S. Aggregate Index (SGD Hedged)/25% MSCI ACWI High Dividend Yield Index (SGD Hedged) <sup>3</sup> | 3,50 %   | 0,95 %                |

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

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

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

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

## Total Return Bond Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                        | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)                | 4,91 %   | 4,47 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)                 | 4,90 %   | 4,45 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)                     | 4,76 %   | 3,93 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)                      | 4,75 %   | 3,90 %                |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)                | 4,66 %   | 3,10 %                |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2022)                | 4,59 %   | 2,88 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                      | 4,46 %   | 2,85 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)                       | 4,49 %   | 2,77 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)              | 4,86 %   | 3,71 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)                | 4,82 %   | 1,87 %                |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)                      | 4,31 %   | 0,80 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index                                         | 4,02 %   | 3,97 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf CAD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)     | 4,15 %   | 1,48 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index                            | 3,17 %   | 1,36 %                |
| <b>Auf CHF lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)   | 2,76 %   | 0,05 %                |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)        | 2,57 %   | (0,30 %)              |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)        | 2,32 %   | (1,36 %)              |
| Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index                            | 1,85 %   | (0,17 %) <sup>2</sup> |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)   | 4,04 %   | 2,62 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)    | 3,98 %   | 2,55 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)        | 3,85 %   | 2,15 %                |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)  | 3,82 %   | 1,00 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)         | 3,55 %   | 1,73 %                |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)          | 3,54 %   | (0,24 %)              |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)         | 3,85 %   | (0,01 %)              |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)         | 3,31 %   | (0,93 %)              |
| Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index                            | 3,02 %   | 2,09 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)</b>                    |          |                       |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002) | (7,41 %) | 2,91 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Unhedged) Index                    | (8,24 %) | 2,47 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)   | 5,07 %   | 2,17 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)    | 5,01 %   | 3,46 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index                            | 4,02 %   | 2,93 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf HKD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)       | 5,56 %   | 1,07 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index                          | 5,12 %   | 1,88 %                |
| <b>Auf SGD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)   | 4,05 %   | 2,02 %                |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)         | 3,62 %   | 2,19 %                |
| Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index                            | 3,06 %   | 2,58 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

## PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                      | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)              | (8,40 %) | 0,87 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)                    | (8,94 %) | (0,22 %)              |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)            | (8,50 %) | (5,11 %)              |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2021)                    | (7,75 %) | (0,34 %)              |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index <sup>3</sup>                      | 2,20 %   | 2,23 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | (9,32 %) | (0,79 %)              |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)       | (9,71 %) | (1,87 %)              |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged) <sup>3</sup>         | 1,19 %   | 0,52 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                      |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2022)  | (8,37 %) | (7,72 %)              |
| ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged) <sup>3</sup>         | 2,19 %   | 4,58 %                |

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

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                           | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-----------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                           |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)   | 3,65 %   | 4,27 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)    | 3,68 %   | 1,29 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2024) | 3,74 %   | 4,07 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)         | 3,88 %   | (0,16 %)              |
| ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index           | 3,45 %   | 4,03 % <sup>2</sup>   |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

|                                                                  | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                  |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)          | 3,78 %   | 3,95 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)           | 3,85 %   | 4,80 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index <sup>3</sup> | 2,47 %   | 3,52 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                                  | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                                  |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)                           | 4,33 %   | 5,76 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)                           | 4,34 %   | 6,08 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)                               | 4,13 %   | 5,41 %                |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)                                | 4,12 %   | 5,39 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                                | 3,85 %   | 4,65 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)                                 | 3,82 %   | 4,72 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)                        | 4,23 %   | 6,73 %                |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)                         | 4,15 %   | 3,55 %                |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)                                | 3,90 %   | 4,57 %                |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)                                | 4,19 %   | 4,75 %                |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)                                | 4,65 %   | 5,83 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index <sup>3</sup>              | 4,55 %   | 5,98 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                                  |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)             | 3,37 %   | 5,06 %                |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)              | 3,43 %   | 4,41 %                |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)                  | 3,24 %   | 4,95 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)                   | 2,92 %   | 3,43 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) <sup>3</sup> | 3,55 %   | 5,69 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                                  |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)             | 4,34 %   | 5,76 %                |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)              | 4,32 %   | 4,11 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) <sup>3</sup> | 4,56 %   | 6,23 % <sup>2</sup>   |

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

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                        | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)                | 4,48 %   | 2,45 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)                 | 4,48 %   | 2,45 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)                      | 4,06 %   | 0,00 %                |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)                       | 4,11 %   | 1,33 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)              | 4,32 %   | 4,51 %                |
| Bloomberg U.S. Credit Index                                            | 4,22 %   | 2,31 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)   | 3,52 %   | 0,31 %                |
| Bloomberg U.S. Credit Index (EUR Hedged)                               | 3,24 %   | 0,14 %                |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                        |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016) | 4,46 %   | 1,40 %                |
| Bloomberg U.S. Credit Index (GBP Hedged)                               | 4,24 %   | 1,27 %                |

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

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

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

Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum<sup>1</sup>

Anlageziel und Überblick über die Strategie

|                                                                         | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|-------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| <b>Auf USD lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)                 | 2,35 %   | 2,45 %                |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2020)                   | 2,35 %   | 3,11 %                |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)                      | 2,20 %   | 2,09 %                |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)                       | 2,12 %   | 2,05 %                |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)               | 2,23 %   | 2,72 %                |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)                        | 2,57 %   | 2,93 %                |
| FTSE 3-Month Treasury Bill Index                                        | 2,21 %   | 1,83 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf AUD lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Aug. 2024)     | 2,24 %   | 3,94 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (AUD Hedged)         | 1,92 %   | 3,41 %                |
| <b>Auf EUR lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)    | 1,40 %   | 0,91 %                |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016) | 1,17 %   | 0,42 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)         | 1,07 %   | 0,20 % <sup>2</sup>   |
| <b>Auf GBP lautende Klassen</b>                                         |          |                       |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2023)      | 2,43 %   | 5,71 %                |
| ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (GBP Hedged)         | 2,07 %   | 4,87 %                |

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

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

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



## Beschreibungen der Vergleichsindizes

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

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

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

| Offizieller Name des Vergleichsindex                                                       | Beschreibung des Index                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)</b>                                | Bei dem Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbrieft Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                     |
| <b>Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index</b>                                | Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)</b>                                        | Der Bloomberg MSCI Green Bond (USD Hedged) Index bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>Bloomberg U.S. Aggregate Index</b>                                                      | Der Bloomberg U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf US-Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <b>Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index</b>                                            | Der Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>Bloomberg U.S. Credit Index</b>                                                         | Bei dem Bloomberg U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen US-Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Schuldscheinen sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <b>Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index</b>                 | Der Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| <b>Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)</b>        | Bei dem Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <b>Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)</b>                                                | Der Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) misst die Kosten für die Finanzierung von allgemeinen Übermachtfinanzierungen von Sicherheiten in kanadischen Dollar, wobei Staatsanleihen und Anleihen der kanadischen Regierung als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verwendet werden.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>FTSE 3-Month Treasury Bill Index</b>                                                    | Bei dem FTSE 3-Month Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <b>FTSE Euro Broad Investment-Grade Index</b>                                              | Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <b>ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (USD Hedged)</b> | Der ICE BB-B Rated Developed Markets High Yield ESG Tilt Constrained Index (USD Hedged) enthält alle Wertpapiere des ICE BofA Global High Yield Index (der „Hauptindex“), sofern alle Wertpapiere: 1) auf der Grundlage des Durchschnitts von Moody's, S&P und Fitch ein Rating von BB1 bis B3 aufweisen; 2) ein Länderrisiko der entwickelten Märkte aufweisen. Entwickelte Märkte sind definiert als die FX-G10-Mitglieder, westeuropäischen Länder oder Territorien der USA oder westeuropäischer Länder. Der FX-G10 umfasst alle Euro-Mitglieder, die USA, Japan, das Vereinigte Königreich, Kanada, Australien, Neuseeland, die Schweiz, Norwegen und Schweden. Die Wertpapiergewichtungen des resultierenden Hauptindex werden angepasst, um den allgemeinen Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungs-Risiko-Score des Index zu verbessern. |
| <b>ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index</b>                                         | Der ICE BofA 3-Month German Treasury Bill Index umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei jeder Neugewichtung am Monatsende ausgewählte Emission ist der ausstehende deutsche Schatzwechsel, dessen Laufzeit drei Monaten ab dem Neugewichtungstag am nächsten kommt, jedoch mindestens einen Monat beträgt. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss ein Schatzwechsel am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein.                                                                                                                                                                                                                              |

| Offizieller Name des Vergleichsindex                                                      | Beschreibung des Index                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index</b>                                              | Beim ICE BofA 1-3 Year U.S. Treasury Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Milliarde USD umlaufendem Nennwert und einer Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit von mindestens einem und weniger als drei Jahren enthält. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| <b>ICE BofA 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)</b>                                  | Der ICE BofA 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged) umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Schatzwechsel gewählt werden.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained Index</b>                       | Der ICE BofA BB-B European Currency High Yield Constrained Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von auf EUR und GBP lautenden Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade abbildet, die auf den Eurobond-, GBP- oder EUR-Inlandsmärkten öffentlich begeben wurden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Das Engagement gegenüber einzelnen Emittenten im Index ist auf 3 % beschränkt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD</b> | Der ICE BofA BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrierschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Verbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. |
| <b>ICE BofA Sterling Non-Gilts 10+ Index</b>                                              | Der ICE BofA Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>ICE BofA Sterling Non-Gilts Index</b>                                                  | Der ICE BofA Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasi-staatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb des Vereinigten Königreichs ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>ICE BofA U.S. High Yield Constrained Index</b>                                         | Der ICE BofA U.S. High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <b>ICE BofA SARON Overnight Rate Index</b>                                                | Der ICE BofA SARON Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SARON bis zu einer angegebenen Fälligkeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau die angegebene Fälligkeit hat und dessen Kupon dem Fixing-Satz des betreffenden Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (zum Preis einer Rendite, die dem Fixing-Satz des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument umgewandelt wird.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <b>ICE BofA SOFR Overnight Rate Index</b>                                                 | Der ICE BofA SOFR Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SOFR bis zu einer angegebenen Fälligkeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau die angegebene Fälligkeit hat und dessen Kupon dem Fixing-Satz des betreffenden Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (zum Preis einer Rendite, die dem Fixing-Satz des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument umgewandelt wird. Der SOFR (Secured Overnight Financing Rate) ist ein Tagesgeldsatz (der rückwirkend veröffentlicht wird), der vom Alternative Reference Rates Committee („ARRC“) als Nachfolger des USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) ausgewählt wurde. Der SOFR ist besichert (durch Treasuries) und transaktionsbasiert und wird von der Federal Reserve Bank of New York berechnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>ICE BofA SONIA Overnight Rate Index</b>                                                | Der ICE BofA SONIA Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SONIA bis zu einer angegebenen Fälligkeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert, das genau die angegebene Fälligkeit hat und dessen Kupon dem Fixing-Satz des betreffenden Tages entspricht. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft wird (zum Preis einer Rendite, die dem Fixing-Satz des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument umgewandelt wird.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <b>JPMorgan Asia Credit Index</b>                                                         | Der JPMorgan Asia Credit Index misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf US-Dollar lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet eine Benchmark für Anlagemöglichkeiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten sowie von Unternehmen aus Asien (ohne Japan) begeben werden.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)</b>                 | Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrierschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |



## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

| Offizieller Name des Vergleichsindex                                                       | Beschreibung des Index                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)</b>                               | Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden US-Dollar Außenhandel nach. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global</b>                                  | Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <b>JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified</b>                  | Der JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden und Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsfaktoren in den Aufbau des Index einbeziehen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <b>JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index</b>        | Der JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified (JESG GBI-EM) bildet die Wertentwicklung von Anleihen nach, die von Regierungen von Schwellenländern begeben werden und auf die lokale Währung des Emittenten lauten. Der Index wendet eine Scoring- und Screening-Methode für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) an, um Emittenten, die bei ESG-Kriterien höher eingestuft sind, und Emissionen von grünen Anleihen zu bevorzugen und Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten oder zu entfernen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)</b> | Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| <b>JPMorgan Asia Credit Index Composite Total Return (EUR Hedged)</b>                      | Der JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet eine Benchmark für Anlagemöglichkeiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Instrumenten, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten sowie von Unternehmen aus Asien (ohne Japan) begeben werden.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade</b>                                     | Der JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade umfasst festverzinsliche, auf US-Dollar lautende hochverzinsliche Anleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JPMorgan Asia Credit Index Non-Investment Grade enthält sowohl fest- als auch variabel verzinsliche Anleihen, die von in Asien ansässigen Körperschaften begeben wurden und einen ausstehenden Nennbetrag von mindestens 150 Mio. USD sowie eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)</b>                            | Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten, abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. PIMCOs GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC. |
| <b>S&amp;P 500 Index</b>                                                                   | Der S&P 500 Index ist ein nicht gemanagter Marktindex, der allgemein als repräsentativ für den Aktienmarkt insgesamt gilt. Der Index konzentriert sich auf das Large Cap-Segment des US-Aktienmarkts. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <b>SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average</b>                                     | Der Singapore Overnight Rate Average (SORA) ist der volumengewichtete Durchschnittssatz für Kreditgeschäfte auf dem unbesicherten Interbanken-Tagesgeldmarkt in Singapur in US-Dollar.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

## Finanzstatus

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                | PIMCO Asia High<br>Yield Bond Fund |                      | Asia Strategic<br>Interest Bond Fund |                      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|----------------------|--------------------------------------|----------------------|
|                                                                                                | Zum<br>30. Jun. 2025               | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                 | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                                 |                                    |                      |                                      |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                          |                                    |                      |                                      |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                       | \$ 1.352.439                       | \$ 1.592.412         | \$ 226.441                           | \$ 199.132           |
| Investmentfonds                                                                                | 113.175                            | 183.473              | 22.052                               | 22.518               |
| Pensionsgeschäfte                                                                              | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Finanzderivate                                                                                 | 17.252                             | 5.624                | 2.323                                | 556                  |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                            | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Zahlungsmittel                                                                                 | 6.055                              | 38.744               | 1.313                                | 2.133                |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                      | 17.504                             | 19.112               | 2.137                                | 1.925                |
| Forderungen aus Einkünften                                                                     | 23.573                             | 27.209               | 3.680                                | 3.083                |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                             | 10                                 | 1.439                | 19                                   | 823                  |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                         | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                       | 2.374                              | 1.424                | 448                                  | 769                  |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                        | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                              | 6.606                              | 7.902                | 610                                  | 1.150                |
| Sonstige Aktiva                                                                                | 54                                 | 128                  | 0                                    | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                            | <b>1.539.042</b>                   | <b>1.877.467</b>     | <b>259.023</b>                       | <b>232.089</b>       |
| <b>Passiva:</b>                                                                                |                                    |                      |                                      |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:                  |                                    |                      |                                      |                      |
| Finanzderivate                                                                                 | (11.888)                           | (16.549)             | (1.709)                              | (2.257)              |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                        | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                       | (18.803)                           | (801)                | (2.652)                              | (928)                |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                                   | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                          | (211)                              | (2.452)              | (151)                                | (185)                |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                                  | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                        | (900)                              | (1.135)              | (134)                                | (124)                |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                       | (23.561)                           | (18.793)             | (702)                                | 0                    |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                    | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                             | (24)                               | (37)                 | 0                                    | 0                    |
| Überziehungskredit                                                                             | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                          | (164)                              | (102)                | (2)                                  | (2)                  |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                           | (6.615)                            | (3.905)              | (996)                                | (74)                 |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                      | (9.071)                            | 0                    | (301)                                | 0                    |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                     | 0                                  | 0                    | 0                                    | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(71.237)</b>                    | <b>(43.774)</b>      | <b>(6.647)</b>                       | <b>(3.570)</b>       |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                        | <b>\$ 1.467.805</b>                | <b>\$ 1.833.693</b>  | <b>\$ 252.376</b>                    | <b>\$ 228.519</b>    |

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

| PIMCO Balanced<br>Income and Growth Fund |                      | PIMCO Capital<br>Securities Fund |                      | PIMCO Climate<br>Bond Fund |                      | Commodity Real<br>Return Fund |                      |
|------------------------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|----------------------------|----------------------|-------------------------------|----------------------|
| Zum<br>30. Jun. 2025                     | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025             | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025          | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| \$ 2.670.246                             | \$ 1.390.477         | \$ 5.132.422                     | \$ 4.808.550         | \$ 340.580                 | \$ 301.818           | \$ 984.365                    | \$ 1.042.108         |
| 161.103                                  | 101.087              | 53                               | 52                   | 0                          | 0                    | 31                            | 30                   |
| 26.500                                   | 15.200               | 39.100                           | 0                    | 3.000                      | 8.000                | 2.000                         | 14.600               |
| 53.503                                   | 10.010               | 122.628                          | 70.306               | 11.942                     | 5.404                | 23.315                        | 19.479               |
| 0                                        | 0                    | 30.546                           | 31.818               | 0                          | 0                    | 0                             | 0                    |
| 6.641                                    | 4.072                | 4.701                            | 11.976               | 1.189                      | 1.829                | 3.162                         | 2.353                |
| 23.208                                   | 24.034               | 120.035                          | 103.904              | 5.785                      | 4.258                | 32.680                        | 12.408               |
| 9.307                                    | 4.669                | 49.510                           | 48.801               | 3.671                      | 3.424                | 3.101                         | 2.847                |
| 436                                      | 424                  | 27.728                           | 0                    | 0                          | 0                    | 26.565                        | 239.014              |
| 494.774                                  | 194.208              | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | 66.774                        | 78.707               |
| 19.302                                   | 54.212               | 4.686                            | 1.795                | 1.095                      | 134                  | 3.442                         | 1.538                |
| 0                                        | 0                    | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | 0                             | 0                    |
| 22.610                                   | 15.104               | 23.779                           | 24.829               | 782                        | 1.320                | 14.980                        | 13.637               |
| 0                                        | 19                   | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | 0                             | 0                    |
| 3.487.630                                | 1.813.516            | 5.555.188                        | 5.102.031            | 368.044                    | 326.187              | 1.160.415                     | 1.426.721            |
| (28.536)                                 | (22.975)             | (105.631)                        | (61.971)             | (9.738)                    | (4.995)              | (42.856)                      | (11.708)             |
| 0                                        | 0                    | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | (14.912)                      | 0                    |
| (2.998)                                  | (2.289)              | (64.624)                         | (18.735)             | (2.635)                    | 0                    | (400)                         | (109)                |
| (847.975)                                | (392.609)            | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | (101.943)                     | (163.352)            |
| (3.150)                                  | (616)                | (8.819)                          | (4.645)              | (642)                      | (102)                | (1.179)                       | (1.712)              |
| 0                                        | 0                    | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | 0                             | 0                    |
| (2.707)                                  | (1.538)              | (4.242)                          | (4.171)              | (138)                      | (135)                | (607)                         | (632)                |
| (8.252)                                  | 0                    | (263.325)                        | (204.756)            | (484)                      | 0                    | (248.664)                     | (462.510)            |
| 0                                        | 0                    | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | 0                             | (25.016)             |
| (64)                                     | (6)                  | (190)                            | (202)                | 0                          | (1)                  | (5)                           | (6)                  |
| 0                                        | 0                    | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | 0                             | 0                    |
| (4)                                      | (253)                | (225)                            | (1.061)              | (461)                      | (371)                | (22)                          | (6)                  |
| (25.308)                                 | (12.575)             | (37.370)                         | (28.728)             | (2.653)                    | (1.750)              | (19.307)                      | (14.858)             |
| (22.146)                                 | (642)                | (36.780)                         | (24.728)             | (1.990)                    | (620)                | (4.508)                       | (7.778)              |
| 0                                        | 0                    | 0                                | 0                    | 0                          | 0                    | 0                             | 0                    |
| (941.140)                                | (433.503)            | (521.206)                        | (348.997)            | (18.741)                   | (7.974)              | (434.403)                     | (687.687)            |
| \$ 2.546.490                             | \$ 1.380.013         | \$ 5.033.982                     | \$ 4.753.034         | \$ 349.303                 | \$ 318.213           | \$ 726.012                    | \$ 739.034           |



## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                            | PIMCO Credit<br>Opportunities Bond Fund |                      | Diversified<br>Income Fund |                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|----------------------------|----------------------|
|                                                                                            | Zum<br>30. Jun. 2025                    | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025       | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                             |                                         |                      |                            |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                      |                                         |                      |                            |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                   | \$ 187.852                              | \$ 129.934           | \$ 9.646.076               | \$ 8.015.844         |
| Investmentfonds                                                                            | 536                                     | 12.175               | 939.058                    | 868.929              |
| Pensionsgeschäfte                                                                          | 66.000                                  | 0                    | 234.518                    | 968.508              |
| Finanzderivate                                                                             | 7.107                                   | 1.796                | 223.651                    | 106.737              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                        | 0                                       | 0                    | 1.248                      | 1.301                |
| Zahlungsmittel                                                                             | 1.044                                   | 1.127                | 8.253                      | 67.598               |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                  | 8.031                                   | 2.802                | 227.063                    | 214.761              |
| Forderungen aus Einkünften                                                                 | 2.033                                   | 1.251                | 123.166                    | 94.926               |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                         | 1.627                                   | 328                  | 15.551                     | 13.427               |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                     | 5.680                                   | 21.597               | 1.684.130                  | 1.112.626            |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                   | 52                                      | 116                  | 31.026                     | 51.400               |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                    | 0                                       | 0                    | 0                          | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                          | 5.639                                   | 1.024                | 111.186                    | 124.601              |
| Sonstige Aktiva                                                                            | 0                                       | 0                    | 0                          | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                        | <b>285.601</b>                          | <b>172.150</b>       | <b>13.244.926</b>          | <b>11.640.658</b>    |
| <b>Passiva:</b>                                                                            |                                         |                      |                            |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:              |                                         |                      |                            |                      |
| Finanzderivate                                                                             | (3.401)                                 | (1.656)              | (133.981)                  | (113.960)            |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                    | 0                                       | 0                    | 0                          | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                   | (2.582)                                 | (2.022)              | (122.068)                  | (309.214)            |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                               | (17.136)                                | (39.964)             | (2.921.929)                | (2.156.239)          |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                      | (59)                                    | (9)                  | (6.788)                    | (51.245)             |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                              | 0                                       | 0                    | 0                          | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                    | (131)                                   | (91)                 | (9.256)                    | (8.234)              |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                   | (1.601)                                 | (1.160)              | (75.032)                   | (64.310)             |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                | 0                                       | 0                    | 0                          | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                         | 0                                       | 0                    | (2.227)                    | (1.210)              |
| Überziehungskredit                                                                         | 0                                       | 0                    | 0                          | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                      | 0                                       | 0                    | (4.372)                    | (5.463)              |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                       | (7.116)                                 | (1.780)              | (154.615)                  | (136.213)            |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                  | (1.203)                                 | 0                    | (73.658)                   | (10.122)             |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                 | 0                                       | 0                    | 0                          | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(33.229)</b>                         | <b>(46.682)</b>      | <b>(3.503.926)</b>         | <b>(2.856.210)</b>   |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                    | <b>\$ 252.372</b>                       | <b>\$ 125.468</b>    | <b>\$ 9.741.000</b>        | <b>\$ 8.784.448</b>  |

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

<sup>(1)</sup> Der Dynamic Multi-Asset Fund wurde am 22. November 2024 geschlossen.

| Diversified Income Duration<br>Hedged Fund |                      | Diversified Income<br>ESG Fund |                      | Dynamic<br>Bond Fund |                      | Dynamic<br>Multi-Asset Fund <sup>(1)</sup> |  |
|--------------------------------------------|----------------------|--------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------------------------------|--|
| Zum<br>30. Jun. 2025                       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025           | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2024                       |  |
| \$ 338.550                                 | \$ 286.309           | \$ 48.355                      | \$ 48.167            | \$ 5.442.809         | \$ 4.876.973         | € 0                                        |  |
| 25.742                                     | 29.652               | 5.155                          | 4.950                | 420.149              | 366.160              | 0                                          |  |
| 0                                          | 2.600                | 0                              | 0                    | 1.000.272            | 813.745              | 0                                          |  |
| 12.548                                     | 11.549               | 1.748                          | 488                  | 181.536              | 121.473              | 0                                          |  |
| 493                                        | 0                    | 0                              | 0                    | 1.260                | 1.311                | 410                                        |  |
| 1.543                                      | 1.757                | 361                            | 576                  | 15.154               | 8.674                | 233                                        |  |
| 12.770                                     | 13.408               | 699                            | 677                  | 95.965               | 95.843               | 0                                          |  |
| 4.028                                      | 3.406                | 616                            | 645                  | 35.060               | 25.831               | 1.719                                      |  |
| 802                                        | 307                  | 1                              | 144                  | 1.373                | 13.005               | 0                                          |  |
| 67.524                                     | 42.317               | 2.431                          | 5.041                | 3.097.679            | 3.773.048            | 0                                          |  |
| 196                                        | 232                  | 0                              | 0                    | 2.590                | 2.628                | 0                                          |  |
| 0                                          | 0                    | 0                              | 0                    | 0                    | 0                    | 0                                          |  |
| 14.147                                     | 13.694               | 295                            | 310                  | 50.218               | 42.106               | 0                                          |  |
| 0                                          | 0                    | 0                              | 0                    | 175                  | 0                    | 0                                          |  |
| 478.343                                    | 405.231              | 59.661                         | 60.998               | 10.344.240           | 10.140.797           | 2.362                                      |  |
| (10.532)                                   | (4.585)              | (654)                          | (888)                | (128.633)            | (86.318)             | 0                                          |  |
| 0                                          | 0                    | 0                              | 0                    | (79.912)             | (78.560)             | 0                                          |  |
| (6.629)                                    | (1.860)              | (481)                          | (184)                | (116.528)            | (90.576)             | 0                                          |  |
| (112.504)                                  | (79.878)             | (4.542)                        | (9.616)              | (5.532.986)          | (6.139.097)          | 0                                          |  |
| (667)                                      | (94)                 | 0                              | (189)                | (2.129)              | (1.399)              | 0                                          |  |
| 0                                          | 0                    | 0                              | 0                    | 0                    | 0                    | (2.362)                                    |  |
| (295)                                      | (277)                | (31)                           | (31)                 | (3.196)              | (2.853)              | 0                                          |  |
| (901)                                      | (528)                | (147)                          | (144)                | (15.216)             | 0                    | 0                                          |  |
| 0                                          | 0                    | 0                              | 0                    | 0                    | 0                    | 0                                          |  |
| (2)                                        | (2)                  | (1)                            | (3)                  | (19)                 | (20)                 | 0                                          |  |
| 0                                          | 0                    | 0                              | 0                    | 0                    | 0                    | 0                                          |  |
| (129)                                      | (53)                 | 0                              | 0                    | (532)                | (85)                 | 0                                          |  |
| (13.603)                                   | (21.379)             | (398)                          | (365)                | (59.919)             | (57.023)             | 0                                          |  |
| (3.477)                                    | (50)                 | (710)                          | 0                    | (58.354)             | (14.941)             | 0                                          |  |
| 0                                          | 0                    | 0                              | 0                    | 0                    | 0                    | 0                                          |  |
| (148.739)                                  | (108.706)            | (6.964)                        | (11.420)             | (5.997.424)          | (6.470.872)          | (2.362)                                    |  |
| \$ 329.604                                 | \$ 296.525           | \$ 52.697                      | \$ 49.578            | \$ 4.346.816         | \$ 3.669.925         | € 0                                        |  |

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                            | Emerging Local<br>Bond Fund |                      | Emerging Local<br>Bond ESG Fund |                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
|                                                                                            | Zum<br>30. Jun. 2025        | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025            | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                             |                             |                      |                                 |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                      |                             |                      |                                 |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                   | \$ 4.073.387                | \$ 2.874.770         | \$ 131.976                      | \$ 123.312           |
| Investmentfonds                                                                            | 342.728                     | 221.131              | 0                               | 0                    |
| Pensionsgeschäfte                                                                          | 0                           | 0                    | 6.700                           | 3.400                |
| Finanzderivate                                                                             | 183.680                     | 189.468              | 6.045                           | 6.466                |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                        | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Zahlungsmittel                                                                             | 33.291                      | 33.106               | 1.703                           | 1.941                |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                  | 55.480                      | 87.505               | 2.017                           | 3.135                |
| Forderungen aus Einkünften                                                                 | 101.064                     | 64.667               | 3.306                           | 2.798                |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                         | 223.088                     | 315.777              | 6.558                           | 11.435               |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                     | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                   | 26.651                      | 869                  | 0                               | 0                    |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                    | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                          | 90.044                      | 88.780               | 3.044                           | 2.856                |
| Sonstige Aktiva                                                                            | 0                           | 49                   | 0                               | 2                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                        | <b>5.129.413</b>            | <b>3.876.122</b>     | <b>161.349</b>                  | <b>155.345</b>       |
| <b>Passiva:</b>                                                                            |                             |                      |                                 |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:              |                             |                      |                                 |                      |
| Finanzderivate                                                                             | (194.997)                   | (229.687)            | (5.877)                         | (7.217)              |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                    | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                   | (358.734)                   | (448.708)            | (8.413)                         | (13.854)             |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                               | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                      | (702)                       | (275)                | 0                               | 0                    |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                              | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                    | (3.138)                     | (2.254)              | (91)                            | (85)                 |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                   | (232.505)                   | (275.244)            | (10.666)                        | (14.463)             |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                         | (382)                       | (39)                 | (14)                            | (6)                  |
| Überziehungskredit                                                                         | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                      | 0                           | 0                    | 0                               | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                       | (53.434)                    | (65.705)             | (1.939)                         | (2.106)              |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                  | (23.746)                    | (13.602)             | (990)                           | (710)                |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                 | (46)                        | 0                    | (1)                             | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(867.684)</b>            | <b>(1.035.514)</b>   | <b>(27.991)</b>                 | <b>(38.441)</b>      |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                    | <b>\$ 4.261.729</b>         | <b>\$ 2.840.608</b>  | <b>\$ 133.358</b>               | <b>\$ 116.904</b>    |

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

| Emerging Markets<br>Bond Fund |                      | Emerging Markets<br>Bond ESG Fund |                      | Emerging Markets<br>Corporate Bond Fund |                      | PIMCO Emerging Markets<br>Opportunities Fund |                      |
|-------------------------------|----------------------|-----------------------------------|----------------------|-----------------------------------------|----------------------|----------------------------------------------|----------------------|
| Zum<br>30. Jun. 2025          | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025              | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                    | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                         | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| \$ 4.721.203                  | \$ 4.483.391         | \$ 3.120.670                      | \$ 2.895.537         | \$ 156.182                              | \$ 141.646           | \$ 430.159                                   | \$ 305.519           |
| 230.592                       | 58.227               | 0                                 | 0                    | 10.344                                  | 9.661                | 33.935                                       | 15.558               |
| 0                             | 0                    | 56.600                            | 93.431               | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| 138.239                       | 60.314               | 102.811                           | 37.247               | 6.569                                   | 1.055                | 33.969                                       | 30.520               |
| 0                             | 0                    | 252                               | 263                  | 313                                     | 0                    | 0                                            | 0                    |
| 7.504                         | 0                    | 17.445                            | 11.367               | 1.306                                   | 1.161                | 64                                           | 3.075                |
| 68.272                        | 63.750               | 40.045                            | 66.872               | 1.458                                   | 3.565                | 9.203                                        | 15.612               |
| 81.642                        | 77.260               | 53.345                            | 53.156               | 2.342                                   | 2.060                | 8.922                                        | 5.163                |
| 2.451                         | 75.544               | 2                                 | 15                   | 263                                     | 245                  | 1.963                                        | 200                  |
| 77.170                        | 56.074               | 0                                 | 0                    | 1.436                                   | 2.343                | 0                                            | 0                    |
| 3.721                         | 3.950                | 879                               | 352                  | 0                                       | 0                    | 310                                          | 20                   |
| 0                             | 0                    | 0                                 | 0                    | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| 40.753                        | 23.921               | 24.544                            | 16.062               | 1.395                                   | 1.254                | 14.308                                       | 15.617               |
| 0                             | 0                    | 0                                 | 0                    | 0                                       | 0                    | 35                                           | 0                    |
| 5.371.547                     | 4.902.431            | 3.416.593                         | 3.174.302            | 181.608                                 | 162.990              | 532.868                                      | 391.284              |
| (91.508)                      | (75.091)             | (55.025)                          | (70.416)             | (2.089)                                 | (3.478)              | (28.345)                                     | (27.440)             |
| 0                             | 0                    | 0                                 | 0                    | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| (50.873)                      | (55.201)             | (32.121)                          | (39.641)             | (3.973)                                 | (1.365)              | (12.585)                                     | (2.510)              |
| (133.568)                     | (112.614)            | 0                                 | 0                    | (4.803)                                 | (5.720)              | 0                                            | 0                    |
| (1.774)                       | (6.225)              | (1.213)                           | (346)                | (30)                                    | 0                    | (13)                                         | (46)                 |
| 0                             | 0                    | 0                                 | 0                    | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| (3.329)                       | (3.321)              | (1.996)                           | (1.926)              | (141)                                   | (138)                | (186)                                        | (135)                |
| (302.122)                     | (431.761)            | (258.926)                         | (357.296)            | (1.537)                                 | (5.226)              | (38.824)                                     | (13.082)             |
| 0                             | 0                    | 0                                 | (10.094)             | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| (22)                          | (20)                 | (2)                               | (2)                  | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| 0                             | (7.981)              | 0                                 | 0                    | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| (670)                         | (700)                | (402)                             | (610)                | 0                                       | 0                    | (2)                                          | (2)                  |
| (47.786)                      | (15.594)             | (28.978)                          | (12.860)             | (1.658)                                 | (1.042)              | (17.445)                                     | (18.901)             |
| (45.301)                      | (14.340)             | (41.617)                          | (4.976)              | (3.759)                                 | 0                    | (3.009)                                      | (1.970)              |
| 0                             | 0                    | 0                                 | 0                    | 0                                       | 0                    | 0                                            | 0                    |
| (676.953)                     | (722.848)            | (420.280)                         | (498.167)            | (17.990)                                | (16.969)             | (100.409)                                    | (64.086)             |
| \$ 4.694.594                  | \$ 4.179.583         | \$ 2.996.313                      | \$ 2.676.135         | \$ 163.618                              | \$ 146.021           | \$ 432.459                                   | \$ 327.198           |

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                | Emerging Markets Short-Term<br>Local Currency Fund |                      | PIMCO ESG<br>Income Fund |                      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|                                                                                                | Zum<br>30. Jun. 2025                               | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025     | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                                 |                                                    |                      |                          |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                          |                                                    |                      |                          |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                       | \$ 12.270                                          | \$ 12.360            | \$ 545.825               | \$ 346.202           |
| Investmentfonds                                                                                | 1.327                                              | 1.319                | 0                        | 0                    |
| Pensionsgeschäfte                                                                              | 0                                                  | 0                    | 100.700                  | 0                    |
| Finanzderivate                                                                                 | 945                                                | 1.005                | 17.664                   | 3.537                |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                            | 25                                                 | 0                    | 0                        | 0                    |
| Zahlungsmittel                                                                                 | 370                                                | 215                  | 37.323                   | 3.697                |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                      | 219                                                | 329                  | 9.768                    | 10.202               |
| Forderungen aus Einkünften                                                                     | 219                                                | 163                  | 3.915                    | 3.148                |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                             | 400                                                | 2.148                | 2                        | 3                    |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                         | 0                                                  | 0                    | 247.768                  | 5.028                |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                       | 0                                                  | 0                    | 598                      | 68                   |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                        | 0                                                  | 0                    | 0                        | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                              | 282                                                | 291                  | 10.442                   | 4.798                |
| Sonstige Aktiva                                                                                | 0                                                  | 0                    | 0                        | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                            | <b>16.057</b>                                      | <b>17.830</b>        | <b>974.005</b>           | <b>376.683</b>       |
| <b>Passiva:</b>                                                                                |                                                    |                      |                          |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:                  |                                                    |                      |                          |                      |
| Finanzderivate                                                                                 | (891)                                              | (1.048)              | (11.062)                 | (9.897)              |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                        | 0                                                  | 0                    | (10.519)                 | (425)                |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                       | (801)                                              | (711)                | (37.147)                 | (134)                |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                                   | 0                                                  | 0                    | (364.615)                | (8.429)              |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                          | (26)                                               | 0                    | (321)                    | (68)                 |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                                  | 0                                                  | 0                    | 0                        | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                        | (19)                                               | (21)                 | (260)                    | (187)                |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                       | 0                                                  | 0                    | (4.611)                  | (1.318)              |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                    | 0                                                  | 0                    | 0                        | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                             | 0                                                  | 0                    | (2)                      | (2)                  |
| Überziehungskredit                                                                             | 0                                                  | 0                    | 0                        | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                          | 0                                                  | 0                    | (9)                      | (8)                  |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                           | (190)                                              | (390)                | (10.236)                 | (4.372)              |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                      | 0                                                  | 0                    | (7.091)                  | 0                    |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                     | 0                                                  | 0                    | 0                        | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(1.927)</b>                                     | <b>(2.170)</b>       | <b>(445.873)</b>         | <b>(24.840)</b>      |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                        | <b>\$ 14.130</b>                                   | <b>\$ 15.660</b>     | <b>\$ 528.132</b>        | <b>\$ 351.843</b>    |

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

| Euro Bond Fund |               | Euro Credit Fund |               | Euro Income Bond Fund |               | Euro Long Average Duration Fund |               |
|----------------|---------------|------------------|---------------|-----------------------|---------------|---------------------------------|---------------|
| Zum            | Zum           | Zum              | Zum           | Zum                   | Zum           | Zum                             | Zum           |
| 30. Jun. 2025  | 31. Dez. 2024 | 30. Jun. 2025    | 31. Dez. 2024 | 30. Jun. 2025         | 31. Dez. 2024 | 30. Jun. 2025                   | 31. Dez. 2024 |
| € 1.774.919    | € 1.711.038   | € 533.087        | € 554.343     | € 2.246.962           | € 2.130.919   | € 1.640.973                     | € 1.589.074   |
| 69.294         | 148.602       | 0                | 0             | 182.452               | 163.510       | 0                               | 0             |
| 23.300         | 0             | 17.300           | 0             | 186.100               | 158.800       | 0                               | 0             |
| 25.055         | 13.147        | 4.435            | 2.419         | 74.514                | 72.900        | 13.977                          | 7.423         |
| 971            | 1.147         | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| 6.721          | 8.514         | 4.202            | 3.118         | 19.751                | 25.400        | 5.199                           | 3.092         |
| 24.705         | 40.309        | 13.596           | 10.898        | 55.949                | 63.293        | 15.690                          | 19.287        |
| 13.353         | 16.086        | 4.868            | 6.051         | 9.789                 | 12.497        | 18.532                          | 22.371        |
| 1.882          | 485           | 0                | 39            | 23                    | 1.071         | 1.171                           | 363           |
| 273.797        | 257.707       | 80.771           | 64.963        | 961.823               | 818.020       | 171.109                         | 227.239       |
| 613            | 764           | 48               | 87            | 3.829                 | 6.391         | 10                              | 35            |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| 11.768         | 17.632        | 18.046           | 11.809        | 26.282                | 21.954        | 8.404                           | 14.066        |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| 2.226.378      | 2.215.431     | 676.353          | 653.727       | 3.767.474             | 3.474.755     | 1.875.065                       | 1.882.950     |
| (16.943)       | (27.726)      | (7.369)          | (5.141)       | (24.680)              | (42.497)      | (11.715)                        | (15.335)      |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | (591)         | 0                               | 0             |
| (42.335)       | 0             | (7.341)          | (2.490)       | (10.672)              | (27.318)      | (14.131)                        | (3.000)       |
| (503.220)      | (502.009)     | (156.699)        | (130.924)     | (1.771.522)           | (1.659.159)   | (298.128)                       | (371.942)     |
| (704)          | (523)         | (20)             | (159)         | (1.075)               | (1.296)       | (137)                           | (13)          |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| (683)          | (742)         | (191)            | (213)         | (1.633)               | (1.515)       | (464)                           | (474)         |
| (2.343)        | (618)         | 0                | 0             | (4.148)               | (6.037)       | (326.771)                       | (298.700)     |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| (7)            | (7)           | 0                | 0             | (34)                  | (28)          | 0                               | 0             |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| (11.424)       | (7.158)       | (13.978)         | (8.287)       | (59.097)              | (59.174)      | (7.350)                         | (4.342)       |
| (9.821)        | (1.094)       | (789)            | 0             | (21.428)              | (271)         | (3.812)                         | (251)         |
| 0              | 0             | 0                | 0             | 0                     | 0             | 0                               | 0             |
| (587.480)      | (539.877)     | (186.387)        | (147.214)     | (1.894.289)           | (1.797.886)   | (662.508)                       | (694.057)     |
| € 1.638.898    | € 1.675.554   | € 489.966        | € 506.513     | € 1.873.185           | € 1.676.869   | € 1.212.557                     | € 1.188.893   |

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                            | Euro Short-Term Fund |                      | PIMCO European High Yield Bond Fund |                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------------------|----------------------|
|                                                                                            | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                             |                      |                      |                                     |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                      |                      |                      |                                     |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                   | € 324.256            | € 256.728            | € 437.780                           | € 326.600            |
| Investmentfonds                                                                            | 0                    | 0                    | 22.924                              | 22.472               |
| Pensionsgeschäfte                                                                          | 34.000               | 24.500               | 7.400                               | 25.900               |
| Finanzderivate                                                                             | 954                  | 298                  | 3.402                               | 1.124                |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                        | 0                    | 0                    | 82                                  | 97                   |
| Zahlungsmittel                                                                             | 1.390                | 1.433                | 2.978                               | 2.953                |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                  | 877                  | 920                  | 6.520                               | 4.330                |
| Forderungen aus Einkünften                                                                 | 1.864                | 1.454                | 5.556                               | 4.813                |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                         | 45                   | 0                    | 1.914                               | 0                    |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                     | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                   | 756                  | 1.974                | 344                                 | 812                  |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                    | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                          | 513                  | 370                  | 4.563                               | 3.080                |
| Sonstige Aktiva                                                                            | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                        | <b>364.655</b>       | <b>287.677</b>       | <b>493.463</b>                      | <b>392.181</b>       |
| <b>Passiva:</b>                                                                            |                      |                      |                                     |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:              |                      |                      |                                     |                      |
| Finanzderivate                                                                             | (540)                | (622)                | (910)                               | (1.782)              |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                    | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                   | (4.585)              | (20.703)             | (12.906)                            | (1.858)              |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                               | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                      | (380)                | (338)                | (110)                               | (111)                |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                              | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                    | (145)                | (120)                | (138)                               | (108)                |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                   | 0                    | 0                    | (6.068)                             | (2.004)              |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                         | (3)                  | (1)                  | 0                                   | 0                    |
| Überziehungskredit                                                                         | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                      | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                       | 0                    | 0                    | (4.568)                             | (2.793)              |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                  | (258)                | 0                    | (1.230)                             | 0                    |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                 | 0                    | 0                    | 0                                   | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(5.911)</b>       | <b>(21.784)</b>      | <b>(25.930)</b>                     | <b>(8.656)</b>       |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                    | <b>€ 358.744</b>     | <b>€ 265.893</b>     | <b>€ 467.533</b>                    | <b>€ 383.525</b>     |

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

| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund |                      | Global Advantage Fund |                      | Global Bond Fund     |                      | Global Bond ESG Fund |                      |
|----------------------------------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Zum<br>30. Jun. 2025                         | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025  | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| € 997.715                                    | € 944.601            | \$ 669.068            | \$ 510.334           | \$ 22.058.515        | \$ 18.041.641        | \$ 5.875.506         | \$ 4.674.438         |
| 100.487                                      | 92.956               | 7.142                 | 6.608                | 1.481.556            | 1.149.826            | 0                    | 0                    |
| 77.900                                       | 22.100               | 0                     | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    | 8.600                |
| 18.279                                       | 6.730                | 19.618                | 12.635               | 531.240              | 437.815              | 170.003              | 113.512              |
| 72                                           | 85                   | 36                    | 38                   | 144                  | 150                  | 0                    | 0                    |
| 2.865                                        | 4.215                | 3.224                 | 3.265                | 54.963               | 40.077               | 15.319               | 12.766               |
| 14.963                                       | 17.102               | 13.262                | 12.929               | 622.857              | 472.108              | 134.622              | 106.870              |
| 7.549                                        | 6.880                | 4.985                 | 4.516                | 158.782              | 131.718              | 40.373               | 38.895               |
| 1.700                                        | 693                  | 43.479                | 42.888               | 1.504.756            | 1.543.263            | 362.176              | 377.431              |
| 170.386                                      | 131.412              | 346.280               | 247.388              | 10.990.373           | 12.851.722           | 2.938.901            | 2.438.068            |
| 144                                          | 5.552                | 0                     | 16                   | 20.833               | 30.033               | 2.949                | 3.550                |
| 1.218                                        | 1.438                | 0                     | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| 9.361                                        | 8.279                | 8.680                 | 7.198                | 332.708              | 401.302              | 68.217               | 56.823               |
| 0                                            | 0                    | 0                     | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| 1.402.639                                    | 1.242.043            | 1.115.774             | 847.815              | 37.756.727           | 35.099.655           | 9.608.066            | 7.830.953            |
| (9.869)                                      | (9.248)              | (16.149)              | (15.136)             | (549.149)            | (394.927)            | (144.126)            | (152.786)            |
| 0                                            | 0                    | (39.005)              | (36.634)             | (1.320.924)          | (3.956.448)          | (383.445)            | (817.849)            |
| (13.862)                                     | (155)                | (45.679)              | (41.709)             | (1.616.030)          | (1.460.565)          | (397.512)            | (347.807)            |
| (326.449)                                    | (268.644)            | (522.748)             | (322.991)            | (16.671.880)         | (12.663.777)         | (4.213.664)          | (2.219.013)          |
| (3.108)                                      | (39)                 | 0                     | (18)                 | (20.688)             | (3.731)              | (2.429)              | (10.738)             |
| 0                                            | 0                    | 0                     | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| (269)                                        | (257)                | (256)                 | (248)                | (7.748)              | (7.610)              | (1.604)              | (1.662)              |
| (905)                                        | 0                    | (37.153)              | (827)                | (89.799)             | (346.905)            | (221.997)            | (192.888)            |
| 0                                            | 0                    | 0                     | (18.771)             | 0                    | 0                    | (25.209)             | (60.348)             |
| 0                                            | 0                    | (17)                  | (13)                 | (151)                | (170)                | (8)                  | (9)                  |
| 0                                            | 0                    | 0                     | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| 0                                            | 0                    | 0                     | 0                    | (1.481)              | (1.922)              | (1.375)              | (2.825)              |
| (9.621)                                      | (7.840)              | (8.083)               | (5.647)              | (368.193)            | (299.611)            | (64.827)             | (41.917)             |
| (10.412)                                     | (765)                | (5.800)               | (1.484)              | (171.376)            | (160.052)            | (71.532)             | (18.638)             |
| 0                                            | 0                    | 0                     | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    | 0                    |
| (374.495)                                    | (286.948)            | (674.890)             | (443.478)            | (20.817.419)         | (19.295.718)         | (5.527.728)          | (3.866.480)          |
| € 1.028.144                                  | € 955.095            | \$ 440.884            | \$ 404.337           | \$ 16.939.308        | \$ 15.803.937        | \$ 4.080.338         | \$ 3.964.473         |



## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                | Global Bond<br>Ex-US Fund |                      | Global High Yield<br>Bond Fund |                      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|----------------------|--------------------------------|----------------------|
|                                                                                                | Zum<br>30. Jun. 2025      | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025           | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                                 |                           |                      |                                |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                          |                           |                      |                                |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                       | \$ 1.270.492              | \$ 1.090.606         | \$ 2.806.544                   | \$ 2.668.395         |
| Investmentfonds                                                                                | 6.737                     | 94.828               | 182.355                        | 184.364              |
| Pensionsgeschäfte                                                                              | 0                         | 0                    | 0                              | 0                    |
| Finanzderivate                                                                                 | 25.692                    | 37.069               | 71.306                         | 15.408               |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                            | 168                       | 175                  | 588                            | 612                  |
| Zahlungsmittel                                                                                 | 9.245                     | 7.337                | 506                            | 6.423                |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                      | 40.500                    | 30.225               | 33.587                         | 26.864               |
| Forderungen aus Einkünften                                                                     | 8.836                     | 7.917                | 42.276                         | 42.726               |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                             | 92.694                    | 77.037               | 23.666                         | 13.842               |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                         | 751.589                   | 568.894              | 0                              | 0                    |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                       | 4.460                     | 3.139                | 14.827                         | 4.923                |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                        | 0                         | 0                    | 0                              | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                              | 23.126                    | 30.023               | 13.375                         | 7.032                |
| Sonstige Aktiva                                                                                | 0                         | 0                    | 89                             | 171                  |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                            | <b>2.233.539</b>          | <b>1.947.250</b>     | <b>3.189.119</b>               | <b>2.970.760</b>     |
| <b>Passiva:</b>                                                                                |                           |                      |                                |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:                  |                           |                      |                                |                      |
| Finanzderivate                                                                                 | (40.208)                  | (21.721)             | (41.582)                       | (28.274)             |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                        | (125.375)                 | (174.563)            | 0                              | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                       | (95.267)                  | (78.634)             | (71.205)                       | (31.889)             |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                                   | (994.751)                 | (533.167)            | 0                              | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                          | (648)                     | (798)                | (2.714)                        | (7.675)              |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                                  | 0                         | 0                    | 0                              | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                        | (368)                     | (433)                | (1.721)                        | (1.820)              |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                       | (5.824)                   | (1.025)              | (126.393)                      | (21.082)             |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                    | (1.877)                   | 0                    | 0                              | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                             | (6)                       | (6)                  | (46)                           | (57)                 |
| Überziehungskredit                                                                             | 0                         | 0                    | 0                              | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                          | 0                         | 0                    | (6.272)                        | (4.840)              |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                           | (22.462)                  | (25.048)             | (14.962)                       | (5.763)              |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                      | (2.348)                   | (15.569)             | (28.965)                       | (541)                |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                     | 0                         | 0                    | 0                              | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(1.289.134)</b>        | <b>(850.964)</b>     | <b>(293.860)</b>               | <b>(101.941)</b>     |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                        | <b>\$ 944.405</b>         | <b>\$ 1.096.286</b>  | <b>\$ 2.895.259</b>            | <b>\$ 2.868.819</b>  |

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

| Global High Yield<br>Bond ESG Fund |                      | Global Investment<br>Grade Credit Fund |                      | Global Investment Grade<br>Credit ESG Fund |                      | Global Low Duration Real<br>Return Fund |                      |
|------------------------------------|----------------------|----------------------------------------|----------------------|--------------------------------------------|----------------------|-----------------------------------------|----------------------|
| Zum<br>30. Jun. 2025               | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                   | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                    | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| \$ 10.203                          | \$ 9.056             | \$ 7.529.164                           | \$ 8.654.323         | \$ 2.536.048                               | \$ 2.121.224         | \$ 2.656.508                            | \$ 1.835.105         |
| 0                                  | 0                    | 812.756                                | 765.605              | 34.593                                     | 33.012               | 806                                     | 16.937               |
| 0                                  | 0                    | 481.308                                | 0                    | 33.000                                     | 0                    | 0                                       | 0                    |
| 91                                 | 52                   | 253.772                                | 115.755              | 90.128                                     | 25.772               | 70.460                                  | 27.442               |
| 0                                  | 0                    | 2.640                                  | 2.750                | 0                                          | 0                    | 0                                       | 0                    |
| 677                                | 1.111                | 51.290                                 | 12.193               | 5.627                                      | 6.688                | 5.221                                   | 8.706                |
| 207                                | 123                  | 256.352                                | 218.388              | 51.325                                     | 51.362               | 26.900                                  | 25.661               |
| 149                                | 153                  | 87.678                                 | 96.033               | 31.041                                     | 25.982               | 12.180                                  | 6.104                |
| 0                                  | 0                    | 7.198                                  | 4.901                | 17                                         | 26                   | 1.766                                   | 391                  |
| 0                                  | 0                    | 942.451                                | 1.767.584            | 0                                          | 0                    | 229.992                                 | 190.773              |
| 0                                  | 0                    | 16.646                                 | 7.479                | 2.748                                      | 2.384                | 1.773                                   | 8.796                |
| 0                                  | 0                    | 0                                      | 0                    | 0                                          | 0                    | 0                                       | 0                    |
| 63                                 | 99                   | 93.052                                 | 103.048              | 11.320                                     | 14.184               | 6.291                                   | 7.365                |
| 0                                  | 0                    | 0                                      | 0                    | 0                                          | 0                    | 0                                       | 0                    |
| 11.390                             | 10.594               | 10.534.307                             | 11.748.059           | 2.795.847                                  | 2.280.634            | 3.011.897                               | 2.127.280            |
| (117)                              | (24)                 | (137.115)                              | (147.614)            | (52.437)                                   | (41.664)             | (56.229)                                | (30.985)             |
| 0                                  | 0                    | 0                                      | 0                    | 0                                          | 0                    | 0                                       | 0                    |
| (237)                              | (37)                 | (75.561)                               | (21.186)             | (21.654)                                   | (1.622)              | (32.517)                                | (217)                |
| 0                                  | 0                    | (1.685.749)                            | (2.829.399)          | 0                                          | (20.365)             | (344.417)                               | (317.594)            |
| 0                                  | 0                    | (8.770)                                | (18.198)             | (1.623)                                    | (696)                | (18.068)                                | (249)                |
| 0                                  | 0                    | 0                                      | 0                    | 0                                          | 0                    | 0                                       | 0                    |
| (5)                                | (5)                  | (4.522)                                | (4.962)              | (1.135)                                    | (983)                | (761)                                   | (568)                |
| 0                                  | 0                    | (65.598)                               | (4.566)              | (114.507)                                  | (9.225)              | (861.162)                               | (548.515)            |
| 0                                  | 0                    | 0                                      | 0                    | 0                                          | (72.023)             | 0                                       | 0                    |
| 0                                  | 0                    | (242)                                  | (254)                | (277)                                      | (256)                | (1)                                     | (1)                  |
| 0                                  | 0                    | 0                                      | 0                    | 0                                          | 0                    | 0                                       | 0                    |
| 0                                  | 0                    | (6.581)                                | (10.741)             | (1.509)                                    | (1.387)              | (1.153)                                 | (276)                |
| (67)                               | (72)                 | (149.108)                              | (74.258)             | (20.000)                                   | (15.477)             | (10.498)                                | (8.695)              |
| 0                                  | 0                    | (74.363)                               | (17.931)             | (37.791)                                   | (1.319)              | (23.664)                                | (3.276)              |
| 0                                  | 0                    | 0                                      | 0                    | 0                                          | 0                    | 0                                       | 0                    |
| (426)                              | (138)                | (2.207.609)                            | (3.129.109)          | (250.933)                                  | (165.017)            | (1.348.470)                             | (910.376)            |
| \$ 10.964                          | \$ 10.456            | \$ 8.326.698                           | \$ 8.618.950         | \$ 2.544.914                               | \$ 2.115.617         | \$ 1.663.427                            | \$ 1.216.904         |

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                            | Global Real<br>Return Fund |                      | Income Fund          |                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
|                                                                                            | Zum<br>30. Jun. 2025       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                             |                            |                      |                      |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                      |                            |                      |                      |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                   | \$ 3.228.921               | \$ 3.368.570         | \$ 132.760.777       | \$ 127.144.187       |
| Investmentfonds                                                                            | 51.580                     | 23.521               | 3.068.448            | 2.813.433            |
| Pensionsgeschäfte                                                                          | 0                          | 0                    | 11.050.325           | 1.454.616            |
| Finanzderivate                                                                             | 76.376                     | 56.496               | 5.778.160            | 5.931.629            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                        | 0                          | 0                    | 16.665               | 17.358               |
| Zahlungsmittel                                                                             | 23.533                     | 9.390                | 115.648              | 117.086              |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                  | 41.107                     | 38.788               | 3.199.555            | 2.960.408            |
| Forderungen aus Einkünften                                                                 | 14.048                     | 10.835               | 840.495              | 784.376              |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                         | 1.560                      | 661.913              | 723.544              | 194.174              |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                     | 365.402                    | 459.204              | 56.893.012           | 54.438.831           |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                   | 1.254                      | 1.645                | 190.592              | 187.117              |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                    | 0                          | 0                    | 0                    | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                          | 12.428                     | 10.486               | 2.616.153            | 1.837.129            |
| Sonstige Aktiva                                                                            | 0                          | 0                    | 0                    | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                        | <b>3.816.209</b>           | <b>4.640.848</b>     | <b>217.253.374</b>   | <b>197.880.344</b>   |
| <b>Passiva:</b>                                                                            |                            |                      |                      |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:              |                            |                      |                      |                      |
| Finanzderivate                                                                             | (72.926)                   | (52.046)             | (3.114.010)          | (3.672.159)          |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                    | 0                          | 0                    | (364.310)            | (586.515)            |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                   | (33.742)                   | (395)                | (509.866)            | (511.718)            |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                               | (599.132)                  | (728.210)            | (107.781.611)        | (99.046.759)         |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                      | (1.385)                    | (3.148)              | (111.532)            | (69.296)             |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                              | 0                          | 0                    | 0                    | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                    | (974)                      | (1.091)              | (74.092)             | (70.705)             |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                   | (1.164.324)                | (1.703.656)          | (218.676)            | (50.595)             |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                | 0                          | (37.412)             | 0                    | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                         | (22)                       | (25)                 | (6.561)              | (6.299)              |
| Überziehungskredit                                                                         | 0                          | 0                    | 0                    | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                      | (422)                      | (233)                | (6.791)              | (10.392)             |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                       | (13.865)                   | (10.912)             | (4.915.051)          | (4.372.397)          |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                  | (25.448)                   | (13.573)             | (1.127.654)          | (196.649)            |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                 | 0                          | 0                    | 0                    | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(1.912.240)</b>         | <b>(2.550.701)</b>   | <b>(118.230.154)</b> | <b>(108.593.484)</b> |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                    | <b>\$ 1.903.969</b>        | <b>\$ 2.090.147</b>  | <b>\$ 99.023.220</b> | <b>\$ 89.286.860</b> |

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

| Income Fund II       |                      | Inflation Multi-Asset Fund |                      | Low Average Duration Fund |                      | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund |                      |
|----------------------|----------------------|----------------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|--------------------------------------------------|----------------------|
| Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025      | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                             | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| \$ 413.193           | \$ 346.880           | \$ 233.438                 | \$ 245.168           | \$ 832.337                | \$ 841.885           | \$ 1.044.710                                     | \$ 1.100.117         |
| 20.334               | 57                   | 18.793                     | 15.756               | 80.082                    | 67.358               | 21.826                                           | 52.751               |
| 0                    | 0                    | 0                          | 0                    | 56.200                    | 5.400                | 213.500                                          | 0                    |
| 5.742                | 3.324                | 9.269                      | 7.786                | 7.975                     | 5.793                | 41.537                                           | 14.365               |
| 30                   | 31                   | 0                          | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                                | 0                    |
| 2.330                | 986                  | 1.678                      | 6.696                | 2.692                     | 2.154                | 2.615                                            | 1.726                |
| 8.896                | 7.814                | 5.324                      | 5.843                | 11.713                    | 10.149               | 25.470                                           | 22.989               |
| 2.709                | 2.615                | 513                        | 485                  | 4.431                     | 4.898                | 12.631                                           | 11.603               |
| 208                  | 64                   | 921                        | 1.315                | 20                        | 91.701               | 1.821                                            | 0                    |
| 53.713               | 64.689               | 73.033                     | 54.749               | 366.582                   | 224.409              | 26.228                                           | 106.138              |
| 819                  | 1.339                | 104                        | 170                  | 186                       | 152                  | 3.091                                            | 1.513                |
| 0                    | 0                    | 0                          | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                                | 0                    |
| 5.297                | 3.852                | 3.925                      | 2.699                | 6.084                     | 4.900                | 4.243                                            | 6.351                |
| 0                    | 0                    | 0                          | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                                | 0                    |
| 513.271              | 431.651              | 346.998                    | 340.667              | 1.368.302                 | 1.258.799            | 1.397.672                                        | 1.317.553            |
| (5.915)              | (7.453)              | (6.340)                    | (5.958)              | (7.089)                   | (3.792)              | (22.456)                                         | (15.853)             |
| (574)                | (564)                | (7.638)                    | 0                    | (48.065)                  | (48.230)             | 0                                                | 0                    |
| (1.654)              | (166)                | 0                          | (1.248)              | (5.204)                   | (2.071)              | (10.431)                                         | (1.870)              |
| (161.872)            | (139.607)            | (108.357)                  | (105.767)            | (478.739)                 | (328.585)            | (77.997)                                         | (183.837)            |
| (162)                | (2.902)              | (144)                      | (180)                | (354)                     | (800)                | (364)                                            | (601)                |
| 0                    | 0                    | 0                          | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                                | 0                    |
| (382)                | (347)                | (168)                      | (171)                | (348)                     | (291)                | (520)                                            | (449)                |
| (3.304)              | (3.080)              | (2.275)                    | (9.147)              | 0                         | (190.921)            | (388)                                            | (18.793)             |
| 0                    | 0                    | (25.869)                   | (34.095)             | 0                         | 0                    | 0                                                | 0                    |
| 0                    | 0                    | (1)                        | (2)                  | (3)                       | (3)                  | 0                                                | 0                    |
| 0                    | 0                    | 0                          | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                                | 0                    |
| 0                    | (351)                | 0                          | 0                    | (137)                     | (59)                 | (13)                                             | (6)                  |
| (6.478)              | (2.818)              | (7.258)                    | (4.446)              | (6.181)                   | (4.674)              | (11.226)                                         | (8.622)              |
| (1.060)              | (700)                | (454)                      | (752)                | (3.132)                   | (2.990)              | (15.007)                                         | (2.556)              |
| 0                    | 0                    | 0                          | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                                | 0                    |
| (181.401)            | (157.988)            | (158.504)                  | (161.766)            | (549.252)                 | (582.416)            | (138.402)                                        | (232.587)            |
| \$ 331.870           | \$ 273.663           | \$ 188.494                 | \$ 178.901           | \$ 819.050                | \$ 676.383           | \$ 1.259.270                                     | \$ 1.084.966         |

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                | Low Duration<br>Income Fund |                      | Low Duration<br>Opportunities Fund |                      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|----------------------|------------------------------------|----------------------|
|                                                                                                | Zum<br>30. Jun. 2025        | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025               | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                                 |                             |                      |                                    |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                          |                             |                      |                                    |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                       | \$ 3.863.260                | \$ 4.283.507         | \$ 1.094.925                       | \$ 1.198.397         |
| Investmentfonds                                                                                | 296.382                     | 293.517              | 79.221                             | 84.184               |
| Pensionsgeschäfte                                                                              | 511.222                     | 51.766               | 104.600                            | 137.100              |
| Finanzderivate                                                                                 | 166.004                     | 129.368              | 41.838                             | 32.957               |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                            | 228                         | 237                  | 948                                | 987                  |
| Zahlungsmittel                                                                                 | 83.798                      | 8.991                | 4.632                              | 6.532                |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                      | 78.710                      | 77.986               | 21.991                             | 28.173               |
| Forderungen aus Einkünften                                                                     | 19.737                      | 22.955               | 5.561                              | 5.709                |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                             | 156.632                     | 1.589                | 717                                | 2.739                |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                         | 1.931.432                   | 1.665.887            | 456.009                            | 671.237              |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                       | 28.771                      | 14.358               | 29                                 | 51                   |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                        | 0                           | 0                    | 0                                  | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                              | 43.608                      | 30.684               | 16.496                             | 15.021               |
| Sonstige Aktiva                                                                                | 0                           | 0                    | 33                                 | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                            | <b>7.179.784</b>            | <b>6.580.845</b>     | <b>1.827.000</b>                   | <b>2.183.087</b>     |
| <b>Passiva:</b>                                                                                |                             |                      |                                    |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:                  |                             |                      |                                    |                      |
| Finanzderivate                                                                                 | (88.120)                    | (83.158)             | (22.231)                           | (18.062)             |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                        | 0                           | (38.024)             | (37.138)                           | (36.516)             |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                       | (211.124)                   | (2.897)              | (18.791)                           | (68.889)             |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                                   | (3.641.908)                 | (3.438.246)          | (893.795)                          | (1.176.821)          |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                          | (2.402)                     | (1.110)              | (15)                               | 0                    |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                                  | 0                           | 0                    | 0                                  | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                        | (1.808)                     | (1.641)              | (310)                              | (342)                |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                       | (5.478)                     | 0                    | (808)                              | 0                    |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                    | 0                           | 0                    | 0                                  | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                             | (58)                        | (31)                 | 0                                  | (1)                  |
| Überziehungskredit                                                                             | 0                           | 0                    | 0                                  | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                          | (9)                         | (483)                | (6.015)                            | (7.288)              |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                           | (86.109)                    | (85.487)             | (28.756)                           | (28.035)             |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                      | (50.400)                    | (4.522)              | (14.078)                           | (3.198)              |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                     | 0                           | 0                    | 0                                  | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(4.087.416)</b>          | <b>(3.655.599)</b>   | <b>(1.021.937)</b>                 | <b>(1.339.152)</b>   |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                        | <b>\$ 3.092.368</b>         | <b>\$ 2.925.246</b>  | <b>\$ 805.063</b>                  | <b>\$ 843.935</b>    |

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

| Low Duration Opportunities ESG Fund |                   | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund |                   | Mortgage Opportunities Fund |                   | StocksPLUS™ Fund  |                   |
|-------------------------------------|-------------------|----------------------------------------|-------------------|-----------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Zum 30. Jun. 2025                   | Zum 31. Dez. 2024 | Zum 30. Jun. 2025                      | Zum 31. Dez. 2024 | Zum 30. Jun. 2025           | Zum 31. Dez. 2024 | Zum 30. Jun. 2025 | Zum 31. Dez. 2024 |
| \$ 7.141                            | \$ 6.746          | \$ 155.970                             | \$ 144.584        | \$ 4.317.745                | \$ 3.173.027      | \$ 4.036.214      | \$ 4.234.647      |
| 0                                   | 0                 | 16.886                                 | 15.373            | 5                           | 4                 | 479.674           | 436.651           |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | 29.200                      | 5.600             | 1.531.400         | 453.100           |
| 116                                 | 106               | 5.637                                  | 315               | 67.416                      | 30.998            | 281.341           | 59.377            |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | 0                           | 0                 | 0                 | 0                 |
| 746                                 | 91                | 1.399                                  | 641               | 7.388                       | 4.940             | 26.009            | 5.275             |
| 115                                 | 115               | 0                                      | 3.830             | 20.924                      | 26.193            | 184.896           | 241.740           |
| 60                                  | 47                | 274                                    | 209               | 13.293                      | 9.307             | 21.564            | 30.394            |
| 0                                   | 0                 | 4                                      | 29                | 3.252                       | 136               | 927               | 645               |
| 50                                  | 886               | 0                                      | 0                 | 3.939.944                   | 2.236.019         | 1.205.985         | 474.055           |
| 0                                   | 0                 | 473                                    | 1.044             | 112                         | 468               | 1.494             | 10.945            |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | 0                           | 0                 | 0                 | 0                 |
| 61                                  | 22                | 0                                      | 0                 | 11.117                      | 3.224             | 16.871            | 93.222            |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | 0                           | 0                 | 0                 | 0                 |
| 8.289                               | 8.013             | 180.643                                | 166.025           | 8.410.396                   | 5.489.916         | 7.786.375         | 6.040.051         |
| (150)                               | (55)              | (765)                                  | (2.163)           | (37.491)                    | (30.223)          | (63.733)          | (102.218)         |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | (442.353)                   | (299.909)         | 0                 | (147.276)         |
| (17)                                | (523)             | (40)                                   | (6.429)           | (133.959)                   | (13.422)          | (39.700)          | (291.502)         |
| (1.015)                             | (1.859)           | 0                                      | 0                 | (5.090.578)                 | (3.295.542)       | (2.103.652)       | (394.403)         |
| 0                                   | 0                 | (116)                                  | (199)             | (264)                       | (3.404)           | (9.092)           | (17.233)          |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | 0                           | 0                 | 0                 | 0                 |
| (2)                                 | (2)               | (187)                                  | (163)             | (1.352)                     | (1.115)           | (2.695)           | (2.755)           |
| (770)                               | 0                 | 0                                      | 0                 | (392.354)                   | (40.673)          | 0                 | 0                 |
| (577)                               | (102)             | 0                                      | 0                 | 0                           | 0                 | 0                 | 0                 |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | (9)                         | (9)               | (54)              | (50)              |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | 0                           | 0                 | 0                 | 0                 |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | (95)                        | (100)             | 0                 | 0                 |
| (54)                                | (35)              | 0                                      | 0                 | (4.399)                     | (7.436)           | (43.907)          | (34.621)          |
| 0                                   | 0                 | (4.518)                                | 0                 | (32.991)                    | (6.767)           | (199.698)         | (27.638)          |
| 0                                   | 0                 | 0                                      | 0                 | 0                           | 0                 | 0                 | 0                 |
| (2.585)                             | (2.576)           | (5.626)                                | (8.954)           | (6.135.845)                 | (3.698.600)       | (2.462.531)       | (1.017.696)       |
| \$ 5.704                            | \$ 5.437          | \$ 175.017                             | \$ 157.071        | \$ 2.274.551                | \$ 1.791.316      | \$ 5.323.844      | \$ 5.022.355      |

## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                            | PIMCO StocksPLUS™<br>AR Fund |                      | Strategic<br>Income Fund |                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|                                                                                            | Zum<br>30. Jun. 2025         | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025     | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                             |                              |                      |                          |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                      |                              |                      |                          |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                   | \$ 9.887                     | \$ 8.137             | \$ 3.336.621             | \$ 3.148.257         |
| Investmentfonds                                                                            | 991                          | 981                  | 134.709                  | 4.484                |
| Pensionsgeschäfte                                                                          | 2.600                        | 2.400                | 0                        | 0                    |
| Finanzderivate                                                                             | 694                          | 187                  | 131.808                  | 70.009               |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                        | 0                            | 0                    | 480                      | 75                   |
| Zahlungsmittel                                                                             | 203                          | 137                  | 8.139                    | 9.034                |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                  | 580                          | 457                  | 37.965                   | 55.490               |
| Forderungen aus Einkünften                                                                 | 44                           | 45                   | 14.242                   | 13.956               |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                         | 206                          | 6                    | 816                      | 1.166                |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                     | 6.208                        | 3.391                | 1.181.899                | 645.171              |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                   | 0                            | 0                    | 11.551                   | 2.083                |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                    | 0                            | 0                    | 1.548                    | 2.445                |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                          | 467                          | 501                  | 29.028                   | 22.683               |
| Sonstige Aktiva                                                                            | 0                            | 0                    | 0                        | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                        | <b>21.880</b>                | <b>16.242</b>        | <b>4.888.806</b>         | <b>3.974.853</b>     |
| <b>Passiva:</b>                                                                            |                              |                      |                          |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:              |                              |                      |                          |                      |
| Finanzderivate                                                                             | (284)                        | (169)                | (72.657)                 | (76.081)             |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                    | (540)                        | (675)                | (63.436)                 | (8.253)              |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                   | 0                            | (217)                | (1.837)                  | (9.228)              |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                               | (9.999)                      | (4.604)              | (2.223.556)              | (1.241.787)          |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                      | 0                            | 0                    | (4.291)                  | (6.895)              |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                              | 0                            | 0                    | 0                        | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                    | (6)                          | (6)                  | (2.388)                  | (2.397)              |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                   | 0                            | 0                    | (4.409)                  | (137.048)            |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                | 0                            | 0                    | 0                        | (134.166)            |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                         | 0                            | 0                    | (28)                     | (27)                 |
| Überziehungskredit                                                                         | 0                            | 0                    | 0                        | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                      | 0                            | 0                    | (14)                     | (16)                 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                       | (509)                        | (453)                | (40.895)                 | (34.238)             |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                  | (80)                         | 0                    | (33.314)                 | (6.351)              |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                 | 0                            | 0                    | 0                        | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(11.418)</b>              | <b>(6.124)</b>       | <b>(2.446.825)</b>       | <b>(1.656.487)</b>   |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                    | <b>\$ 10.462</b>             | <b>\$ 10.118</b>     | <b>\$ 2.441.981</b>      | <b>\$ 2.318.366</b>  |

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

| Total Return<br>Bond Fund |                      | PIMCO TRENDS Managed<br>Futures Strategy Fund |                      | UK Corporate<br>Bond Fund |                      | UK Long Term Corporate<br>Bond Fund |                      |
|---------------------------|----------------------|-----------------------------------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|-------------------------------------|----------------------|
| Zum<br>30. Jun. 2025      | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                          | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025      | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| \$ 5.933.462              | \$ 5.505.057         | \$ 104.958                                    | \$ 175.392           | £ 216.943                 | £ 204.682            | £ 39.984                            | £ 123.949            |
| 122.021                   | 172.630              | 9.991                                         | 20.205               | 4.152                     | 15.176               | 0                                   | 0                    |
| 0                         | 0                    | 0                                             | 0                    | 0                         | 2.100                | 0                                   | 5.200                |
| 103.553                   | 76.737               | 13.549                                        | 50.151               | 2.037                     | 1.640                | 823                                 | 2.567                |
| 0                         | 0                    | 0                                             | 0                    | 18                        | 20                   | 140                                 | 160                  |
| 12.188                    | 8.856                | 2.585                                         | 4.878                | 1.092                     | 1.301                | 469                                 | 998                  |
| 105.926                   | 105.982              | 9.234                                         | 18.953               | 5.193                     | 3.648                | 1.200                               | 3.843                |
| 40.557                    | 37.829               | 355                                           | 1.018                | 2.799                     | 3.057                | 540                                 | 1.908                |
| 1.786                     | 147.707              | 127                                           | 247                  | 864                       | 314                  | 0                                   | 59                   |
| 2.199.790                 | 2.333.445            | 8.162                                         | 108.433              | 21.069                    | 27.775               | 32.097                              | 27.733               |
| 1.727                     | 5.488                | 6                                             | 23                   | 2.156                     | 20                   | 0                                   | 0                    |
| 0                         | 0                    | 0                                             | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| 31.996                    | 31.615               | 8.344                                         | 22.274               | 3.698                     | 3.968                | 1.327                               | 2.486                |
| 0                         | 0                    | 0                                             | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| 8.553.006                 | 8.425.346            | 157.311                                       | 401.574              | 260.021                   | 263.701              | 76.580                              | 168.903              |
| (60.465)                  | (41.036)             | (13.756)                                      | (56.548)             | (2.184)                   | (1.787)              | (827)                               | (1.617)              |
| (1.188)                   | (1.168)              | (806)                                         | (18.231)             | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| (1.542)                   | (7.568)              | (669)                                         | (928)                | (404)                     | (1.425)              | (370)                               | (1.177)              |
| (4.112.145)               | (3.920.150)          | (31.314)                                      | (90.384)             | (39.326)                  | (41.602)             | (40.044)                            | (48.280)             |
| (1.977)                   | (2.800)              | 0                                             | (10)                 | 0                         | (117)                | 0                                   | 0                    |
| 0                         | 0                    | 0                                             | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| (2.450)                   | (2.501)              | (97)                                          | (233)                | (47)                      | (50)                 | (22)                                | (45)                 |
| (133.120)                 | (363.257)            | 0                                             | 0                    | (1.364)                   | (237)                | 0                                   | 0                    |
| 0                         | (6.691)              | 0                                             | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| (149)                     | (183)                | (12)                                          | 0                    | 0                         | 0                    | (8)                                 | 0                    |
| 0                         | 0                    | 0                                             | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| (93)                      | (199)                | 0                                             | (358)                | (2.042)                   | (2.020)              | (14)                                | (385)                |
| (66.530)                  | (62.004)             | (6.515)                                       | (11.877)             | (3.740)                   | (3.330)              | (1.447)                             | (2.959)              |
| (48.130)                  | (14.626)             | (1.082)                                       | (3.520)              | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| 0                         | 0                    | 0                                             | 0                    | 0                         | 0                    | 0                                   | 0                    |
| (4.427.789)               | (4.422.183)          | (54.251)                                      | (182.089)            | (49.107)                  | (50.568)             | (42.732)                            | (54.463)             |
| \$ 4.125.217              | \$ 4.003.163         | \$ 103.060                                    | \$ 219.485           | £ 210.914                 | £ 213.133            | £ 33.848                            | £ 114.440            |



## Finanzstatus (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                | US High Yield<br>Bond Fund |                      | US Investment Grade<br>Corporate Bond Fund |                      |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------|--------------------------------------------|----------------------|
|                                                                                                | Zum<br>30. Jun. 2025       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025                       | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| <b>Aktiva:</b>                                                                                 |                            |                      |                                            |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:                          |                            |                      |                                            |                      |
| Übertragbare Wertpapiere                                                                       | \$ 1.519.980               | \$ 1.593.143         | \$ 440.924                                 | \$ 559.923           |
| Investmentfonds                                                                                | 120.173                    | 93.344               | 10.357                                     | 109                  |
| Pensionsgeschäfte                                                                              | 83.100                     | 0                    | 16.600                                     | 0                    |
| Finanzderivate                                                                                 | 17.999                     | 3.162                | 15.116                                     | 4.434                |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                            | 0                          | 0                    | 0                                          | 0                    |
| Zahlungsmittel                                                                                 | 639                        | 1.686                | 2.494                                      | 227                  |
| Einlagen bei Kontrahenten                                                                      | 19.687                     | 15.471               | 13.327                                     | 12.993               |
| Forderungen aus Einkünften                                                                     | 24.673                     | 26.620               | 5.543                                      | 6.504                |
| Forderungen aus verkauften Anlagen                                                             | 2.023                      | 5.389                | 3                                          | 957                  |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen                                                         | 0                          | 0                    | 7.060                                      | 59.755               |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen                                                       | 594                        | 8.689                | 49                                         | 96                   |
| Forderungen gegenüber verbundenen Fonds                                                        | 0                          | 0                    | 0                                          | 0                    |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen                                                              | 8.879                      | 8.317                | 2.921                                      | 5.502                |
| Sonstige Aktiva                                                                                | 0                          | 103                  | 0                                          | 0                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                                            | <b>1.797.747</b>           | <b>1.755.924</b>     | <b>514.394</b>                             | <b>650.500</b>       |
| <b>Passiva:</b>                                                                                |                            |                      |                                            |                      |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:                  |                            |                      |                                            |                      |
| Finanzderivate                                                                                 | (4.297)                    | (7.823)              | (3.934)                                    | (6.100)              |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere                                                        | 0                          | 0                    | 0                                          | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen                                                       | (17.892)                   | (23.105)             | (1.801)                                    | (115)                |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen                                                   | 0                          | 0                    | (17.230)                                   | (123.926)            |
| Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen                                                          | (3.543)                    | (1.700)              | (1.215)                                    | (243)                |
| Verbindlichkeiten gegenüber verbundenen Fonds                                                  | 0                          | 0                    | 0                                          | 0                    |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr                                                        | (928)                      | (996)                | (241)                                      | (266)                |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften                                                       | (106.651)                  | (2.086)              | (1.920)                                    | (19.322)             |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte                                                    | 0                          | 0                    | 0                                          | (1.025)              |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen                                                             | (19)                       | (82)                 | 0                                          | 0                    |
| Überziehungskredit                                                                             | 0                          | 0                    | 0                                          | 0                    |
| Zu zahlende Dividende                                                                          | (66)                       | (68)                 | (332)                                      | (327)                |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen                                                           | (9.023)                    | (5.841)              | (9.295)                                    | (5.284)              |
| Einlagen von Kontrahenten                                                                      | (8.842)                    | 0                    | (3.419)                                    | 0                    |
| Sonstige Verbindlichkeiten                                                                     | 0                          | 0                    | 0                                          | 0                    |
| <b>Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber</b> | <b>(151.261)</b>           | <b>(41.701)</b>      | <b>(39.387)</b>                            | <b>(156.608)</b>     |
| <b>Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber</b>                        | <b>\$ 1.646.486</b>        | <b>\$ 1.714.223</b>  | <b>\$ 475.007</b>                          | <b>\$ 493.892</b>    |

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

\* Die Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

| US Short-Term Fund   |                      | Summe der Gesellschaft* |                      |
|----------------------|----------------------|-------------------------|----------------------|
| Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>30. Jun. 2025    | Zum<br>31. Dez. 2024 |
| \$ 2.340.898         | \$ 2.015.074         | \$ 260.340.080          | \$ 240.763.884       |
| 248.607              | 224.925              | 8.673.467               | 7.683.494            |
| 18.300               | 133.083              | 16.072.897              | 4.419.803            |
| 22.114               | 9.609                | 9.335.010               | 8.068.300            |
| 0                    | 0                    | 57.601                  | 59.132               |
| 1.791                | 4.269                | 652.554                 | 567.262              |
| 33.439               | 16.452               | 5.894.871               | 5.509.522            |
| 13.798               | 10.964               | 2.010.108               | 1.839.562            |
| 430                  | 428                  | 3.248.678               | 3.847.474            |
| 46.178               | 14.830               | 92.724.604              | 88.538.633           |
| 9.461                | 31.363               | 419.831                 | 438.338              |
| 0                    | 0                    | 2.978                   | 1.488                |
| 10.513               | 2.799                | 3.920.473               | 3.215.624            |
| 0                    | 0                    | 386                     | 472                  |
| 2.745.529            | 2.463.796            | 403.353.538             | 364.952.988          |
| (22.203)             | (9.877)              | (5.611.961)             | (5.886.289)          |
| 0                    | 0                    | (2.940.140)             | (6.250.452)          |
| (59.579)             | (57.500)             | (4.373.848)             | (4.033.052)          |
| (92.113)             | (60.632)             | (165.596.293)           | (145.444.299)        |
| (947)                | (382)                | (230.043)               | (228.720)            |
| 0                    | 0                    | 0                       | 0                    |
| (813)                | (741)                | (142.908)               | (135.461)            |
| 0                    | 0                    | (5.445.240)             | (5.832.769)          |
| 0                    | 0                    | (53.532)                | (399.743)            |
| (2)                  | (3)                  | (10.778)                | (9.686)              |
| 0                    | 0                    | 0                       | (7.981)              |
| (11)                 | (66)                 | (42.184)                | (51.559)             |
| (5.417)              | (973)                | (6.540.815)             | (5.656.912)          |
| (4.208)              | (3.358)              | (2.383.116)             | (602.955)            |
| 0                    | 0                    | (47)                    | 0                    |
| (185.293)            | (133.532)            | (193.370.905)           | (174.539.878)        |
| \$ 2.560.236         | \$ 2.330.264         | \$ 209.982.633          | \$ 190.413.110       |

## Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | PIMCO Asia High<br>Yield Bond Fund                      |                                                         | Asia Strategic<br>Interest Bond Fund                    |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 67.901                                               | \$ 99.957                                               | \$ 7.621                                                | \$ 5.940                                                |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | (38.955)                                                | (133.689)                                               | (1.573)                                                 | (4.440)                                                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | 20.413                                                  | 940                                                     | 605                                                     | (273)                                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | (25)                                                    | (3.198)                                                 | (9)                                                     | (318)                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 47.503                                                  | 252.688                                                 | 4.137                                                   | 7.431                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 16.108                                                  | (10.173)                                                | 2.389                                                   | (681)                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | 163                                                     | 48                                                      | 23                                                      | 2                                                       |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 113.108                                                 | 206.573                                                 | 13.193                                                  | 7.661                                                   |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (5.966)                                                 | (8.154)                                                 | (766)                                                   | (620)                                                   |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | (63)                                                    | (101)                                                   | 0                                                       | 0                                                       |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | (88)                                                    | (63)                                                    | 0                                                       | 0                                                       |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | (1)                                                     | (1)                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (6.118)                                                 | (8.319)                                                 | (766)                                                   | (620)                                                   |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 8                                                       | 8                                                       | 2                                                       | 2                                                       |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (6.110)                                                 | (8.311)                                                 | (764)                                                   | (618)                                                   |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | <b>106.998</b>                                          | <b>198.262</b>                                          | <b>12.429</b>                                           | <b>7.043</b>                                            |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (604)                                                   | (499)                                                   | (7)                                                     | (13)                                                    |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | (115)                                                   | (204)                                                   | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | (15.035)                                                | (13.008)                                                | (3.722)                                                 | (2.744)                                                 |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | (9)                                                     | 79                                                      | (147)                                                   | 66                                                      |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (15.763)                                                | (13.632)                                                | (3.876)                                                 | (2.691)                                                 |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | <b>91.235</b>                                           | <b>184.630</b>                                          | <b>8.553</b>                                            | <b>4.352</b>                                            |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | 37                                                      | (38)                                                    | 1                                                       | (3)                                                     |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | <b>91.272</b>                                           | <b>184.592</b>                                          | <b>8.554</b>                                            | <b>4.349</b>                                            |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | <b>\$ 91.272</b>                                        | <b>\$ 184.592</b>                                       | <b>\$ 8.554</b>                                         | <b>\$ 4.349</b>                                         |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| PIMCO Balanced<br>Income and Growth Fund                |                                                         | PIMCO Capital<br>Securities Fund                        |                                                         | PIMCO Climate<br>Bond Fund                              |                                                         | Commodity Real<br>Return Fund                           |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 40.599                                               | \$ 15.092                                               | \$ 149.430                                              | \$ 154.480                                              | \$ 5.717                                                | \$ 4.748                                                | \$ 17.252                                               | \$ 14.189                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 32.480                                                  | 14.691                                                  | 42.702                                                  | (62.282)                                                | (2.161)                                                 | (2.826)                                                 | (12.714)                                                | (19.469)                                                |
| 38.879                                                  | (3.151)                                                 | (16.002)                                                | (20.268)                                                | 4.080                                                   | 351                                                     | 35.531                                                  | 23.914                                                  |
| 104                                                     | (614)                                                   | (864)                                                   | (1.283)                                                 | 21                                                      | 129                                                     | (151)                                                   | (38)                                                    |
| 142.436                                                 | 25.783                                                  | 326.455                                                 | 58.889                                                  | 31.356                                                  | (5.746)                                                 | 65.486                                                  | 4.552                                                   |
| 37.794                                                  | (3.753)                                                 | 8.662                                                   | 10.487                                                  | 1.795                                                   | (661)                                                   | (27.597)                                                | 10.366                                                  |
| 82                                                      | 171                                                     | (1.915)                                                 | (173)                                                   | 255                                                     | (51)                                                    | (93)                                                    | (54)                                                    |
| 292.374                                                 | 48.219                                                  | 508.468                                                 | 139.850                                                 | 41.063                                                  | (4.056)                                                 | 77.714                                                  | 33.460                                                  |
| (13.876)                                                | (5.011)                                                 | (24.977)                                                | (23.880)                                                | (800)                                                   | (778)                                                   | (3.691)                                                 | (4.118)                                                 |
| (23)                                                    | (20)                                                    | (428)                                                   | (496)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | (33)                                                    | (36)                                                    |
| (201)                                                   | 0                                                       | (592)                                                   | (573)                                                   | (3)                                                     | (3)                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| (33)                                                    | 0                                                       | (147)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (1)                                                     | 0                                                       | (2)                                                     | (149)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (14.134)                                                | (5.031)                                                 | (26.146)                                                | (25.098)                                                | (803)                                                   | (781)                                                   | (3.724)                                                 | (4.154)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (14.134)                                                | (5.031)                                                 | (26.146)                                                | (25.098)                                                | (803)                                                   | (781)                                                   | (3.724)                                                 | (4.154)                                                 |
| 278.240                                                 | 43.188                                                  | 482.322                                                 | 114.752                                                 | 40.260                                                  | (4.837)                                                 | 73.990                                                  | 29.306                                                  |
| (313)                                                   | (179)                                                   | (7.327)                                                 | (7.480)                                                 | (12)                                                    | (10)                                                    | (5.718)                                                 | (8.222)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (42.589)                                                | (3.690)                                                 | (44.493)                                                | (40.678)                                                | (2.120)                                                 | (2.053)                                                 | (56)                                                    | (639)                                                   |
| (2.047)                                                 | 380                                                     | (225)                                                   | 3.123                                                   | 56                                                      | 0                                                       | (28)                                                    | 429                                                     |
| (44.949)                                                | (3.489)                                                 | (52.045)                                                | (45.035)                                                | (2.076)                                                 | (2.063)                                                 | (5.802)                                                 | (8.432)                                                 |
| 233.291                                                 | 39.699                                                  | 430.277                                                 | 69.717                                                  | 38.184                                                  | (6.900)                                                 | 68.188                                                  | 20.874                                                  |
| (2.976)                                                 | (952)                                                   | (403)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 6                                                       | 0                                                       | 1                                                       |
| 0                                                       | 29                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 230.315                                                 | 38.776                                                  | 429.874                                                 | 69.717                                                  | 38.184                                                  | (6.894)                                                 | 68.188                                                  | 20.875                                                  |
| \$ 230.315                                              | \$ 38.776                                               | \$ 429.874                                              | \$ 69.717                                               | \$ 38.184                                               | \$ (6.894)                                              | \$ 68.188                                               | \$ 20.875                                               |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | PIMCO Credit<br>Opportunities Bond Fund                 |                                                         | Diversified<br>Income Fund                              |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 5.468                                                | \$ 3.565                                                | \$ 262.164                                              | \$ 212.212                                              |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | 692                                                     | (705)                                                   | 22.274                                                  | (121.826)                                               |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | 2.837                                                   | (755)                                                   | 109.341                                                 | 23.201                                                  |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | (124)                                                   | (12)                                                    | (4.188)                                                 | 8.860                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 5.589                                                   | (901)                                                   | 406.219                                                 | 28.219                                                  |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 3.230                                                   | (3)                                                     | 97.008                                                  | (98.959)                                                |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | (9)                                                     | 0                                                       | 1.386                                                   | (337)                                                   |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 17.683                                                  | 1.189                                                   | 894.204                                                 | 51.370                                                  |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (673)                                                   | (448)                                                   | (52.992)                                                | (40.099)                                                |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | (159)                                                   | (244)                                                   |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | (432)                                                   | (340)                                                   |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (8.953)                                                 | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | 0                                                       | 0                                                       | (4)                                                     | (771)                                                   |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (673)                                                   | (448)                                                   | (62.540)                                                | (41.454)                                                |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 1                                                       | 1                                                       | 469                                                     | 470                                                     |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (672)                                                   | (447)                                                   | (62.071)                                                | (40.984)                                                |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | 17.011                                                  | 742                                                     | 832.133                                                 | 10.386                                                  |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (40)                                                    | (54)                                                    | (3.070)                                                 | (2.215)                                                 |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (147.005)                                               | (63.969)                                                |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | (3.644)                                                 | (6.983)                                                 |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (40)                                                    | (54)                                                    | (153.719)                                               | (73.167)                                                |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | 16.971                                                  | 688                                                     | 678.414                                                 | (62.781)                                                |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | (9)                                                     | 2                                                       | (23)                                                    | (41)                                                    |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | (299)                                                   | 0                                                       |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | 16.962                                                  | 690                                                     | 678.092                                                 | (62.822)                                                |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | \$ 16.962                                               | \$ 690                                                  | \$ 678.092                                              | \$ (62.822)                                             |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

<sup>(1)</sup> Der Dynamic Multi-Asset Fund wurde am 22. November 2024 geschlossen.

| Diversified Income Duration<br>Hedged Fund              |                                                         | Diversified Income<br>ESG Fund                          |                                                         | Dynamic<br>Bond Fund                                    |                                                         | Dynamic<br>Multi-Asset Fund <sup>(1)</sup>              |  |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|--|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |  |
| \$ 8.906                                                | \$ 12.445                                               | \$ 1.325                                                | \$ 1.446                                                | \$ 92.207                                               | \$ 93.510                                               | € 45.340                                                |  |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 11                                                      | 0                                                       |  |
| (565)                                                   | (7.769)                                                 | 129                                                     | 55                                                      | 34.697                                                  | (32.303)                                                | (62.329)                                                |  |
| 17.060                                                  | 17.179                                                  | 1.934                                                   | (696)                                                   | 148.815                                                 | 49.686                                                  | 85.055                                                  |  |
| (71)                                                    | 26                                                      | (11)                                                    | 24                                                      | 505                                                     | 1.840                                                   | 1.562                                                   |  |
| 13.618                                                  | 4.475                                                   | 2.182                                                   | (1.043)                                                 | 201.906                                                 | (58.223)                                                | 99.680                                                  |  |
| (4.973)                                                 | (9.626)                                                 | 1.498                                                   | (542)                                                   | 15.953                                                  | 20.638                                                  | (57.084)                                                |  |
| 83                                                      | (45)                                                    | 17                                                      | (6)                                                     | 622                                                     | (1.056)                                                 | (31.278)                                                |  |
| 34.058                                                  | 16.685                                                  | 7.074                                                   | (762)                                                   | 494.705                                                 | 74.103                                                  | 80.946                                                  |  |
| (1.719)                                                 | (1.903)                                                 | (180)                                                   | (195)                                                   | (18.200)                                                | (16.261)                                                | (17.394)                                                |  |
| (10)                                                    | (9)                                                     | 0                                                       | 0                                                       | (73)                                                    | (78)                                                    | (15)                                                    |  |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (45)                                                    | (50)                                                    | 0                                                       |  |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |  |
| 0                                                       | 0                                                       | (1)                                                     | (1)                                                     | (2)                                                     | (2)                                                     | (128)                                                   |  |
| (1.729)                                                 | (1.912)                                                 | (181)                                                   | (196)                                                   | (18.320)                                                | (16.391)                                                | (17.537)                                                |  |
| 0                                                       | 1                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 232                                                     | 217                                                     | 124                                                     |  |
| (1.729)                                                 | (1.911)                                                 | (181)                                                   | (196)                                                   | (18.088)                                                | (16.174)                                                | (17.413)                                                |  |
| 32.329                                                  | 14.774                                                  | 6.893                                                   | (958)                                                   | 476.617                                                 | 57.929                                                  | 63.533                                                  |  |
| (58)                                                    | (46)                                                    | (3)                                                     | 0                                                       | (908)                                                   | (729)                                                   | (404)                                                   |  |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |  |
| (2.475)                                                 | (3.177)                                                 | 0                                                       | 0                                                       | (3.151)                                                 | (5.667)                                                 | (937)                                                   |  |
| 47                                                      | (521)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | (73)                                                    | (250)                                                   | 1.823                                                   |  |
| (2.486)                                                 | (3.744)                                                 | (3)                                                     | 0                                                       | (4.132)                                                 | (6.646)                                                 | 482                                                     |  |
| 29.843                                                  | 11.030                                                  | 6.890                                                   | (958)                                                   | 472.485                                                 | 51.283                                                  | 64.015                                                  |  |
| (1)                                                     | (3)                                                     | (2)                                                     | 3                                                       | (204)                                                   | (172)                                                   | (1.683)                                                 |  |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (364)                                                   | (2)                                                     |  |
| 29.842                                                  | 11.027                                                  | 6.888                                                   | (955)                                                   | 472.281                                                 | 50.747                                                  | 62.330                                                  |  |
| \$ 29.842                                               | \$ 11.027                                               | \$ 6.888                                                | \$ (955)                                                | \$ 472.281                                              | \$ 50.747                                               | € 62.330                                                |  |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | Emerging Local<br>Bond Fund                             |                                                         | Emerging Local<br>Bond ESG Fund                         |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 148.981                                              | \$ 104.888                                              | \$ 5.304                                                | \$ 3.754                                                |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | (27.741)                                                | (4.009)                                                 | (1.629)                                                 | (1.200)                                                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | 43.663                                                  | 23.718                                                  | 1.987                                                   | 490                                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | (8.413)                                                 | (9.430)                                                 | 8                                                       | (592)                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 302.961                                                 | (151.362)                                               | 11.021                                                  | (5.152)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 24.289                                                  | (42.531)                                                | 732                                                     | (1.040)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | (11.629)                                                | 13.128                                                  | (477)                                                   | 27                                                      |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 472.111                                                 | (65.598)                                                | 16.946                                                  | (3.713)                                                 |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (15.841)                                                | (12.880)                                                | (512)                                                   | (490)                                                   |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | (11)                                                    | (12)                                                    | 0                                                       | 0                                                       |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | (1)                                                     | (1)                                                     | (3)                                                     | (3)                                                     |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (15.853)                                                | (12.893)                                                | (515)                                                   | (493)                                                   |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (15.853)                                                | (12.893)                                                | (515)                                                   | (493)                                                   |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | 456.258                                                 | (78.491)                                                | 16.431                                                  | (4.206)                                                 |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (9.651)                                                 | (7.472)                                                 | (326)                                                   | (108)                                                   |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | (15.308)                                                | (10.117)                                                | (3)                                                     | (2)                                                     |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | 1.188                                                   | 856                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (23.771)                                                | (16.733)                                                | (329)                                                   | (110)                                                   |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | 432.487                                                 | (95.224)                                                | 16.102                                                  | (4.316)                                                 |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | (2.584)                                                 | (1.220)                                                 | (80)                                                    | (28)                                                    |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | (681)                                                   | 598                                                     | (15)                                                    | 17                                                      |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | 429.222                                                 | (95.846)                                                | 16.007                                                  | (4.327)                                                 |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | \$ 429.222                                              | \$ (95.846)                                             | \$ 16.007                                               | \$ (4.327)                                              |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| Emerging Markets<br>Bond Fund                           |                                                         | Emerging Markets<br>Bond ESG Fund                       |                                                         | Emerging Markets<br>Corporate Bond Fund                 |                                                         | PIMCO Emerging Markets<br>Opportunities Fund            |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 187.382                                              | \$ 136.881                                              | \$ 114.660                                              | \$ 98.131                                               | \$ 5.286                                                | \$ 4.560                                                | \$ 17.465                                               | \$ 11.812                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (51.875)                                                | (24.743)                                                | (11.959)                                                | (64.425)                                                | (1.359)                                                 | (2.493)                                                 | 1.782                                                   | 2.629                                                   |
| 79.287                                                  | (15.303)                                                | 69.840                                                  | (44.918)                                                | 8.338                                                   | (2.336)                                                 | 10.008                                                  | (530)                                                   |
| (1.717)                                                 | 1.974                                                   | (1.677)                                                 | 2.085                                                   | 8                                                       | (27)                                                    | (713)                                                   | 388                                                     |
| 188.881                                                 | 2.482                                                   | 118.240                                                 | 51.929                                                  | 4.338                                                   | 2.195                                                   | 18.937                                                  | (7.892)                                                 |
| 78.995                                                  | (28.787)                                                | 81.710                                                  | (31.573)                                                | 6.838                                                   | (2.250)                                                 | 3.448                                                   | 1.261                                                   |
| (2.004)                                                 | 243                                                     | (1.963)                                                 | 3.029                                                   | 7                                                       | (29)                                                    | (710)                                                   | (95)                                                    |
| 478.949                                                 | 72.747                                                  | 368.851                                                 | 14.258                                                  | 23.456                                                  | (380)                                                   | 50.217                                                  | 7.573                                                   |
| (19.744)                                                | (17.024)                                                | (11.510)                                                | (12.116)                                                | (831)                                                   | (914)                                                   | (933)                                                   | (698)                                                   |
| (16)                                                    | (14)                                                    | (5)                                                     | (5)                                                     | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (64)                                                    | (75)                                                    | (6)                                                     | (5)                                                     | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (42)                                                    | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (2)                                                     | (14)                                                    | (1)                                                     | (1)                                                     | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (19.868)                                                | (17.127)                                                | (11.522)                                                | (12.127)                                                | (831)                                                   | (914)                                                   | (933)                                                   | (698)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 1                                                       |
| (19.868)                                                | (17.127)                                                | (11.522)                                                | (12.127)                                                | (831)                                                   | (914)                                                   | (933)                                                   | (697)                                                   |
| 459.081                                                 | 55.620                                                  | 357.329                                                 | 2.131                                                   | 22.625                                                  | (1.294)                                                 | 49.284                                                  | 6.876                                                   |
| (7.820)                                                 | (8.142)                                                 | (6.722)                                                 | (7.307)                                                 | (117)                                                   | (107)                                                   | (809)                                                   | (142)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (37.979)                                                | (27.460)                                                | (17.628)                                                | (18.230)                                                | 0                                                       | 0                                                       | (87)                                                    | (45)                                                    |
| 1.372                                                   | 2.669                                                   | 546                                                     | 1.022                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 10                                                      | 0                                                       |
| (44.427)                                                | (32.933)                                                | (23.804)                                                | (24.515)                                                | (117)                                                   | (107)                                                   | (886)                                                   | (187)                                                   |
| 414.654                                                 | 22.687                                                  | 333.525                                                 | (22.384)                                                | 22.508                                                  | (1.401)                                                 | 48.398                                                  | 6.689                                                   |
| (266)                                                   | (675)                                                   | 61                                                      | (238)                                                   | 0                                                       | (21)                                                    | (92)                                                    | (137)                                                   |
| 0                                                       | 274                                                     | 0                                                       | 198                                                     | 0                                                       | 9                                                       | 0                                                       | 32                                                      |
| 414.388                                                 | 22.286                                                  | 333.586                                                 | (22.424)                                                | 22.508                                                  | (1.413)                                                 | 48.306                                                  | 6.584                                                   |
| \$ 414.388                                              | \$ 22.286                                               | \$ 333.586                                              | \$ (22.424)                                             | \$ 22.508                                               | \$ (1.413)                                              | \$ 48.306                                               | \$ 6.584                                                |



## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | Emerging Markets Short-Term<br>Local Currency Fund      |                                                         | PIMCO ESG<br>Income Fund                                |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 561                                                  | \$ 515                                                  | \$ 11.174                                               | \$ 7.234                                                |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | 1                                                       | (281)                                                   | 420                                                     | 361                                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | 397                                                     | 443                                                     | 22.575                                                  | (5.091)                                                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | 7                                                       | (16)                                                    | 148                                                     | (35)                                                    |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 644                                                     | (484)                                                   | 18.300                                                  | (3.280)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 89                                                      | (195)                                                   | 12.957                                                  | (1.982)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | 10                                                      | 13                                                      | 100                                                     | (6)                                                     |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 1.709                                                   | (5)                                                     | 65.674                                                  | (2.799)                                                 |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (119)                                                   | (133)                                                   | (1.424)                                                 | (856)                                                   |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | (8)                                                     | (12)                                                    |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (5)                                                     |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (119)                                                   | (133)                                                   | (1.432)                                                 | (873)                                                   |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 2                                                       | 3                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (117)                                                   | (130)                                                   | (1.432)                                                 | (873)                                                   |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | <b>1.592</b>                                            | <b>(135)</b>                                            | <b>64.242</b>                                           | <b>(3.672)</b>                                          |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (8)                                                     | (6)                                                     | (48)                                                    | (676)                                                   |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (4.613)                                                 | (2.633)                                                 |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | 9                                                       | 0                                                       |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (8)                                                     | (6)                                                     | (4.652)                                                 | (3.309)                                                 |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | <b>1.584</b>                                            | <b>(141)</b>                                            | <b>59.590</b>                                           | <b>(6.981)</b>                                          |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | (7)                                                     | (12)                                                    | (3)                                                     | 70                                                      |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 3                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | <b>1.577</b>                                            | <b>(150)</b>                                            | <b>59.587</b>                                           | <b>(6.911)</b>                                          |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | <b>\$ 1.577</b>                                         | <b>\$ (150)</b>                                         | <b>\$ 59.587</b>                                        | <b>\$ (6.911)</b>                                       |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| Euro Bond Fund                                          |                                                         | Euro Credit Fund                                        |                                                         | Euro Income Bond Fund                                   |                                                         | Euro Long Average Duration Fund                         |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| € 25.362<br>0                                           | € 26.993<br>0                                           | € 8.012<br>0                                            | € 9.338<br>0                                            | € 36.007<br>0                                           | € 32.271<br>0                                           | € 25.402<br>0                                           | € 19.474<br>0                                           |
| (18.823)                                                | (16.732)                                                | (4.097)                                                 | 469                                                     | (71.920)                                                | (4.721)                                                 | (21.897)                                                | (2.578)                                                 |
| 2.835                                                   | (16.525)                                                | 2.834                                                   | 205                                                     | 33.786                                                  | (4.153)                                                 | (11.038)                                                | (15.712)                                                |
| 17.228                                                  | (1.405)                                                 | 4.585                                                   | (67)                                                    | 57.417                                                  | 6.871                                                   | 10.864                                                  | (1.287)                                                 |
| (36.448)                                                | (318)                                                   | (5.685)                                                 | (6.356)                                                 | (63.670)                                                | 38.078                                                  | (63.633)                                                | (66.318)                                                |
| 22.246                                                  | (12.907)                                                | (224)                                                   | (2.138)                                                 | 17.546                                                  | (21.537)                                                | 10.589                                                  | (10.875)                                                |
| 11.371                                                  | (4.925)                                                 | 4.216                                                   | (1.078)                                                 | 47.009                                                  | (27.846)                                                | 5.828                                                   | (2.322)                                                 |
| 23.771                                                  | (25.819)                                                | 9.641                                                   | 373                                                     | 56.175                                                  | 18.963                                                  | (43.885)                                                | (79.618)                                                |
| (4.206)                                                 | (4.304)                                                 | (1.138)                                                 | (1.327)                                                 | (9.551)                                                 | (7.956)                                                 | (2.754)                                                 | (2.604)                                                 |
| (40)                                                    | (35)                                                    | 0                                                       | 0                                                       | (47)                                                    | (37)                                                    | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (4)                                                     | (2)                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (138)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (1)                                                     | (1)                                                     | 0                                                       | 0                                                       | (1)                                                     | (92)                                                    | (1)                                                     | 0                                                       |
| (4.247)                                                 | (4.340)                                                 | (1.138)                                                 | (1.327)                                                 | (9.741)                                                 | (8.087)                                                 | (2.755)                                                 | (2.604)                                                 |
| 97                                                      | 278                                                     | 0                                                       | 6                                                       | 145                                                     | 215                                                     | 0                                                       | 27                                                      |
| (4.150)                                                 | (4.062)                                                 | (1.138)                                                 | (1.321)                                                 | (9.596)                                                 | (7.872)                                                 | (2.755)                                                 | (2.577)                                                 |
| 19.621                                                  | (29.881)                                                | 8.503                                                   | (948)                                                   | 46.579                                                  | 11.091                                                  | (46.640)                                                | (82.195)                                                |
| (103)                                                   | (205)                                                   | (59)                                                    | (186)                                                   | (365)                                                   | (413)                                                   | (3.963)                                                 | (284)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (570)                                                   | (594)                                                   | (7)                                                     | (84)                                                    | (10.609)                                                | (9.485)                                                 | 0                                                       | 0                                                       |
| (4)                                                     | (44)                                                    | 0                                                       | (2)                                                     | 156                                                     | 128                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| (677)                                                   | (843)                                                   | (66)                                                    | (272)                                                   | (10.818)                                                | (9.770)                                                 | (3.963)                                                 | (284)                                                   |
| 18.944                                                  | (30.724)                                                | 8.437                                                   | (1.220)                                                 | 35.761                                                  | 1.321                                                   | (50.603)                                                | (82.479)                                                |
| (33)                                                    | (5)                                                     | (6)                                                     | (2)                                                     | (16)                                                    | 1                                                       | 4                                                       | 2                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 18.911                                                  | (30.729)                                                | 8.431                                                   | (1.222)                                                 | 35.745                                                  | 1.322                                                   | (50.599)                                                | (82.477)                                                |
| € 18.911                                                | € (30.729)                                              | € 8.431                                                 | € (1.222)                                               | € 35.745                                                | € 1.322                                                 | € (50.599)                                              | € (82.477)                                              |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | Euro<br>Short-Term Fund                                 |                                                         | PIMCO European<br>High Yield Bond Fund                  |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | € 4.352                                                 | € 3.873                                                 | € 11.455                                                | € 10.217                                                |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | 458                                                     | (236)                                                   | 2.597                                                   | 1.822                                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | 871                                                     | 1.146                                                   | 1.975                                                   | 899                                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | (39)                                                    | 101                                                     | (17)                                                    | 23                                                      |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | (1.521)                                                 | (827)                                                   | (3.986)                                                 | (1.050)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 697                                                     | 959                                                     | 3.163                                                   | (3.293)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | (58)                                                    | 19                                                      | (3)                                                     | 11                                                      |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 4.760                                                   | 5.035                                                   | 15.184                                                  | 8.629                                                   |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (792)                                                   | (450)                                                   | (798)                                                   | (593)                                                   |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | (16)                                                    | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (808)                                                   | (450)                                                   | (798)                                                   | (593)                                                   |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 0                                                       | 0                                                       | 34                                                      | 43                                                      |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (808)                                                   | (450)                                                   | (764)                                                   | (550)                                                   |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | <b>3.952</b>                                            | <b>4.585</b>                                            | <b>14.420</b>                                           | <b>8.079</b>                                            |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (3)                                                     | (2)                                                     | (68)                                                    | (45)                                                    |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (3)                                                     | (1)                                                     |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (3)                                                     | (2)                                                     | (71)                                                    | (46)                                                    |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | <b>3.949</b>                                            | <b>4.583</b>                                            | <b>14.349</b>                                           | <b>8.033</b>                                            |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | (53)                                                    | (19)                                                    | 2                                                       | 0                                                       |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | <b>3.896</b>                                            | <b>4.564</b>                                            | <b>14.351</b>                                           | <b>8.033</b>                                            |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | <b>€ 3.896</b>                                          | <b>€ 4.564</b>                                          | <b>€ 14.351</b>                                         | <b>€ 8.033</b>                                          |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund            |                                                         | Global Advantage Fund                                   |                                                         | Global Bond Fund                                        |                                                         | Global Bond ESG Fund                                    |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| € 17.289<br>0                                           | € 6.762<br>0                                            | \$ 9.181<br>0                                           | \$ 8.057<br>0                                           | \$ 340.415<br>0                                         | \$ 300.835<br>0                                         | \$ 91.753<br>0                                          | \$ 77.461<br>0                                          |
| (20.734)                                                | (1.890)                                                 | (2.900)                                                 | (13.568)                                                | (157.664)                                               | (206.112)                                               | (30.712)                                                | (42.628)                                                |
| 15.851                                                  | (437)                                                   | 11.001                                                  | 930                                                     | (9.277)                                                 | 183.528                                                 | 92.208                                                  | 16.520                                                  |
| 12.253                                                  | 1.247                                                   | (1.344)                                                 | (131)                                                   | (49.077)                                                | (28.841)                                                | (9.162)                                                 | (1.656)                                                 |
| (17.352)                                                | 2.505                                                   | 35.218                                                  | (192)                                                   | 1.165.734                                               | (296.362)                                               | 310.922                                                 | (85.193)                                                |
| 11.673                                                  | (269)                                                   | 7.245                                                   | (2.652)                                                 | (23.420)                                                | 87.697                                                  | 76.132                                                  | (48.291)                                                |
| 7.526                                                   | (1.521)                                                 | 303                                                     | (3.248)                                                 | 6.616                                                   | (99.736)                                                | 2.103                                                   | (27.239)                                                |
| 26.506                                                  | 6.397                                                   | 58.704                                                  | (10.804)                                                | 1.273.327                                               | (58.991)                                                | 533.244                                                 | (111.026)                                               |
| (1.653)                                                 | (601)                                                   | (1.532)                                                 | (1.492)                                                 | (46.770)                                                | (43.204)                                                | (9.704)                                                 | (8.849)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (812)                                                   | (875)                                                   | (10)                                                    | (14)                                                    |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (69)                                                    | (58)                                                    | (39)                                                    | (28)                                                    |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (71)                                                    | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (8)                                                     | (79)                                                    | (2)                                                     | (2)                                                     |
| (1.653)                                                 | (601)                                                   | (1.532)                                                 | (1.492)                                                 | (47.730)                                                | (44.216)                                                | (9.755)                                                 | (8.893)                                                 |
| 87                                                      | 33                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 1.109                                                   | 1.399                                                   | 0                                                       | 0                                                       |
| (1.566)                                                 | (568)                                                   | (1.532)                                                 | (1.492)                                                 | (46.621)                                                | (42.817)                                                | (9.755)                                                 | (8.893)                                                 |
| 24.940                                                  | 5.829                                                   | 57.172                                                  | (12.296)                                                | 1.226.706                                               | (101.808)                                               | 523.489                                                 | (119.919)                                               |
| (127)                                                   | (22)                                                    | (870)                                                   | (424)                                                   | (6.049)                                                 | (3.336)                                                 | (7.849)                                                 | (1.538)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | (1.951)                                                 | (2.201)                                                 | (27.649)                                                | (26.300)                                                | (12.686)                                                | (10.784)                                                |
| 0                                                       | 0                                                       | (187)                                                   | (4)                                                     | 473                                                     | (3.336)                                                 | (415)                                                   | 213                                                     |
| (127)                                                   | (22)                                                    | (3.008)                                                 | (2.629)                                                 | (33.225)                                                | (32.972)                                                | (20.950)                                                | (12.109)                                                |
| 24.813                                                  | 5.807                                                   | 54.164                                                  | (14.925)                                                | 1.193.481                                               | (134.780)                                               | 502.539                                                 | (132.028)                                               |
| 10                                                      | (110)                                                   | (45)                                                    | (15)                                                    | (54)                                                    | (6.810)                                                 | (4)                                                     | (807)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | (4)                                                     | 7                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 24.823                                                  | 5.697                                                   | 54.115                                                  | (14.933)                                                | 1.193.427                                               | (141.590)                                               | 502.535                                                 | (132.835)                                               |
| € 24.823                                                | € 5.697                                                 | \$ 54.115                                               | \$ (14.933)                                             | \$ 1.193.427                                            | \$ (141.590)                                            | \$ 502.535                                              | \$ (132.835)                                            |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | Global Bond<br>Ex-US Fund                               |                                                         | Global High Yield<br>Bond Fund                          |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 20.669                                               | \$ 16.567                                               | \$ 90.692                                               | \$ 92.243                                               |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | (5.015)                                                 | (18.077)                                                | (17.531)                                                | (66.492)                                                |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | (33.410)                                                | 25.675                                                  | 59.836                                                  | 5.030                                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | (2.599)                                                 | (737)                                                   | (1.744)                                                 | 1.585                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 75.895                                                  | (16.220)                                                | 114.732                                                 | 27.632                                                  |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | (27.463)                                                | 10.377                                                  | 42.380                                                  | (20.712)                                                |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | 562                                                     | (5.860)                                                 | 828                                                     | 513                                                     |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 28.639                                                  | 11.725                                                  | 289.193                                                 | 39.799                                                  |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (2.284)                                                 | (2.299)                                                 | (10.342)                                                | (10.829)                                                |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | (11)                                                    | (11)                                                    | (11)                                                    | (13)                                                    |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | (27)                                                    | (26)                                                    | (106)                                                   | (97)                                                    |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (159)                                                   | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | 0                                                       | 0                                                       | (1)                                                     | (41)                                                    |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (2.322)                                                 | (2.336)                                                 | (10.619)                                                | (10.980)                                                |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (2.322)                                                 | (2.336)                                                 | (10.619)                                                | (10.980)                                                |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | 26.317                                                  | 9.389                                                   | 278.574                                                 | 28.819                                                  |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (792)                                                   | (350)                                                   | (1.441)                                                 | (611)                                                   |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | (140)                                                   | (228)                                                   |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | (2.008)                                                 | (1.917)                                                 | (29.577)                                                | (27.766)                                                |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | (26)                                                    | (48)                                                    | (104)                                                   | 1.046                                                   |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (2.826)                                                 | (2.315)                                                 | (31.262)                                                | (27.559)                                                |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | 23.491                                                  | 7.074                                                   | 247.312                                                 | 1.260                                                   |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | (28)                                                    | (153)                                                   | 0                                                       | (69)                                                    |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | 23.463                                                  | 6.921                                                   | 247.312                                                 | 1.191                                                   |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | \$ 23.463                                               | \$ 6.921                                                | \$ 247.312                                              | \$ 1.191                                                |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| Global High Yield<br>Bond ESG Fund                      |                                                               | Global Investment<br>Grade Credit Fund                  |                                                         | Global Investment Grade<br>Credit ESG Fund              |                                                         | Global Low Duration Real<br>Return Fund                 |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Berichtszeitraum<br>vom<br>17. Juni 2024 bis 30.<br>Juni 2024 | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 324                                                  | \$ 21                                                         | \$ 194.626                                              | \$ 222.052                                              | \$ 54.565                                               | \$ 48.929                                               | \$ 36.517                                               | \$ 24.639                                               |
| 0                                                       | 0                                                             | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 6                                                       | 0                                                             | (87.111)                                                | (234.761)                                               | (853)                                                   | (65.200)                                                | (2.180)                                                 | (18.854)                                                |
| (110)                                                   | 2                                                             | 64.312                                                  | (51.169)                                                | 116.927                                                 | (17.057)                                                | 3.196                                                   | 1.795                                                   |
| 0                                                       | (5)                                                           | 1.587                                                   | 1.191                                                   | (1.952)                                                 | 155                                                     | (389)                                                   | (968)                                                   |
| 356                                                     | 5                                                             | 439.653                                                 | 69.362                                                  | 157.206                                                 | (6.215)                                                 | 140.416                                                 | (7.646)                                                 |
| (54)                                                    | 5                                                             | 141.914                                                 | (80.499)                                                | 53.726                                                  | (16.874)                                                | 17.542                                                  | 8.091                                                   |
| 1                                                       | 0                                                             | 3.215                                                   | (1.902)                                                 | 1.027                                                   | (356)                                                   | 604                                                     | 169                                                     |
| 523                                                     | 28                                                            | 758.196                                                 | (75.726)                                                | 380.646                                                 | (56.618)                                                | 195.706                                                 | 7.226                                                   |
| (31)                                                    | (2)                                                           | (28.122)                                                | (32.337)                                                | (6.620)                                                 | (5.679)                                                 | (3.919)                                                 | (3.238)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                             | (657)                                                   | (838)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | (7)                                                     | (8)                                                     |
| 0                                                       | 0                                                             | (511)                                                   | (541)                                                   | (1.696)                                                 | (1.174)                                                 | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                             | (266)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                             | (4)                                                     | (68)                                                    | (1)                                                     | (1)                                                     | (1)                                                     | (1)                                                     |
| (31)                                                    | (2)                                                           | (29.560)                                                | (33.784)                                                | (8.317)                                                 | (6.854)                                                 | (3.927)                                                 | (3.247)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                             | 450                                                     | 451                                                     | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (31)                                                    | (2)                                                           | (29.110)                                                | (33.333)                                                | (8.317)                                                 | (6.854)                                                 | (3.927)                                                 | (3.247)                                                 |
| 492                                                     | 26                                                            | 729.086                                                 | (109.059)                                               | 372.329                                                 | (63.472)                                                | 191.779                                                 | 3.979                                                   |
| 0                                                       | 0                                                             | (1.736)                                                 | (640)                                                   | (2.131)                                                 | (3.571)                                                 | (14.774)                                                | (16.981)                                                |
| 0                                                       | 0                                                             | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (1)                                                     | 0                                                             | (52.973)                                                | (52.555)                                                | (7.801)                                                 | (13.489)                                                | (2.082)                                                 | (2.657)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                             | (2.109)                                                 | (7.393)                                                 | (536)                                                   | 483                                                     | (52)                                                    | 1.172                                                   |
| (1)                                                     | 0                                                             | (56.818)                                                | (60.588)                                                | (10.468)                                                | (16.577)                                                | (16.908)                                                | (18.466)                                                |
| 491                                                     | 26                                                            | 672.268                                                 | (169.647)                                               | 361.861                                                 | (80.049)                                                | 174.871                                                 | (14.487)                                                |
| 0                                                       | 0                                                             | (475)                                                   | (103)                                                   | (21)                                                    | 30                                                      | (2)                                                     | 16                                                      |
| 0                                                       | 0                                                             | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 491                                                     | 26                                                            | 671.793                                                 | (169.750)                                               | 361.840                                                 | (80.019)                                                | 174.869                                                 | (14.471)                                                |
| \$ 491                                                  | \$ 26                                                         | \$ 671.793                                              | \$ (169.750)                                            | \$ 361.840                                              | \$ (80.019)                                             | \$ 174.869                                              | \$ (14.471)                                             |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | Global Real<br>Return Fund                              |                                                         | Income Fund                                             |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 30.684                                               | \$ 25.003                                               | \$ 2.390.363                                            | \$ 2.031.317                                            |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | (112.907)                                               | (31.534)                                                | 482.254                                                 | (823.916)                                               |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | (22.848)                                                | 25.222                                                  | 1.486.702                                               | (203.745)                                               |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | 2.800                                                   | (1.065)                                                 | 173.515                                                 | 11.180                                                  |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 353.490                                                 | (54.610)                                                | 3.743.985                                               | (704.341)                                               |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | (1.029)                                                 | 10.118                                                  | 363.115                                                 | 102.408                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | (5.190)                                                 | 2.683                                                   | (25.021)                                                | 13.949                                                  |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 245.000                                                 | (24.183)                                                | 8.614.913                                               | 426.852                                                 |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (6.154)                                                 | (7.184)                                                 | (431.317)                                               | (352.531)                                               |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | (56)                                                    | (104)                                                   | (8.329)                                                 | (7.247)                                                 |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | (78)                                                    | (88)                                                    | (27.752)                                                | (20.611)                                                |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (2.101)                                                 | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | (1)                                                     | (1)                                                     | (45)                                                    | (1.845)                                                 |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (6.289)                                                 | (7.377)                                                 | (469.544)                                               | (382.234)                                               |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 0                                                       | 0                                                       | 505                                                     | 506                                                     |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (6.289)                                                 | (7.377)                                                 | (469.039)                                               | (381.728)                                               |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | 238.711                                                 | (31.560)                                                | 8.145.874                                               | 45.124                                                  |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (24.292)                                                | (29.278)                                                | (13.649)                                                | (6.148)                                                 |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | (4.240)                                                 | (10.651)                                                | (1.551.393)                                             | (1.232.307)                                             |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | (512)                                                   | 4.361                                                   | 5.040                                                   | 15.660                                                  |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (29.044)                                                | (35.568)                                                | (1.560.002)                                             | (1.222.795)                                             |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | 209.667                                                 | (67.128)                                                | 6.585.872                                               | (1.177.671)                                             |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | 0                                                       | 16                                                      | 1.422                                                   | (2.091)                                                 |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | 209.667                                                 | (67.112)                                                | 6.587.294                                               | (1.179.762)                                             |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | \$ 209.667                                              | \$ (67.112)                                             | \$ 6.587.294                                            | \$ (1.179.762)                                          |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| Income Fund II                                          |                                                         | Inflation Multi-Asset Fund                              |                                                         | Low Average Duration Fund                               |                                                         | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund        |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 8.470                                                | \$ 5.754                                                | \$ 2.243                                                | \$ 2.709                                                | \$ 17.569                                               | \$ 20.688                                               | \$ 25.843                                               | \$ 22.082                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 781                                                     | (394)                                                   | (1.459)                                                 | (4.397)                                                 | (1.763)                                                 | (8.813)                                                 | 3.853                                                   | (7.127)                                                 |
| (3.866)                                                 | (2.638)                                                 | (1.614)                                                 | (134)                                                   | 3.615                                                   | (2.558)                                                 | 18.719                                                  | (4.127)                                                 |
| 218                                                     | (161)                                                   | 1.711                                                   | 738                                                     | 81                                                      | (172)                                                   | 706                                                     | (159)                                                   |
| 15.532                                                  | (1.765)                                                 | 17.973                                                  | (704)                                                   | 16.757                                                  | 440                                                     | 55.427                                                  | (9.854)                                                 |
| 3.911                                                   | (2.044)                                                 | 423                                                     | 5.396                                                   | (1.053)                                                 | 5.944                                                   | 20.592                                                  | (7.366)                                                 |
| 20                                                      | 2                                                       | (121)                                                   | (24)                                                    | 79                                                      | (130)                                                   | 513                                                     | (128)                                                   |
| 25.066                                                  | (1.246)                                                 | 19.156                                                  | 3.584                                                   | 35.285                                                  | 15.399                                                  | 125.653                                                 | (6.679)                                                 |
| (2.173)                                                 | (1.466)                                                 | (998)                                                   | (1.332)                                                 | (1.958)                                                 | (2.113)                                                 | (2.924)                                                 | (2.383)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (15)                                                    | (20)                                                    | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | (7)                                                     | (14)                                                    | (5)                                                     | (15)                                                    | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | (1)                                                     | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (1)                                                     | 0                                                       |
| (2.173)                                                 | (1.467)                                                 | (1.005)                                                 | (1.346)                                                 | (1.978)                                                 | (2.148)                                                 | (2.925)                                                 | (2.383)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 63                                                      | 64                                                      | 0                                                       | 0                                                       |
| (2.173)                                                 | (1.467)                                                 | (1.005)                                                 | (1.346)                                                 | (1.915)                                                 | (2.084)                                                 | (2.925)                                                 | (2.383)                                                 |
| 22.893                                                  | (2.713)                                                 | 18.151                                                  | 2.238                                                   | 33.370                                                  | 13.315                                                  | 122.728                                                 | (9.062)                                                 |
| (117)                                                   | (77)                                                    | (717)                                                   | (660)                                                   | (1.197)                                                 | (3.254)                                                 | (338)                                                   | (609)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (9.329)                                                 | (6.018)                                                 | (68)                                                    | (245)                                                   | (829)                                                   | (867)                                                   | (1.088)                                                 | (462)                                                   |
| 143                                                     | 202                                                     | (2)                                                     | 66                                                      | (38)                                                    | 82                                                      | (12)                                                    | 0                                                       |
| (9.303)                                                 | (5.893)                                                 | (787)                                                   | (839)                                                   | (2.064)                                                 | (4.039)                                                 | (1.438)                                                 | (1.071)                                                 |
| 13.590                                                  | (8.606)                                                 | 17.364                                                  | 1.399                                                   | 31.306                                                  | 9.276                                                   | 121.290                                                 | (10.133)                                                |
| 0                                                       | 10                                                      | (87)                                                    | (109)                                                   | (7)                                                     | (52)                                                    | (42)                                                    | (29)                                                    |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (92)                                                    | 0                                                       | 0                                                       |
| 13.590                                                  | (8.596)                                                 | 17.277                                                  | 1.290                                                   | 31.299                                                  | 9.132                                                   | 121.248                                                 | (10.162)                                                |
| \$ 13.590                                               | \$ (8.596)                                              | \$ 17.277                                               | \$ 1.290                                                | \$ 31.299                                               | \$ 9.132                                                | \$ 121.248                                              | \$ (10.162)                                             |



## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | Low Duration<br>Income Fund                             |                                                         | Low Duration<br>Opportunities Fund                      |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 72.845                                               | \$ 60.538                                               | \$ 18.034                                               | \$ 17.912                                               |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | 17.137                                                  | (6.159)                                                 | (6.174)                                                 | (12.954)                                                |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | 46.618                                                  | 2.051                                                   | 39.815                                                  | 7.850                                                   |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | 2.391                                                   | 1.007                                                   | 577                                                     | 421                                                     |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 157.270                                                 | (38.535)                                                | 45.847                                                  | (1.040)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 30.196                                                  | 7.383                                                   | 4.391                                                   | 9.013                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | 1.097                                                   | 841                                                     | 336                                                     | (334)                                                   |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 327.554                                                 | 27.126                                                  | 102.826                                                 | 20.868                                                  |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (10.520)                                                | (6.786)                                                 | (2.038)                                                 | (1.827)                                                 |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | (3)                                                     | (5)                                                     |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | (109)                                                   | (19)                                                    | 0                                                       | 0                                                       |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | (1)                                                     | (1)                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (10.630)                                                | (6.806)                                                 | (2.041)                                                 | (1.832)                                                 |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 0                                                       | 0                                                       | 94                                                      | 95                                                      |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (10.630)                                                | (6.806)                                                 | (1.947)                                                 | (1.737)                                                 |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | <b>316.924</b>                                          | <b>20.320</b>                                           | <b>100.879</b>                                          | <b>19.131</b>                                           |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (659)                                                   | (202)                                                   | (154)                                                   | (146)                                                   |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | (18.482)                                                | (13.140)                                                | (13.684)                                                | (8.663)                                                 |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | (1.210)                                                 | 357                                                     | 10                                                      | (395)                                                   |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (20.351)                                                | (12.985)                                                | (13.828)                                                | (9.204)                                                 |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | <b>296.573</b>                                          | <b>7.335</b>                                            | <b>87.051</b>                                           | <b>9.927</b>                                            |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | 0                                                       | 11                                                      | (49)                                                    | (42)                                                    |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (80)                                                    |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | <b>296.573</b>                                          | <b>7.346</b>                                            | <b>87.002</b>                                           | <b>9.805</b>                                            |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | <b>\$ 296.573</b>                                       | <b>\$ 7.346</b>                                         | <b>\$ 87.002</b>                                        | <b>\$ 9.805</b>                                         |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| Low Duration Opportunities ESG Fund                     |                                                         | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund                  |                                                         | Mortgage Opportunities Fund                             |                                                         | StocksPLUS™ Fund                                        |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 153                                                  | \$ 131                                                  | \$ 3.586                                                | \$ 2.634                                                | \$ 61.315                                               | \$ 31.637                                               | \$ 111.855                                              | \$ 58.602                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (10)                                                    | 3                                                       | 5.340                                                   | 2.921                                                   | 10.025                                                  | (3.576)                                                 | 6.999                                                   | (5.065)                                                 |
| (59)                                                    | 34                                                      | 4.852                                                   | 6.895                                                   | 30.853                                                  | (5.459)                                                 | (199.243)                                               | 246.538                                                 |
| 3                                                       | 1                                                       | (319)                                                   | (1)                                                     | (806)                                                   | 683                                                     | 1.718                                                   | (307)                                                   |
| 295                                                     | (101)                                                   | (1.153)                                                 | 3.173                                                   | 82.168                                                  | (5.551)                                                 | 170.045                                                 | (24.634)                                                |
| (84)                                                    | 41                                                      | 6.720                                                   | 1.678                                                   | 14.031                                                  | 3.981                                                   | 237.441                                                 | 49.713                                                  |
| 3                                                       | (3)                                                     | 6                                                       | (3)                                                     | (66)                                                    | 43                                                      | 355                                                     | (106)                                                   |
| 301                                                     | 106                                                     | 19.032                                                  | 17.297                                                  | 197.520                                                 | 21.758                                                  | 329.170                                                 | 324.741                                                 |
| (14)                                                    | (14)                                                    | (1.107)                                                 | (552)                                                   | (7.834)                                                 | (4.090)                                                 | (15.597)                                                | (8.070)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (59)                                                    | (46)                                                    | (67)                                                    | (49)                                                    |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (291)                                                   | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (1)                                                     | 0                                                       | (2)                                                     | (73)                                                    |
| (14)                                                    | (14)                                                    | (1.107)                                                 | (552)                                                   | (7.894)                                                 | (4.136)                                                 | (15.957)                                                | (8.192)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (14)                                                    | (14)                                                    | (1.107)                                                 | (552)                                                   | (7.894)                                                 | (4.136)                                                 | (15.957)                                                | (8.192)                                                 |
| 287                                                     | 92                                                      | 17.925                                                  | 16.745                                                  | 189.626                                                 | 17.622                                                  | 313.213                                                 | 316.549                                                 |
| (20)                                                    | (3)                                                     | (55)                                                    | (23)                                                    | (5.092)                                                 | (566)                                                   | (1.667)                                                 | (877)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | (1)                                                     | (2.705)                                                 | (710)                                                   | (3.145)                                                 | (2.362)                                                 | (838)                                                   | (802)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 69                                                      | (10)                                                    | 52                                                      | (630)                                                   | 0                                                       | (1)                                                     |
| (20)                                                    | (4)                                                     | (2.691)                                                 | (743)                                                   | (8.185)                                                 | (3.558)                                                 | (2.505)                                                 | (1.680)                                                 |
| 267                                                     | 88                                                      | 15.234                                                  | 16.002                                                  | 181.441                                                 | 14.064                                                  | 310.708                                                 | 314.869                                                 |
| 0                                                       | 2                                                       | (252)                                                   | (187)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 51                                                      | (41)                                                    |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 267                                                     | 90                                                      | 14.982                                                  | 15.815                                                  | 181.441                                                 | 14.064                                                  | 310.759                                                 | 314.828                                                 |
| \$ 267                                                  | \$ 90                                                   | \$ 14.982                                               | \$ 15.815                                               | \$ 181.441                                              | \$ 14.064                                               | \$ 310.759                                              | \$ 314.828                                              |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | PIMCO StocksPLUS™<br>AR Fund                            |                                                         | Strategic<br>Income Fund                                |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 233                                                  | \$ 254                                                  | \$ 57.240                                               | \$ 12.427                                               |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | 0                                                       | (86)                                                    | 20.906                                                  | (1.857)                                                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | (229)                                                   | 1.185                                                   | 71.030                                                  | (4.117)                                                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | 6                                                       | 3                                                       | 1.380                                                   | (99)                                                    |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 357                                                     | (135)                                                   | 173.575                                                 | 2.336                                                   |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 334                                                     | 419                                                     | 64.812                                                  | (1.034)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | 3                                                       | (1)                                                     | (77)                                                    | 53                                                      |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 704                                                     | 1.639                                                   | 388.866                                                 | 7.709                                                   |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (34)                                                    | (39)                                                    | (13.507)                                                | (2.965)                                                 |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | (11)                                                    | 0                                                       |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (149)                                                   | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | 0                                                       | 0                                                       | (1)                                                     | (46)                                                    |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (34)                                                    | (39)                                                    | (13.668)                                                | (3.011)                                                 |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 1                                                       | 1                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (33)                                                    | (38)                                                    | (13.668)                                                | (3.011)                                                 |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | <b>671</b>                                              | <b>1.601</b>                                            | <b>375.198</b>                                          | <b>4.698</b>                                            |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | (2.380)                                                 | (729)                                                   |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (4.099)                                                 | (3.049)                                                 |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | 82                                                      | (671)                                                   |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | 0                                                       | 0                                                       | (6.397)                                                 | (4.449)                                                 |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | <b>671</b>                                              | <b>1.601</b>                                            | <b>368.801</b>                                          | <b>249</b>                                              |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | 0                                                       | 1                                                       | (2.140)                                                 | (585)                                                   |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | (11)                                                    | (27)                                                    |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | <b>671</b>                                              | <b>1.602</b>                                            | <b>366.650</b>                                          | <b>(363)</b>                                            |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | <b>\$ 671</b>                                           | <b>\$ 1.602</b>                                         | <b>\$ 366.650</b>                                       | <b>\$ (363)</b>                                         |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

| Total Return<br>Bond Fund                               |                                                         | PIMCO TRENDS Managed<br>Futures Strategy Fund           |                                                         | UK Corporate<br>Bond Fund                               |                                                         | UK Long Term Corporate<br>Bond Fund                     |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 87.314                                               | \$ 93.009                                               | \$ 3.394                                                | \$ 5.848                                                | £ 5.056                                                 | £ 7.167                                                 | £ 2.492                                                 | £ 7.860                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (25.879)                                                | (79.254)                                                | (4.281)                                                 | (587)                                                   | (4.287)                                                 | (17.962)                                                | (11.107)                                                | (3.555)                                                 |
| 14.702                                                  | (2.726)                                                 | (15.888)                                                | 1.834                                                   | 789                                                     | 975                                                     | 1.052                                                   | 1.414                                                   |
| (312)                                                   | (374)                                                   | 2.707                                                   | (394)                                                   | 857                                                     | 332                                                     | 987                                                     | 439                                                     |
| 242.480                                                 | (56.223)                                                | (3.782)                                                 | (3.478)                                                 | 4.930                                                   | 10.128                                                  | 8.955                                                   | (12.271)                                                |
| 3.081                                                   | 25.638                                                  | 6.255                                                   | (5.980)                                                 | (55)                                                    | (82)                                                    | (954)                                                   | (2.270)                                                 |
| 799                                                     | (306)                                                   | 66                                                      | (26)                                                    | 648                                                     | (549)                                                   | 521                                                     | (658)                                                   |
| 322.185                                                 | (20.236)                                                | (11.529)                                                | (2.783)                                                 | 7.938                                                   | 9                                                       | 1.946                                                   | (9.041)                                                 |
| (14.737)                                                | (15.406)                                                | (922)                                                   | (1.334)                                                 | (295)                                                   | (547)                                                   | (217)                                                   | (747)                                                   |
| (621)                                                   | (705)                                                   | 0                                                       | (8)                                                     | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (351)                                                   | (429)                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (14)                                                    | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (2)                                                     | (18)                                                    | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (15.725)                                                | (16.558)                                                | (922)                                                   | (1.342)                                                 | (295)                                                   | (547)                                                   | (217)                                                   | (747)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 23                                                      | 38                                                      | 5                                                       | 33                                                      | 0                                                       | 0                                                       |
| (15.725)                                                | (16.558)                                                | (899)                                                   | (1.304)                                                 | (290)                                                   | (514)                                                   | (217)                                                   | (747)                                                   |
| 306.460                                                 | (36.794)                                                | (12.428)                                                | (4.087)                                                 | 7.648                                                   | (505)                                                   | 1.729                                                   | (9.788)                                                 |
| (3.804)                                                 | (3.031)                                                 | (125)                                                   | (40)                                                    | (36)                                                    | (430)                                                   | (23)                                                    | (122)                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (10.769)                                                | (11.560)                                                | (473)                                                   | (744)                                                   | (4.194)                                                 | (4.768)                                                 | (379)                                                   | (808)                                                   |
| (264)                                                   | 437                                                     | (47)                                                    | (129)                                                   | 72                                                      | 409                                                     | (91)                                                    | 6                                                       |
| (14.837)                                                | (14.154)                                                | (645)                                                   | (913)                                                   | (4.158)                                                 | (4.789)                                                 | (493)                                                   | (924)                                                   |
| 291.623                                                 | (50.948)                                                | (13.073)                                                | (5.000)                                                 | 3.490                                                   | (5.294)                                                 | 1.236                                                   | (10.712)                                                |
| (9)                                                     | 274                                                     | (3)                                                     | 0                                                       | (3)                                                     | 0                                                       | 1                                                       | 0                                                       |
| 0                                                       | 0                                                       | (12)                                                    | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | (10)                                                    | 0                                                       |
| 291.614                                                 | (50.674)                                                | (13.088)                                                | (5.000)                                                 | 3.487                                                   | (5.294)                                                 | 1.227                                                   | (10.712)                                                |
| \$ 291.614                                              | \$ (50.674)                                             | \$ (13.088)                                             | \$ (5.000)                                              | £ 3.487                                                 | £ (5.294)                                               | £ 1.227                                                 | £ (10.712)                                              |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                                                                                                                       | US High Yield<br>Bond Fund                              |                                                         | US Investment Grade<br>Corporate Bond Fund              |                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                       | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Erträge</b>                                                                                                                                                                                                        |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zins- und Dividendenerträge                                                                                                                                                                                           | \$ 57.760                                               | \$ 60.475                                               | \$ 12.331                                               | \$ 11.857                                               |
| Sonstige Erträge                                                                                                                                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren,<br>Investmentfonds, Pensionsgeschäften, Einlagen bei<br>Kreditinstituten und sonstigen finanziellen Vermögenswerten                               | (20.470)                                                | (43.133)                                                | (3.106)                                                 | (3.702)                                                 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                                                | 20.239                                                  | 2.346                                                   | 5.454                                                   | 976                                                     |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung                                                                                                                                                                  | 284                                                     | 4                                                       | (440)                                                   | (21)                                                    |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds,<br>Pensionsgeschäften, Einlagen bei Kreditinstituten und sonstigen<br>finanziellen Vermögenswerten | 38.102                                                  | 30.308                                                  | 15.727                                                  | (4.490)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>derivativen Finanzinstrumenten                                                                                                                  | 18.363                                                  | (8.836)                                                 | 12.895                                                  | (4.965)                                                 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus<br>Fremdwährung                                                                                                                                    | 94                                                      | (9)                                                     | (189)                                                   | 15                                                      |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust)                                                                                                                                                                                         | 114.372                                                 | 41.155                                                  | 42.672                                                  | (330)                                                   |
| <b>Betriebskosten</b>                                                                                                                                                                                                 |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Verwaltungsgebühr                                                                                                                                                                                                     | (5.698)                                                 | (6.133)                                                 | (1.522)                                                 | (1.481)                                                 |
| Servicegebühr                                                                                                                                                                                                         | (437)                                                   | (431)                                                   | 0                                                       | 0                                                       |
| Bestandspflegegebühr                                                                                                                                                                                                  | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Vertriebsgebühr                                                                                                                                                                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Sonstige Aufwendungen                                                                                                                                                                                                 | (1)                                                     | (1)                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| Gesamtaufwendungen                                                                                                                                                                                                    | (6.136)                                                 | (6.565)                                                 | (1.522)                                                 | (1.481)                                                 |
| Erstattungen der Anlageberater                                                                                                                                                                                        | 29                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Betriebskosten, netto                                                                                                                                                                                                 | (6.107)                                                 | (6.565)                                                 | (1.522)                                                 | (1.481)                                                 |
| <b>Anlageerträge/(-verluste), netto</b>                                                                                                                                                                               | <b>108.265</b>                                          | <b>34.590</b>                                           | <b>41.150</b>                                           | <b>(1.811)</b>                                          |
| <b>Finanzierungskosten</b>                                                                                                                                                                                            |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| Zinsaufwendungen                                                                                                                                                                                                      | (945)                                                   | (206)                                                   | (345)                                                   | (282)                                                   |
| Aufwand für Kreditfazilitäten                                                                                                                                                                                         | (86)                                                    | (144)                                                   | 0                                                       | 0                                                       |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber                                                                                                                                                       | (4.444)                                                 | (9.626)                                                 | (1.739)                                                 | (2.217)                                                 |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren                                                                                                                                                                                  | (736)                                                   | (292)                                                   | (104)                                                   | (90)                                                    |
| Summe Finanzierungskosten                                                                                                                                                                                             | (6.211)                                                 | (10.268)                                                | (2.188)                                                 | (2.589)                                                 |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern</b>                                                                                                                                                             | <b>102.054</b>                                          | <b>24.322</b>                                           | <b>38.962</b>                                           | <b>(4.400)</b>                                          |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge                                                                                                                                                              | 0                                                       | 0                                                       | (44)                                                    | (27)                                                    |
| Kapitalertragsteuer                                                                                                                                                                                                   | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| <b>Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern</b>                                                                                                                                                            | <b>102.054</b>                                          | <b>24.322</b>                                           | <b>38.918</b>                                           | <b>(4.427)</b>                                          |
| <b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und<br/>gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit</b>                                                                                         | <b>\$ 102.054</b>                                       | <b>\$ 24.322</b>                                        | <b>\$ 38.918</b>                                        | <b>\$ (4.427)</b>                                       |

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Alle Beträge stammen ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

\* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

| US Short-Term Fund                                      |                                                         | Summe der Gesellschaft*                                 |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 60.197                                               | \$ 51.490                                               | \$ 5.145.897                                            | \$ 4.462.387                                            |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 11                                                      |
| (1.900)                                                 | (3.887)                                                 | (117.194)                                               | (2.286.659)                                             |
| (3.858)                                                 | (1.192)                                                 | 2.453.190                                               | 337.677                                                 |
| (797)                                                   | 61                                                      | 217.865                                                 | (9.708)                                                 |
| 28.746                                                  | 6.047                                                   | 9.246.669                                               | (940.773)                                               |
| (351)                                                   | 8.679                                                   | 1.503.515                                               | (171.471)                                               |
| 154                                                     | (42)                                                    | 56.596                                                  | (182.425)                                               |
| 82.191                                                  | 61.156                                                  | 18.506.538                                              | 1.209.039                                               |
| (5.205)                                                 | (3.773)                                                 | (831.854)                                               | (713.705)                                               |
| (14)                                                    | (14)                                                    | (12.054)                                                | (11.497)                                                |
| 0                                                       | 0                                                       | (32.193)                                                | (24.223)                                                |
| 0                                                       | 0                                                       | (12.377)                                                | 0                                                       |
| (1)                                                     | (1)                                                     | (95)                                                    | (3.366)                                                 |
| (5.220)                                                 | (3.788)                                                 | (888.573)                                               | (752.791)                                               |
| 348                                                     | 330                                                     | 3.740                                                   | 4.414                                                   |
| (4.872)                                                 | (3.458)                                                 | (884.833)                                               | (748.377)                                               |
| 77.319                                                  | 57.698                                                  | 17.621.705                                              | 460.662                                                 |
| (97)                                                    | (59)                                                    | (140.061)                                               | (119.434)                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | (341)                                                   | (576)                                                   |
| (21.842)                                                | (20.022)                                                | (2.126.980)                                             | (1.660.370)                                             |
| (8)                                                     | 9                                                       | (3.296)                                                 | 14.543                                                  |
| (21.947)                                                | (20.072)                                                | (2.270.678)                                             | (1.765.837)                                             |
| 55.372                                                  | 37.626                                                  | 15.351.027                                              | (1.305.175)                                             |
| (4)                                                     | (4)                                                     | (8.447)                                                 | (16.185)                                                |
| 0                                                       | 0                                                       | (1.035)                                                 | 602                                                     |
| 55.368                                                  | 37.622                                                  | 15.341.545                                              | (1.320.758)                                             |
| \$ 55.368                                               | \$ 37.622                                               | \$ 15.341.545                                           | \$ (1.320.758)                                          |

## Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)

|                                                                                                                    | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                   |                                                   | Asia Strategic Interest Bond Fund                 |                                                   | PIMCO Balanced Income and Growth Fund             |                                                   |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 1.833.693                                      | \$ 2.434.728                                      | \$ 228.519                                        | \$ 177.208                                        | \$ 1.380.013                                      | \$ 670.116                                        |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 193.903                                           | 281.871                                           | 115.714                                           | 75.070                                            | 1.452.905                                         | 424.105                                           |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 666                                               | 502                                               | 291                                               | 613                                               | 683                                               | 12                                                |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (651.729)                                         | (416.964)                                         | (100.702)                                         | (42.990)                                          | (517.426)                                         | (140.280)                                         |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 91.272                                            | 184.592                                           | 8.554                                             | 4.349                                             | 230.315                                           | 38.776                                            |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 1.467.805                                      | \$ 2.484.729                                      | \$ 252.376                                        | \$ 214.250                                        | \$ 2.546.490                                      | \$ 992.729                                        |

  

|                                                                                                                    | Diversified Income Fund                           |                                                   | Diversified Income Duration Hedged Fund           |                                                   | Diversified Income ESG Fund                       |                                                   |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 8.784.448                                      | \$ 7.439.798                                      | \$ 296.525                                        | \$ 412.839                                        | \$ 49.578                                         | \$ 57.563                                         |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 2.502.596                                         | 1.306.262                                         | 38.587                                            | 35.971                                            | 46                                                | 317                                               |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 8.221                                             | 8.564                                             | 26                                                | 19                                                | 0                                                 | 0                                                 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (2.232.357)                                       | (944.984)                                         | (35.376)                                          | (79.496)                                          | (3.815)                                           | (4.063)                                           |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 678.092                                           | (62.822)                                          | 29.842                                            | 11.027                                            | 6.888                                             | (955)                                             |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 9.741.000                                      | \$ 7.746.818                                      | \$ 329.604                                        | \$ 380.360                                        | \$ 52.697                                         | \$ 52.862                                         |

  

|                                                                                                                    | Emerging Markets Bond Fund                        |                                                   | Emerging Markets Bond ESG Fund                    |                                                   | Emerging Markets Corporate Bond Fund              |                                                   |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|---------------------------------------------------|
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 4.179.583                                      | \$ 3.846.285                                      | \$ 2.676.135                                      | \$ 2.693.921                                      | \$ 146.021                                        | \$ 157.713                                        |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 1.348.174                                         | 904.696                                           | 260.098                                           | 507.292                                           | 8.299                                             | 1.099                                             |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 3.528                                             | 2.248                                             | 689                                               | 704                                               | 0                                                 | 0                                                 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (1.251.079)                                       | (641.398)                                         | (274.195)                                         | (295.868)                                         | (13.210)                                          | (6.575)                                           |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 | 0                                                 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 414.388                                           | 22.286                                            | 333.586                                           | (22.424)                                          | 22.508                                            | (1.413)                                           |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 4.694.594                                      | \$ 4.134.117                                      | \$ 2.996.313                                      | \$ 2.883.625                                      | \$ 163.618                                        | \$ 150.824                                        |

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

<sup>(1)</sup> Der Dynamic Multi-Asset Fund wurde am 22. November 2024 geschlossen.

| PIMCO Capital Securities Fund                           |                                                         | PIMCO Climate Bond Fund                                 |                                                         | Commodity Real Return Fund                              |                                                         | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund                    |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 4.753.034                                            | \$ 5.137.886                                            | \$ 318.213                                              | \$ 262.316                                              | \$ 739.034                                              | \$ 858.902                                              | \$ 125.468                                              | \$ 100.063                                              |
| 571.080                                                 | 564.042                                                 | 30.505                                                  | 70.397                                                  | 114.656                                                 | 121.200                                                 | 123.242                                                 | 30.059                                                  |
| 3.204                                                   | 3.998                                                   | 5                                                       | 4                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (723.210)                                               | (1.070.705)                                             | (37.604)                                                | (30.331)                                                | (195.866)                                               | (202.412)                                               | (13.300)                                                | (10.371)                                                |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 429.874                                                 | 69.717                                                  | 38.184                                                  | (6.894)                                                 | 68.188                                                  | 20.875                                                  | 16.962                                                  | 690                                                     |
| \$ 5.033.982                                            | \$ 4.704.938                                            | \$ 349.303                                              | \$ 295.492                                              | \$ 726.012                                              | \$ 798.565                                              | \$ 252.372                                              | \$ 120.441                                              |
| Dynamic Bond Fund                                       |                                                         | Dynamic Multi-Asset Fund <sup>(1)</sup>                 |                                                         | Emerging Local Bond Fund                                |                                                         | Emerging Local Bond ESG Fund                            |                                                         |
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener Berichtszeitraum    |                                                         | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 3.669.925                                            | \$ 3.445.573                                            | € 3.262.045                                             |                                                         | \$ 2.840.608                                            | \$ 2.880.941                                            | \$ 116.904                                              | \$ 102.408                                              |
| 404.303                                                 | 276.243                                                 | 117.536                                                 |                                                         | 1.421.544                                               | 571.824                                                 | 4.662                                                   | 23.992                                                  |
| 308                                                     | 647                                                     | 15                                                      |                                                         | 1.815                                                   | 1.134                                                   | 3                                                       | 2                                                       |
| (200.001)                                               | (274.257)                                               | (944.187)                                               |                                                         | (431.460)                                               | (685.823)                                               | (4.218)                                                 | (8.688)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |                                                         | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 472.281                                                 | 50.747                                                  | 62.330                                                  |                                                         | 429.222                                                 | (95.846)                                                | 16.007                                                  | (4.327)                                                 |
| \$ 4.346.816                                            | \$ 3.498.953                                            | € 2.497.739                                             |                                                         | \$ 4.261.729                                            | \$ 2.672.230                                            | \$ 133.358                                              | \$ 113.387                                              |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund               |                                                         | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund         |                                                         | PIMCO ESG Income Fund                                   |                                                         | Euro Bond Fund                                          |                                                         |
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 327.198                                              | \$ 282.790                                              | \$ 15.660                                               | \$ 19.946                                               | \$ 351.843                                              | \$ 271.208                                              | € 1.675.554                                             | € 1.671.713                                             |
| 75.659                                                  | 41.575                                                  | 2.948                                                   | 2.624                                                   | 175.167                                                 | 78.839                                                  | 202.207                                                 | 252.091                                                 |
| 52                                                      | 38                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 2.837                                                   | 770                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| (18.756)                                                | (12.038)                                                | (6.055)                                                 | (5.024)                                                 | (61.302)                                                | (55.284)                                                | (257.774)                                               | (325.231)                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 48.306                                                  | 6.584                                                   | 1.577                                                   | (150)                                                   | 59.587                                                  | (6.911)                                                 | 18.911                                                  | (30.729)                                                |
| \$ 432.459                                              | \$ 318.949                                              | \$ 14.130                                               | \$ 17.396                                               | \$ 528.132                                              | \$ 288.622                                              | € 1.638.898                                             | € 1.567.844                                             |



## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

|                                                                                                                    | Euro Credit Fund                                        |                                                         | Euro Income Bond Fund                                   |                                                         | Euro Long Average Duration Fund                         |                                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| (Angaben in Tausend)                                                                                               |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |                                                         |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | € 506.513                                               | € 537.186                                               | € 1.676.869                                             | € 1.387.227                                             | € 1.188.893                                             | € 923.969                                               |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 104.750                                                 | 47.495                                                  | 345.441                                                 | 244.798                                                 | 98.630                                                  | 326.914                                                 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 0                                                       | 0                                                       | 19                                                      | 8                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (129.728)                                               | (68.698)                                                | (184.889)                                               | (157.742)                                               | (24.367)                                                | (11.098)                                                |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 8.431                                                   | (1.222)                                                 | 35.745                                                  | 1.322                                                   | (50.599)                                                | (82.477)                                                |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | € 489.966                                               | € 514.761                                               | € 1.873.185                                             | € 1.475.613                                             | € 1.212.557                                             | € 1.157.308                                             |
|                                                                                                                    | Global Bond Fund                                        |                                                         | Global Bond ESG Fund                                    |                                                         | Global Bond Ex-US Fund                                  |                                                         |
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 15.803.937                                           | \$ 13.077.262                                           | \$ 3.964.473                                            | \$ 3.561.180                                            | \$ 1.096.286                                            | \$ 800.126                                              |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 2.715.448                                               | 4.182.289                                               | 631.272                                                 | 824.189                                                 | 237.661                                                 | 199.931                                                 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 3.438                                                   | 2.819                                                   | 8.003                                                   | 6.611                                                   | 937                                                     | 737                                                     |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (2.776.942)                                             | (1.777.721)                                             | (1.025.945)                                             | (366.321)                                               | (413.942)                                               | (123.419)                                               |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 1.193.427                                               | (141.590)                                               | 502.535                                                 | (132.835)                                               | 23.463                                                  | 6.921                                                   |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 16.939.308                                           | \$ 15.343.059                                           | \$ 4.080.338                                            | \$ 3.892.824                                            | \$ 944.405                                              | \$ 884.296                                              |
|                                                                                                                    | Global Low Duration Real Return Fund                    |                                                         | Global Real Return Fund                                 |                                                         | Income Fund                                             |                                                         |
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 1.216.904                                            | \$ 1.177.052                                            | \$ 2.090.147                                            | \$ 2.381.093                                            | \$ 89.286.860                                           | \$ 70.543.117                                           |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 483.761                                                 | 34.476                                                  | 158.813                                                 | 208.918                                                 | 16.850.266                                              | 17.869.038                                              |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 0                                                       | 1                                                       | 836                                                     | 1.675                                                   | 130.825                                                 | 96.671                                                  |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (212.107)                                               | (189.071)                                               | (555.494)                                               | (360.788)                                               | (13.832.025)                                            | (8.495.910)                                             |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 174.869                                                 | (14.471)                                                | 209.667                                                 | (67.112)                                                | 6.587.294                                               | (1.179.762)                                             |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 1.663.427                                            | \$ 1.007.987                                            | \$ 1.903.969                                            | \$ 2.163.786                                            | \$ 99.023.220                                           | \$ 78.833.154                                           |

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

| Euro Short-Term Fund                                    |                                                         | PIMCO European High Yield Bond Fund                     |                                                            | PIMCO European Short-Term Opportunities Fund            |                                                         | Global Advantage Fund                                   |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| € 265.893                                               | € 193.514                                               | € 383.525                                               | € 367.767                                                  | € 955.095                                               | € 130.610                                               | \$ 404.337                                              | \$ 432.290                                              |
| 157.758                                                 | 75.099                                                  | 102.308                                                 | 28.137                                                     | 151.195                                                 | 842.813                                                 | 24.963                                                  | 5.198                                                   |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                          | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| (68.803)                                                | (65.469)                                                | (32.651)                                                | (61.954)                                                   | (102.969)                                               | (37.013)                                                | (42.531)                                                | (1.410)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                          | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 3.896                                                   | 4.564                                                   | 14.351                                                  | 8.033                                                      | 24.823                                                  | 5.697                                                   | 54.115                                                  | (14.933)                                                |
| € 358.744                                               | € 207.708                                               | € 467.533                                               | € 341.983                                                  | € 1.028.144                                             | € 942.107                                               | \$ 440.884                                              | \$ 421.145                                              |
| Global High Yield Bond Fund                             |                                                         | Global High Yield Bond ESG Fund                         |                                                            | Global Investment Grade Credit Fund                     |                                                         | Global Investment Grade Credit ESG Fund                 |                                                         |
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom<br>17. Juni 2024 bis 30.<br>Juni 2024 | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 2.868.819                                            | \$ 2.980.250                                            | \$ 10.456                                               | \$ 0                                                       | \$ 8.618.950                                            | \$ 10.713.722                                           | \$ 2.115.617                                            | \$ 2.170.207                                            |
| 469.063                                                 | 551.142                                                 | 16                                                      | 9.752                                                      | 838.039                                                 | 1.267.841                                               | 585.086                                                 | 357.317                                                 |
| 3.144                                                   | 2.021                                                   | 1                                                       | 0                                                          | 1.934                                                   | 1.786                                                   | 3                                                       | 26                                                      |
| (693.079)                                               | (528.635)                                               | 0                                                       | 0                                                          | (1.804.018)                                             | (2.684.286)                                             | (517.632)                                               | (230.070)                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                          | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 247.312                                                 | 1.191                                                   | 491                                                     | 26                                                         | 671.793                                                 | (169.750)                                               | 361.840                                                 | (80.019)                                                |
| \$ 2.895.259                                            | \$ 3.005.969                                            | \$ 10.964                                               | \$ 9.778                                                   | \$ 8.326.698                                            | \$ 9.129.313                                            | \$ 2.544.914                                            | \$ 2.217.461                                            |
| Income Fund II                                          |                                                         | Inflation Multi-Asset Fund                              |                                                            | Low Average Duration Fund                               |                                                         | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund        |                                                         |
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 273.663                                              | \$ 125.160                                              | \$ 178.901                                              | \$ 253.248                                                 | \$ 676.383                                              | \$ 809.845                                              | \$ 1.084.966                                            | \$ 972.843                                              |
| 156.882                                                 | 193.217                                                 | 13.512                                                  | 8.759                                                      | 267.068                                                 | 85.604                                                  | 200.828                                                 | 107.723                                                 |
| 1                                                       | 27                                                      | 13                                                      | 72                                                         | 342                                                     | 317                                                     | 0                                                       | 313                                                     |
| (112.266)                                               | (71.064)                                                | (21.209)                                                | (55.016)                                                   | (156.042)                                               | (160.490)                                               | (147.772)                                               | (151.676)                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                          | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 13.590                                                  | (8.596)                                                 | 17.277                                                  | 1.290                                                      | 31.299                                                  | 9.132                                                   | 121.248                                                 | (10.162)                                                |
| \$ 331.870                                              | \$ 238.744                                              | \$ 188.494                                              | \$ 208.353                                                 | \$ 819.050                                              | \$ 744.408                                              | \$ 1.259.270                                            | \$ 919.041                                              |

## Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

| (Angaben in Tausend)                                                                                               | Low Duration<br>Income Fund                             |                                                         | Low Duration<br>Opportunities Fund                      |                                                         | Low Duration<br>Opportunities ESG Fund                  |                                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 2.925.246                                            | \$ 2.030.305                                            | \$ 843.935                                              | \$ 787.624                                              | \$ 5.437                                                | \$ 5.221                                                |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 01.022.244                                              | 418.268                                                 | 10.666                                                  | 7.705                                                   | 0                                                       | 0                                                       |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 172                                                     | 50                                                      | 1.790                                                   | 1.215                                                   | 0                                                       | 1                                                       |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (1.151.867)                                             | (159.531)                                               | (138.330)                                               | (76.281)                                                | 0                                                       | 0                                                       |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 296.573                                                 | 7.346                                                   | 87.002                                                  | 9.805                                                   | 267                                                     | 90                                                      |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 3.092.368                                            | \$ 2.296.438                                            | \$ 805.063                                              | \$ 730.068                                              | \$ 5.704                                                | \$ 5.312                                                |

  

|                                                                                                                    | Strategic<br>Income Fund                                |                                                         | Total Return<br>Bond Fund                               |                                                         | PIMCO TRENDS Managed<br>Futures Strategy Fund           |                                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 2.318.366                                            | \$ 449.949                                              | \$ 4.003.163                                            | \$ 4.420.051                                            | \$ 219.485                                              | \$ 240.346                                              |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 438.658                                                 | 52.703                                                  | 739.693                                                 | 489.293                                                 | 41.398                                                  | 31.019                                                  |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 32                                                      | 10                                                      | 6.467                                                   | 6.618                                                   | 219                                                     | 5                                                       |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (681.725)                                               | (49.425)                                                | (915.720)                                               | (738.585)                                               | (144.954)                                               | (42.571)                                                |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 366.650                                                 | (363)                                                   | 291.614                                                 | (50.674)                                                | (13.088)                                                | (5.000)                                                 |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 2.441.981                                            | \$ 452.874                                              | \$ 4.125.217                                            | \$ 4.126.703                                            | \$ 103.060                                              | \$ 223.799                                              |

  

|                                                                                                                    | US Short-Term Fund                                      |                                                         | Summe der Gesellschaft*                                 |                                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
|                                                                                                                    | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| <b>Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums</b>                                                               | \$ 2.330.264                                            | \$ 1.854.206                                            | \$ 190.413.110                                          | \$ 165.102.555                                          |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen                                                                                   | 584.239                                                 | 349.961                                                 | 39.133.621                                              | 37.086.911                                              |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen                                                                        | 16.276                                                  | 16.999                                                  | 198.996                                                 | 159.888                                                 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile                                                                              | (425.911)                                               | (262.569)                                               | (36.083.932)                                            | (24.340.921)                                            |
| Nominalwechselkursanpassungen                                                                                      | 0                                                       | 0                                                       | 979.293                                                 | (282.036)                                               |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 55.368                                                  | 37.622                                                  | 15.341.545                                              | (1.320.758)                                             |
| <b>Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums</b>                                                                | \$ 2.560.236                                            | \$ 1.996.219                                            | \$ 209.982.633                                          | \$ 176.405.639                                          |

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

\* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund                  |                                                         | Mortgage Opportunities Fund                             |                                                         | StocksPLUS™ Fund                                        |                                                         | PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                               |                                                         |
|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| \$ 157.071                                              | \$ 98.493                                               | \$ 1.791.316                                            | \$ 925.256                                              | \$ 5.022.355                                            | \$ 1.962.988                                            | \$ 10.118                                               | \$ 11.175                                               |
| 62.486                                                  | 13.281                                                  | 587.167                                                 | 360.999                                                 | 1.641.527                                               | 1.769.769                                               | 494                                                     | 553                                                     |
| 22                                                      | 2                                                       | 444                                                     | 432                                                     | 830                                                     | 794                                                     | 0                                                       | 0                                                       |
| (59.544)                                                | (15.113)                                                | (285.817)                                               | (84.444)                                                | (1.651.627)                                             | (407.848)                                               | (821)                                                   | (1.207)                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 14.982                                                  | 15.815                                                  | 181.441                                                 | 14.064                                                  | 310.759                                                 | 314.828                                                 | 671                                                     | 1.602                                                   |
| \$ 175.017                                              | \$ 112.478                                              | \$ 2.274.551                                            | \$ 1.216.307                                            | \$ 5.323.844                                            | \$ 3.640.531                                            | \$ 10.462                                               | \$ 12.123                                               |
| UK Corporate Bond Fund                                  |                                                         | UK Long Term Corporate Bond Fund                        |                                                         | US High Yield Bond Fund                                 |                                                         | US Investment Grade Corporate Bond Fund                 |                                                         |
| Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
| £ 213.133                                               | £ 361.061                                               | £ 114.440                                               | £ 324.768                                               | \$ 1.714.223                                            | \$ 1.872.887                                            | \$ 493.892                                              | \$ 480.861                                              |
| 15.782                                                  | 17.754                                                  | 1.414                                                   | 19.635                                                  | 241.167                                                 | 237.976                                                 | 70.478                                                  | 122.851                                                 |
| 0                                                       | 0                                                       | 1                                                       | 1                                                       | 853                                                     | 1.372                                                   | 64                                                      | 33                                                      |
| (21.488)                                                | (129.862)                                               | (83.234)                                                | (2.105)                                                 | (411.811)                                               | (389.253)                                               | (128.345)                                               | (105.430)                                               |
| 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       | 0                                                       |
| 3.487                                                   | (5.294)                                                 | 1.227                                                   | (10.712)                                                | 102.054                                                 | 24.322                                                  | 38.918                                                  | (4.427)                                                 |
| £ 210.914                                               | £ 243.659                                               | £ 33.848                                                | £ 331.587                                               | \$ 1.646.486                                            | \$ 1.747.304                                            | \$ 475.007                                              | \$ 493.888                                              |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>                              |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| Emeco Pty. Ltd.                                |                |                          |                                   | PCPD Capital Ltd.                                        |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 10.07.2026                   | AUD 10.110     | \$ 6.563                 | 0,45                              | 5,125 % fällig am 18.06.2026                             | \$ 8.884       | \$ 8.394                 | 0,57                              | 08.02.2026 (f)(i)                       | \$ 700         | \$ 698                   | 0,05                              |
| Perenti Finance Pty. Ltd.                      |                |                          |                                   | Shui On Development Holding Ltd.                         |                |                          |                                   | GLP China Holdings Ltd.                 |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 07.10.2025                   | \$ 1.441       | 1.441                    | 0,10                              | 5,500 % fällig am 29.06.2026                             | 4.900          | 4.780                    | 0,33                              | 2,950 % fällig am 29.03.2026            | 10.650         | 10.062                   | 0,68                              |
| Summe Australien                               |                | 8.004                    | 0,55                              | Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK) | 4.052          | 507                      | 0,03                              | Lai Sun MTN Ltd.                        |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 30.09.2027 ^ (b)                       | 6.253          | 782                      | 0,05                              | 5,000 % fällig am 28.07.2026            | 11.350         | 6.377                    | 0,43                              |
| <b>BERMUDA</b>                                 |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK) |                |                          |                                   | Pingan Real Estate Capital Ltd.         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 30.09.2027 ^ (b)                       | 6.253          | 782                      | 0,05                              | 3,450 % fällig am 29.07.2026            | 1.700          | 1.645                    | 0,11                              |
| Li & Fung Ltd.                                 |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) |                |                          |                                   | Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.    |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 03.11.2025 (f)               | 8.600          | 4.112                    | 0,28                              | 6,000 % fällig am 30.09.2029 ^ (b)                       | 7.204          | 901                      | 0,06                              | 3,500 % fällig am 12.11.2029            | 3.400          | 2.474                    | 0,17                              |
|                                                |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK) |                |                          |                                   | 3,975 % fällig am 09.11.2027            | 11.500         | 9.415                    | 0,64                              |
| <b>KANADA</b>                                  |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 30.09.2030 ^ (b)                       | 1.470          | 181                      | 0,01                              | Yanlord Land HK Co. Ltd.                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | UPL Corp. Ltd.                                           |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 20.05.2026            | 9.599          | 9.385                    | 0,64                              |
| Ivanhoe Mines Ltd.                             |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 16.06.2030                             | 5.700          | 5.178                    | 0,35                              | Summe Hongkong                          |                | 108.087                  | 7,36                              |
| 7,875 % fällig am 23.01.2030                   | 1.300          | 1.299                    | 0,09                              | VLL International, Inc.                                  |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | 9,375 % fällig am 29.07.2029                             | 2.100          | 1.417                    | 0,10                              | <b>INDIEN</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>KAIMANINSELN</b>                            |                |                          |                                   | Wynn Macau Ltd.                                          |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 15.12.2029                             | 1.851          | 1.780                    | 0,12                              | Adani Green Energy UP Ltd.              |                |                          |                                   |
| Grab Holdings Ltd.                             |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.01.2026                             | 12.544         | 12.558                   | 0,86                              | 6,700 % fällig am 12.03.2042 (j)        | 9.534          | 8.893                    | 0,61                              |
| 0,000 % fällig am 15.06.2030                   |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.10.2027                             | 7.213          | 7.200                    | 0,49                              | Adani Renewable Energy RJ Ltd.          |                |                          |                                   |
| (c)(i)                                         | 6.000          | 6.429                    | 0,44                              | 5,625 % fällig am 26.08.2028                             | 17.730         | 17.441                   | 1,19                              | 4,625 % fällig am 15.10.2039            | 7.098          | 5.725                    | 0,39                              |
| JD.com, Inc.                                   |                |                          |                                   | Summe Kaimaninseln                                       |                | 203.215                  | 13,84                             | Axis Bank Ltd.                          |                |                          |                                   |
| 0,250 % fällig am 01.06.2029                   | 2.900          | 3.032                    | 0,21                              |                                                          |                | 228.727                  | 15,58                             | 4,100 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| PDD Holdings, Inc.                             |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 08.09.2026 (f)(h)                       | 3.800          | 3.698                    | 0,25                              |
| 0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)               | 9.000          | 8.775                    | 0,60                              |                                                          |                |                          |                                   | Continuum Green Energy India Pvt        |                |                          |                                   |
| Wynn Macau Ltd.                                |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 26.06.2033            | 7.041          | 7.251                    | 0,49                              |
| 4,500 % fällig am 07.03.2029                   | 7.300          | 7.276                    | 0,49                              |                                                          |                |                          |                                   | Delhi International Airport Ltd.        |                |                          |                                   |
|                                                |                | 25.512                   | 1,74                              |                                                          |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 31.10.2026            | 2.000          | 2.016                    | 0,14                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | HDFC Bank Ltd.                          |                |                          |                                   |
| China Hongqiao Group Ltd.                      |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 3,700 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 6,925 % fällig am 29.11.2028                   | 5.100          | 5.174                    | 0,35                              |                                                          |                |                          |                                   | 25.08.2026 (f)(h)                       | 7.768          | 7.535                    | 0,51                              |
| 7,050 % fällig am 10.01.2028                   | 4.800          | 4.918                    | 0,34                              |                                                          |                |                          |                                   | IIFL Finance Ltd.                       |                |                          |                                   |
| Country Garden Holdings Co. Ltd.               |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 8,750 % fällig am 24.07.2028            | 11.900         | 11.981                   | 0,82                              |
| 3,875 % fällig am 22.10.2030 ^                 | 7.717          | 602                      | 0,04                              |                                                          |                |                          |                                   | IRB Infrastructure Developers Ltd.      |                |                          |                                   |
| 4,200 % fällig am 06.02.2026 ^                 | 4.100          | 329                      | 0,02                              |                                                          |                |                          |                                   | 7,110 % fällig am 11.03.2032            | 16.800         | 16.863                   | 1,15                              |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 ^                 | 300            | 23                       | 0,00                              |                                                          |                |                          |                                   | JSW Hydro Energy Ltd.                   |                |                          |                                   |
| eHi Car Services Ltd.                          |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 18.05.2031            | 9.905          | 9.125                    | 0,62                              |
| 11,000 % fällig am 26.09.2027                  | 9.664          | 6.354                    | 0,43                              |                                                          |                |                          |                                   | JSW Steel Ltd.                          |                |                          |                                   |
| FWD Group Holdings Ltd.                        |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 05.04.2027            | 2.000          | 1.937                    | 0,13                              |
| 7,635 % fällig am 02.07.2031                   | 3.300          | 3.620                    | 0,25                              |                                                          |                |                          |                                   | Manappuram Finance Ltd.                 |                |                          |                                   |
| 8,045 % fällig am 15.12.2025 (f)               | 4.000          | 4.020                    | 0,27                              |                                                          |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 12.05.2028            | 7.400          | 7.502                    | 0,51                              |
| 8,400 % fällig am 05.04.2029                   | 18.400         | 18.894                   | 1,29                              |                                                          |                |                          |                                   | Muthoot Finance Ltd.                    |                |                          |                                   |
| Greentown China Holdings Ltd.                  |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 23.04.2029            | 12.000         | 11.980                   | 0,82                              |
| 8,450 % fällig am 24.02.2028                   | 9.100          | 9.295                    | 0,63                              |                                                          |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 14.02.2028            | 10.990         | 11.197                   | 0,76                              |
| Health & Happiness International Holdings Ltd. |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Network i2i Ltd.                        |                |                          |                                   |
| 9,125 % fällig am 24.07.2028                   | 10.800         | 11.030                   | 0,75                              |                                                          |                |                          |                                   | 3,975 % fällig am 03.03.2026 (f)        | 4.400          | 4.356                    | 0,30                              |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                      |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Periama Holdings LLC                    |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 30.06.2022 ^                 | 5.600          | 252                      | 0,02                              |                                                          |                |                          |                                   | 5,950 % fällig am 19.04.2026            | 12.500         | 12.504                   | 0,85                              |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^                 | 2.250          | 101                      | 0,01                              |                                                          |                |                          |                                   | Piramal Finance Ltd.                    |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^                 | 13.200         | 594                      | 0,04                              |                                                          |                |                          |                                   | 7,800 % fällig am 29.01.2028            | 12.200         | 12.274                   | 0,84                              |
| 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^                | 3.300          | 148                      | 0,01                              |                                                          |                |                          |                                   | ReNew Wind Energy AP2                   |                |                          |                                   |
| 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^                | 9.800          | 441                      | 0,03                              |                                                          |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 14.07.2028            | 15.988         | 15.185                   | 1,03                              |
| 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^                | 6.700          | 301                      | 0,02                              |                                                          |                |                          |                                   | SAEL Ltd.                               |                |                          |                                   |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^                | 1.450          | 65                       | 0,00                              |                                                          |                |                          |                                   | 7,800 % fällig am 31.07.2031            | 8.159          | 7.956                    | 0,54                              |
| 11,950 % fällig am 22.10.2022 ^                | 800            | 36                       | 0,00                              |                                                          |                |                          |                                   | Sammaan Capital Ltd.                    |                |                          |                                   |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^                | 12.100         | 544                      | 0,04                              |                                                          |                |                          |                                   | 9,700 % fällig am 03.07.2027            | 7.400          | 7.492                    | 0,51                              |
| Longfor Group Holdings Ltd.                    |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Shriram Finance Ltd.                    |                |                          |                                   |
| 3,850 % fällig am 13.01.2032                   | 3.000          | 2.196                    | 0,15                              |                                                          |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 22.04.2027            | 8.800          | 8.907                    | 0,61                              |
| 3,950 % fällig am 16.09.2029                   | 11.200         | 9.106                    | 0,62                              |                                                          |                |                          |                                   | Summe Indien                            |                | 174.377                  | 11,88                             |
| 4,500 % fällig am 16.01.2028                   | 3.000          | 2.692                    | 0,18                              |                                                          |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| Melco Resorts Finance Ltd.                     |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | <b>INDONESIEN</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026                   | 3.524          | 3.521                    | 0,24                              |                                                          |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 04.12.2029                   | 10.800         | 10.140                   | 0,69                              |                                                          |                |                          |                                   | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT    |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 17.07.2027                   | 8.750          | 8.740                    | 0,60                              |                                                          |                |                          |                                   | 4,300 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 21.07.2028                   | 14.977         | 14.670                   | 1,00                              |                                                          |                |                          |                                   | 24.03.2027 (f)(h)                       | 12.700         | 12.138                   | 0,83                              |
| MGM China Holdings Ltd.                        |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT          |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 01.02.2027                   | 19.155         | 19.023                   | 1,30                              |                                                          |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 23.03.2026            | 6.100          | 6.056                    | 0,41                              |
| New Metro Global Ltd.                          |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | LLPL Capital Pte. Ltd.                  |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 02.05.2026                   | 2.400          | 2.238                    | 0,15                              |                                                          |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 04.02.2039            | 1.818          | 1.855                    | 0,13                              |
| New World China Land Ltd.                      |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Pakuwon Jati Tbk PT                     |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 23.01.2027                   | 4.200          | 3.029                    | 0,21                              |                                                          |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 29.04.2028            | 3.300          | 3.217                    | 0,22                              |
|                                                |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Pertamina Hulu Energi PT                |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 21.05.2030            | 7.200          | 7.277                    | 0,49                              |
|                                                |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Sorik Marapi Geothermal Power PT        |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am 05.08.2031            | 197            | 199                      | 0,01                              |
|                                                |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   | Summe Indonesien                        |                | 30.742                   | 2,09                              |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>JAPAN</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Nomura Holdings, Inc.                   |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 15.07.2030 (a)(f)(h)                    | \$ 3.400       | \$ 3.447                 | 0,23                              |
| Rakuten Group, Inc.                     |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 22.04.2027 (f)                          | € 4.700        | 5.223                    | 0,36                              |
| 5,125 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 22.04.2026 (f)                          | \$ 4.700       | 4.622                    | 0,32                              |
| Summe Japan                             |                | 13.292                   | 0,91                              |

|                                                |       |       |      |
|------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                     |       |       |      |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>            |       |       |      |
| Goldman Sachs Finance Corp. International Ltd. |       |       |      |
| 0,000 % fällig am                              |       |       |      |
| 04.04.2028 (c)                                 | 7.000 | 7.411 | 0,50 |

|                                         |       |        |      |
|-----------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |        |      |
| West China Cement Ltd.                  |       |        |      |
| 4,950 % fällig am 08.07.2026            | 4.625 | 4.040  | 0,28 |
| Summe Jersey, Kanalinseln               |       | 11.451 | 0,78 |

|                                         |       |       |      |
|-----------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>LUXEMBURG</b>                        |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |       |      |
| Raizen Fuels Finance S.A.               |       |       |      |
| 6,250 % fällig am 08.07.2032 (a)        | 3.600 | 3.577 | 0,24 |

|                                         |       |       |      |
|-----------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>MARSHALLINSELN</b>                   |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |       |      |
| Seaspan Corp.                           |       |       |      |
| 5,500 % fällig am 01.08.2029            | 8.500 | 8.088 | 0,55 |

|                                     |       |       |      |
|-------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>MAURITIUS</b>                    |       |       |      |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b> |       |       |      |
| MakeMyTrip Ltd.                     |       |       |      |
| 0,000 % fällig am 01.07.2030 (c)    | 1.700 | 1.816 | 0,12 |

|                                           |        |        |      |
|-------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |        |        |      |
| CA Magnum Holdings                        |        |        |      |
| 5,375 % fällig am 31.10.2026              | 13.660 | 13.593 | 0,93 |
| Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. |        |        |      |
| 4,250 % fällig am 25.03.2027              | 3.502  | 3.400  | 0,23 |
| Greenko Dutch BV                          |        |        |      |
| 3,850 % fällig am 29.03.2026              | 16.329 | 16.048 | 1,09 |
| Greenko Power Ltd.                        |        |        |      |
| 4,300 % fällig am 13.12.2028              | 399    | 376    | 0,03 |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.      |        |        |      |
| 7,250 % fällig am 27.09.2028              | 12.600 | 12.712 | 0,87 |
| India Cleantech Energy                    |        |        |      |
| 4,700 % fällig am 10.08.2026              | 7.031  | 6.933  | 0,47 |
| India Green Power Holdings                |        |        |      |
| 4,000 % fällig am 22.02.2027              | 4.075  | 3.965  | 0,27 |
|                                           |        | 57.027 | 3,89 |
| Summe Mauritius                           |        | 58.843 | 4,01 |

|                                         |       |       |      |
|-----------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>MEXIKO</b>                           |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |       |      |
| BBVA Bancomer S.A.                      |       |       |      |
| 7,625 % fällig am 11.02.2035 (h)        | 2.200 | 2.264 | 0,15 |
| Trust Fibra Uno                         |       |       |      |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030            | 1.800 | 1.711 | 0,12 |
| 7,700 % fällig am 23.01.2032            | 1.700 | 1.774 | 0,12 |
| Summe Mexiko                            |       | 5.749 | 0,39 |

|                                        |        |        |      |
|----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>MONGOLEI</b>                        |        |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |        |        |      |
| City of Ulaanbaatar Mongolia           |        |        |      |
| 7,750 % fällig am 21.08.2027           | 15.100 | 15.168 | 1,03 |
| Mongolia Government International Bond |        |        |      |
| 4,450 % fällig am 07.07.2031           | 2.800  | 2.444  | 0,17 |
| 6,625 % fällig am 25.02.2030 (j)       | 4.600  | 4.527  | 0,31 |
| 7,875 % fällig am 05.06.2029 (j)       | 4.400  | 4.591  | 0,31 |
| 8,650 % fällig am 19.01.2028           | 4.621  | 4.855  | 0,33 |
| Summe Mongolei                         |        | 31.585 | 2,15 |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>NIEDERLANDE</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| ING Groep NV                            |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 16.05.2030 (f)(h)                       | \$ 4.000       | \$ 4.258                 | 0,29                              |
| Mong Duong Finance Holdings BV          |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 07.05.2029            | 12.169         | 11.898                   | 0,81                              |
| VEON Holdings BV                        |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 25.11.2027            | 6.415          | 5.931                    | 0,40                              |
| Yinson Bergenia Production BV           |                |                          |                                   |
| 8,498 % fällig am 31.01.2045 (a)        | 6.500          | 6.587                    | 0,45                              |
|                                         |                | 28.674                   | 1,95                              |

|                                           |       |        |      |
|-------------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |       |        |      |
| Veon Amsterdam                            |       |        |      |
| 8,531 % - 10,750 % fällig am              |       |        |      |
| 25.03.2027                                | 6.400 | 6.402  | 0,44 |
| Summe Niederlande                         |       | 35.076 | 2,39 |

|                                              |        |        |      |
|----------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>PAKISTAN</b>                              |        |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |        |        |      |
| Pakistan Global Sukuk Programme Co. Ltd.     |        |        |      |
| 7,950 % fällig am 31.01.2029                 | 4.206  | 4.080  | 0,28 |
| Pakistan Government International Bond       |        |        |      |
| 6,000 % fällig am 08.04.2026                 | 17.271 | 17.027 | 1,16 |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027                 | 22.457 | 21.255 | 1,45 |
| 7,375 % fällig am 08.04.2031 (j)             | 13.900 | 12.383 | 0,84 |
| 7,875 % fällig am 31.03.2036                 | 6.400  | 5.214  | 0,35 |
| 8,875 % fällig am 08.04.2051 (j)             | 10.500 | 8.633  | 0,59 |
| Pakistan Water & Power Development Authority |        |        |      |
| 7,500 % fällig am 04.06.2031                 | 5.600  | 4.510  | 0,31 |
| Summe Pakistan                               |        | 73.102 | 4,98 |

|                                         |        |        |      |
|-----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>PHILIPPINEN</b>                      |        |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |        |      |
| Petron Corp.                            |        |        |      |
| 5,950 % fällig am 19.04.2026 (f)        | 5.160  | 5.118  | 0,35 |
| San Miguel Corp.                        |        |        |      |
| 5,500 % fällig am 29.07.2025 (f)        | 15.950 | 15.935 | 1,09 |
| San Miguel Global Power Holdings Corp.  |        |        |      |
| 5,450 % fällig am 09.12.2026 (f)        | 1.375  | 1.341  | 0,09 |
| 5,700 % fällig am 21.01.2026 (f)        | 2.294  | 2.274  | 0,15 |
| 8,125 % fällig am 02.12.2029 (f)        | 17.044 | 16.870 | 1,15 |
| 8,750 % fällig am 12.06.2029 (f)        | 10.700 | 10.762 | 0,73 |
|                                         |        | 52.300 | 3,56 |

| STAATSEMISSIONEN                          |          |   |        |      |
|-------------------------------------------|----------|---|--------|------|
| Philippines Government International Bond |          |   |        |      |
| 6,250 % fällig am 28.02.2029              |          |   |        |      |
|                                           | 1.187,25 |   |        |      |
|                                           | PHP      | 0 | 21.419 | 1,46 |
| Summe Philippinen                         |          |   | 73.719 | 5,02 |

|                                               |          |        |      |
|-----------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>SINGAPUR</b>                               |          |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |          |        |      |
| Continuum Energy Aura Pte Ltd.                |          |        |      |
| 9,500 % fällig am 24.02.2027                  | \$ 3.500 | 3.618  | 0,25 |
| GLP Pte. Ltd.                                 |          |        |      |
| 4,500 % fällig am 17.05.2026 (f)              | 8.200    | 4.307  | 0,29 |
| 4,600 % fällig am 29.06.2027 (f)              | 7.000    | 3.451  | 0,24 |
| 9,750 % fällig am 20.05.2028                  | 3.300    | 3.168  | 0,22 |
| Medco Cypress Tree Pte Ltd.                   |          |        |      |
| 8,625 % fällig am 19.05.2030                  | 5.800    | 5.944  | 0,40 |
| Medco Maple Tree Pte Ltd.                     |          |        |      |
| 8,960 % fällig am 27.04.2029                  | 7.500    | 7.830  | 0,53 |
| Yinson Production Financial Services Pte Ltd. |          |        |      |
| 9,625 % fällig am 03.05.2029                  | 7.400    | 7.693  | 0,52 |
| Summe Singapur                                |          | 36.011 | 2,45 |

|                                     |       |       |      |
|-------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>SÜDAFRIKA</b>                    |       |       |      |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b> |       |       |      |
| Sasol Financing USA LLC             |       |       |      |
| 4,500 % fällig am 08.11.2027        | 5.800 | 5.343 | 0,36 |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SÜDKOREA</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>     |                |                          |                                   |
| LG Chem Ltd.                            |                |                          |                                   |
| 1,250 % fällig am 18.07.2028            | \$ 6.400       | \$ 6.667                 | 0,45                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Hanwha Life Insurance Co. Ltd.          |                |                          |                                   |
| 6,300 % fällig am 24.06.2055            | 3.600          | 3.712                    | 0,26                              |
| LG Energy Solution Ltd.                 |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 02.04.2035            | 6.800          | 6.781                    | 0,46                              |
|                                         |                | 10.493                   | 0,72                              |
| Summe Südkorea                          |                | 17.160                   | 1,17                              |

|                                         |       |       |      |
|-----------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>SPANIEN</b>                          |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |       |      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.    |       |       |      |
| 7,750 % fällig am                       |       |       |      |
| 14.01.2032 (f)(h)                       | 6.900 | 7.012 | 0,48 |

|                                         |        |        |      |
|-----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>SRI LANKA</b>                        |        |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |        |        |      |
| Sri Lanka Government International Bond |        |        |      |
| 3,100 % fällig am 15.01.2030            | 8.658  | 7.738  | 0,53 |
| 3,350 % fällig am 15.03.2033            | 24.577 | 19.899 | 1,35 |
| 3,600 % fällig am 15.06.2035            | 19.131 | 13.170 | 0,90 |
| 3,600 % fällig am 15.05.2036            | 10.243 | 8.361  | 0,57 |
| 3,600 % fällig am 15.02.2038            | 23.799 | 19.380 | 1,32 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2028            | 15.437 | 14.530 | 0,99 |
| Summe Sri Lanka                         |        | 83.078 | 5,66 |

|                                         |        |        |      |
|-----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>THAILAND</b>                         |        |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |        |      |
| Bangkok Bank PCL                        |        |        |      |
| 5,000 % fällig am                       |        |        |      |
| 23.09.2025 (f)(h)                       | 21.400 | 21.345 | 1,45 |
| Kasikornbank PCL                        |        |        |      |
| 5,275 % fällig am                       |        |        |      |
| 14.10.2025 (f)(h)                       | 22.757 | 22.742 | 1,55 |
| Krung Thai Bank PCL                     |        |        |      |
| 4,400 % fällig am                       |        |        |      |
| 25.03.2026 (f)(h)                       | 2.300  | 2.266  | 0,16 |
| Summe Thailand                          |        | 46.353 | 3,16 |

|                                         |          |         |       |
|-----------------------------------------|----------|---------|-------|
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                  |          |         |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |         |       |
| Azule Energy Finance PLC                |          |         |       |
| 8,125 % fällig am 23.01.2030            | 1.300    | 1.289   | 0,09  |
| Biocon Biologics Global PLC             |          |         |       |
| 6,670 % fällig am 09.10.2029            | 4.200    | 3.992   | 0,27  |
| Diamond Ltd.                            |          |         |       |
| 7,950 % fällig am 28.07.2026            | 5.700    | 5.751   | 0,39  |
| HSBC Holdings PLC                       |          |         |       |
| 6,875 % fällig am 11.09.2029            | 7.700    | 7.811   | 0,53  |
| (f)(h)                                  |          |         |       |
| Lloyds Banking Group PLC                |          |         |       |
| 7,875 % fällig am                       |          |         |       |
| 27.06.2029 (f)(h)                       | £ 4.600  | 6.535   | 0,45  |
| 8,000 % fällig am                       |          |         |       |
| 27.09.2029 (f)(h)                       | \$ 3.000 | 3.171   | 0,22  |
| NatWest Group PLC                       |          |         |       |
| 7,300 % fällig am                       |          |         |       |
| 19.11.2034 (f)(h)                       | 7.700    | 7.666   | 0,52  |
| Standard Chartered PLC                  |          |         |       |
| 7,625 % fällig am                       |          |         |       |
| 16.01.2032 (f)(h)                       | 6.360    | 6.481   | 0,44  |
| 7,750 % fällig am                       |          |         |       |
| 15.08.2027 (f)(h)(j)                    | 47.600   | 49.497  | 3,37  |
| 7,875 % fällig am                       |          |         |       |
| 08.03.2030 (f)(h)                       | 16.970   | 17.703  | 1,21  |
| Vedanta Resources Finance PLC           |          |         |       |
| 9,475 % fällig am 24.07.2030            | 10.500   | 10.418  | 0,71  |
| 9,850 % fällig am 24.04.2033            | 3.800    | 3.815   | 0,26  |
| 10,250 % fällig am 03.06.2028           | 2.800    | 2.913   | 0,20  |
| 10,875 % fällig am 17.09.2029           | 19.200   | 19.932  | 1,36  |
| 11,250 % fällig am 03.12.2031           | 5.200    | 5.459   | 0,37  |
| Summe Großbritannien                    |          | 152.433 | 10,39 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>USA</b>                              |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| Lendlease U.S. Capital, Inc.            |       |     |      |
| 4,500 % fällig am 26.05.2026            | 1.000 | 998 | 0,07 |

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

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>US-STAATSANLEIHEN</b>                         |                |                          |                                   | <b>US-STAATSANLEIHEN</b>                 |                |                          |                                   | <b>US-STAATSANLEIHEN</b>                  |                |                          |                                   |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e) |                |                          |                                   | 10,131 % fällig am<br>30.07.2025 (f)     | \$ 4.150       | \$ 1.594                 | 0,11                              | 4,281 % fällig am<br>10.07.2025 (c)(d)(k) | \$ 1.200       | \$ 1.199                 | 0,08                              |
| 0,125 % fällig am 15.01.2032                     | \$ 12.509      | \$ 11.342                | 0,77                              | NWD MTN Ltd.                             |                |                          |                                   | 4,305 % fällig am<br>10.07.2025 (c)(d)(k) | 50             | 50                       | 0,00                              |
| U.S. Treasury Notes                              |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 18.07.2029             | 11.091         | 5.745                    | 0,39                              | 4,344 % fällig am<br>11.09.2025 (c)(d)(k) | 6.500          | 6.445                    | 0,44                              |
| 4,500 % fällig am 31.12.2031                     | 11.900         | 12.273                   | 0,84                              | 4,500 % fällig am 19.05.2030             | 7.900          | 3.982                    | 0,27                              | 4,361 % fällig am<br>11.09.2025 (c)(d)(k) | 3.500          | 3.470                    | 0,24                              |
|                                                  |                | 23.615                   | 1,61                              | 8,625 % fällig am 08.02.2028             | 5.500          | 3.608                    | 0,25                              |                                           |                | 14.222                   | 0,97                              |
| Summe USA                                        |                | 24.613                   | 1,68                              | Peak RE BVI Holding Ltd.                 |                |                          |                                   | Summe kurzfristige Instrumente            |                | 16.355                   | 1,11                              |
| <b>VIETNAM</b>                                   |                |                          |                                   | 5,350 % fällig am 28.10.2025<br>(f)      | 3.200          | 3.185                    | 0,22                              |                                           |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   | RKPF Overseas Ltd.                       |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| Vietnam Debt & Asset Trading Corp.               |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 26.01.2030             | 2.604          | 659                      | 0,04                              |                                           |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 10.10.2025                     | 1.100          | 1.079                    | 0,07                              | 5,200 % fällig am 12.07.2029             | 3.655          | 903                      | 0,06                              |                                           |                |                          |                                   |
| Vietnam Government International Bond            |                |                          |                                   | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 12.03.2028                     | 840            | 806                      | 0,06                              | 6,750 % fällig am 24.04.2033             | 3.217          | 3.279                    | 0,22                              |                                           |                |                          |                                   |
| Summe Vietnam                                    |                | 1.885                    | 0,13                              | Studio City Finance Ltd.                 |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| <b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>                 |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.01.2029             | 15.800         | 14.509                   | 0,99                              |                                           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.01.2028             | 6.467          | 6.387                    | 0,43                              |                                           |                |                          |                                   |
| CAS Capital Ltd.                                 |                |                          |                                   | Summe Jungferninseln (Britisch)          |                | 80.343                   | 5,47                              |                                           |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 12.07.2026<br>(f)              | 11.400         | 11.279                   | 0,77                              |                                          |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| Celestial Dynasty Ltd.                           |                |                          |                                   | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>          |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 22.08.2028                     | 4.500          | 4.334                    | 0,30                              | <b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>          |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| Champion Path Holdings Ltd.                      |                |                          |                                   | SF Holding Investment Ltd.               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026                     | 8.900          | 8.844                    | 0,60                              | (0,251) % fällig am                      |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 4,850 % fällig am 27.01.2028                     | 2.000          | 1.928                    | 0,13                              | 08.07.2026 (a)(c)(d)                     | HKD 16.000     | 2.110                    | 0,14                              |                                           |                |                          |                                   |
| NWD Finance BVI Ltd.                             |                |                          |                                   | Yango Justice International Ltd.         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 10.03.2028 (f)                 | 14.855         | 4.046                    | 0,28                              | 10,250 % fällig am                       |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 4,800 % fällig am 30.07.2025 (f)                 | 5.000          | 1.251                    | 0,08                              | 15.09.2022 ^                             | \$ 4.500       | 23                       | 0,00                              |                                           |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 22.03.2026 (f)                 | 11.200         | 3.198                    | 0,22                              |                                          |                | 2.133                    | 0,14                              |                                           |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 07.09.2025 (f)                 | 6.200          | 1.612                    | 0,11                              | <b>U.S. TREASURY BILLS</b>               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | 4,246 % fällig am 26.12.2025             |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | (c)(d)                                   | 2.000          | 1.959                    | 0,13                              |                                           |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | 4,275 % fällig am                        |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | 10.07.2025 (c)(d)(k)                     | 1.100          | 1.099                    | 0,08                              |                                           |                |                          |                                   |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art  | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|------|-------------|----------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long | 09.2025     | 402                  | \$ 940                                          | 0,07                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |      |             |                      | \$ 940                                          | 0,07                    |

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

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

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

| Referenzeinheit                            | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|--------------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | (1,000) %                      | 20.12.2029       | \$ 6.300                  | \$ 47                                           | 0,01                    |

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

| Index/Tranchen                       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|--------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.IG-43 5-Year Index               | 1,000 %                        | 20.12.2029       | \$ 2.859                  | \$ 6                                            | 0,00                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index               | 1,000                          | 20.06.2030       | 9.000                     | 38                                              | 0,00                    |
| iTraxx Asia Ex-Japan 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 34.500                    | 138                                             | 0,01                    |
|                                      |                                |                  |                           | \$ 182                                          | 0,01                    |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 18.500   | \$ 274                                          | 0,02                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500           | 17.09.2035       | SGD 4.790  | (41)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750           | 15.12.2051       | \$ 13.500  | 43                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2032       | 56.400     | 220                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2035       | 16.000     | 99                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 5,100           | 18.09.2025       | 65.000     | (280)                                           | (0,02)                  |



**Zahlung/  
Erhalt****variabler****Zinssatz Variabler Zinssatzindex**

|                        |                       | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------|-----------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung <sup>(4)</sup> | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 1,500 %         | 17.09.2030       | CNY 124.190 | \$ (86)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>  | 3-Month HKD-HIBOR     | 2,750           | 17.09.2027       | HKD 291.500 | (147)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>  | 6-Month EUR-EURIBOR   | 2,250           | 17.09.2030       | € 8.800     | (45)                                            | 0,00                    |
|                        |                       |                 |                  |             | \$ 37                                           | 0,00                    |
|                        |                       |                 |                  |             | \$ 266                                          | 0,02                    |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

**OPTIONSKAUF****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                    | 0,650 %       | 20.08.2025    | 147.400                   | \$ 221 | \$ 63     | 0,00                    |

**VERKAUFSOPTIONEN****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900 %       | 20.08.2025    | 147.400                   | \$ (75) | \$ (24)   | 0,00                    |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert  | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|------------|------------------------------|
| BPS        | South Korea Government International Bond | (1,000) %                      | 20.12.2033            | \$ 9.300                  | \$ (451)                                     | \$ (5)                                          | \$ (456)   | (0,03)                       |
| BRC        | Honda Motor Co Ltd.                       | (1,000)                        | 20.12.2029            | ¥ 1.800.000               | (350)                                        | 124                                             | (226)      | (0,01)                       |
| CBK        | Toyota Motor Corp.                        | (1,000)                        | 20.12.2029            | 1.325.000                 | (380)                                        | 63                                              | (317)      | (0,02)                       |
| DUB        | Mercedes-Benz Group AG                    | (1,000)                        | 20.12.2029            | € 17.900                  | (333)                                        | (71)                                            | (404)      | (0,03)                       |
| GST        | Toyota Motor Corp.                        | (1,000)                        | 20.12.2034            | ¥ 1.656.100               | (882)                                        | 201                                             | (681)      | (0,05)                       |
| JPM        | South Korea Government International Bond | (1,000)                        | 20.06.2030            | \$ 18.300                 | (584)                                        | (38)                                            | (622)      | (0,04)                       |
|            | Toyota Motor Corp.                        | (1,000)                        | 20.12.2029            | ¥ 1.325.000               | (386)                                        | 69                                              | (317)      | (0,02)                       |
| MYC        | South Korea Government International Bond | (1,000)                        | 20.12.2034            | \$ 10.500                 | (503)                                        | (49)                                            | (552)      | (0,04)                       |
|            |                                           |                                |                       |                           | \$ (3.869)                                   | \$ 294                                          | \$ (3.575) | (0,24)                       |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsda-<br>tum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| BPS        | Indonesia Government International Bond   | 1,000 %                        | 20.06.2030            | \$ 1.800                  | \$ 6                                         | \$ 13                                           | \$ 19     | 0,00                         |
|            | Longfor Group Holdings Ltd.               | 1,000                          | 20.06.2026            | 5.600                     | (91)                                         | (152)                                           | (243)     | (0,02)                       |
| CBK        | Vietnam Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2027            | 9.100                     | (263)                                        | 366                                             | 103       | 0,01                         |
| DBL        | Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. | 1,000                          | 20.06.2028            | 6.900                     | (20)                                         | (2)                                             | (22)      | 0,00                         |
| GST        | Alibaba Group Holding Ltd.                | 1,000                          | 20.06.2029            | 11.900                    | 62                                           | 73                                              | 135       | 0,01                         |
|            | Indonesia Government International Bond   | 1,000                          | 20.06.2030            | 4.500                     | 14                                           | 33                                              | 47        | 0,00                         |
|            |                                           |                                |                       |                           | \$ (292)                                     | \$ 331                                          | \$ 39     | 0,00                         |

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



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

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

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | \$ 2.144                 | \$ 0                             | \$ (15)                            | \$ (15)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 142                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 13.834                   | 122                              | 0                                  | 122                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 11                     | CHF                      | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 233                    | €                        | 199                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 161                    | NZD                      | 267                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | \$ 13.842                | 0                                | (123)                              | (123)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CHF                    | 11                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 20.175                   | 0                                | (23)                               | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 199                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 267                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 15.320                   | 0                                | (565)                              | (565)                                                | (0,04)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 1.083.703                | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 24                       | CNY                              | 169                                | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | 203                    | IDR                      | 3.314.013                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 7.731                  | KRW                      | 10.460.627                       | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 814                    | SGD                      | 1.043                            | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 1.040                    | 814                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 2.443                    | 312                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PHP                    | 311.874                  | 5.594                            | 68                                 | 68                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 331                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 61.565                   | 1.894                            | 0                                  | (225)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.033                    | IDR                              | 16.878.407                         | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 11                     | THB                      | 368                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 256                    | TWD                      | 7.606                            | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 44.864                   | \$ 6.235                         | 0                                  | (52)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY                    | 605                      | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 54.558                   | 1.674                            | 0                                  | (223)                                                | (0,02)                  |
| BPS        | 08.2025          | \$                     | 1.093                    | INR                              | 95.028                             | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 199                    | TWD                      | 6.508                            | 27                                 | 27                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 5.602                    | \$ 1.609                         | 0                                  | (55)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 19.142                   | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.067                    | £                                | 784                                | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 798                    | ILS                      | 2.694                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 47                     | ¥                        | 6.714                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 7.292                  | MYR                      | 30.765                           | 21                                 | 21                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 586                    | PLN                      | 2.196                            | 21                                 | 21                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 300                    | TWD                      | 8.781                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 784                      | \$ 1.067                         | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 15                       | TRY                              | 605                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 62.521                   | \$ 8.721                         | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 5.242.588                | 3.820                            | 0                                  | (56)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | SEK                    | 6.145                    | 645                              | 2                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 17.325                   | 521                              | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 107.674                  | 3.349                            | 0                                  | (359)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.967                    | IDR                              | 64.601.198                         | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 4.917                    | \$ 684                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 345                      | 44                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 276.009                  | 8.566                            | 0                                  | (1.029)                                              | (0,07)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 15                       | CNY                              | 107                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 8.186                  | INR                      | 705.596                          | 26                                 | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 1.962                  | TWD                      | 64.582                           | 284                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 2.720                    | \$ 785                           | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 232                      | 180                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 17.937                   | € 15.462                         | 213                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 530                    | IDR                      | 8.672.655                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | 333                    | TWD                      | 9.890                            | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 15.428                   | \$ 17.937                        | 0                                  | (212)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 3.795                    | INR                              | 327.430                            | 15                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 21.296                   | \$ 13.740                        | 0                                  | (216)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF                    | 6.739                    | 8.184                            | 0                                  | (282)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | CNH                    | 7.858                    | 1.093                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 230                      | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 2.082.216                | 14.305                           | 0                                  | (110)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | SGD                    | 393                      | 306                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 8.419                    | CHF 6.740                        | 48                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 25.822                 | ¥                        | 3.704.387                        | 0                                  | (176)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | 697                    | SGD                      | 888                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 6.712                    | \$ 8.419                         | 0                                  | (49)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 4.417                    | 617                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 08.2025          | SGD                    | 886                      | 697                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.813                    | INR                              | 156.819                            | 11                                                   | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| GLM        | 08.2025          | \$                     | 14.305                   | ¥ 2.074.558                      | \$ 111                             | \$ 0                                                 | 0,01                    |        |
|            | 09.2025          |                        | 9.831                    | MXN 191.419                      | 220                                | 0                                                    | 0,02                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 940                      | IDR 15.323.688                   | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 71                       | MYR 299                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 286                      | SGD 365                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| IND        | 07.2025          |                        | 199                      | TWD 6.480                        | 24                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 364                      | \$ 286                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 650                      | SEK 6.153                        | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | SEK                    | 6.140                    | \$ 650                           | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | CNH                    | 14.887                   | 2.063                            | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |        |
| JPM        | 07.2025          | KRW                    | 204.343                  | 149                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | NZD                    | 267                      | 159                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | PHP                    | 490.520                  | 8.782                            | 90                                 | 0                                                    | 0,01                    |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 5.661                    | 4.407                            | 0                                  | (38)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | TWD                    | 63.587                   | 1.959                            | 0                                  | (230)                                                | (0,02)                  |        |
| MBC        | 07.2025          | \$                     | 6.282                    | PLN 23.592                       | 247                                | 0                                                    | 0,02                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 533                      | SGD 683                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | CNH                    | 18.572                   | \$ 2.580                         | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 681                      | 533                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | TWD                    | 48.902                   | 1.497                            | 0                                  | (203)                                                | (0,01)                  |        |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.222                    | INR 105.986                      | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | CAD                    | 16.446                   | \$ 11.974                        | 0                                  | (79)                                                 | (0,01)                  |        |
|            | 07.2025          | CHF                    | 10                       | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | CNH                    | 7.137                    | 990                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | HKD                    | 14.319                   | 1.830                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | ¥                      | 63.200                   | 435                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | PHP                    | 453.109                  | 8.115                            | 86                                 | 0                                                    | 0,01                    |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 18.661                   | 14.539                           | 0                                  | (112)                                                | (0,01)                  |        |
|            | 07.2025          | THB                    | 8.697                    | 263                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | TWD                    | 31.667                   | 972                              | 0                                  | (119)                                                | (0,01)                  |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 11.968                   | CAD 16.452                       | 89                                 | 0                                                    | 0,01                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 792                      | IDR 12.867.005                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 1.131                    | ¥ 162.493                        | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 4.504                    | PLN 16.866                       | 162                                | 0                                                    | 0,01                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 14.072                   | SGD 18.198                       | 216                                | 0                                                    | 0,01                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 634                      | TWD 20.060                       | 56                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | CAD                    | 16.424                   | \$ 11.968                        | 0                                  | (89)                                                 | (0,01)                  |        |
|            | 08.2025          | CNH                    | 11.481                   | 1.593                            | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 18.156                   | 14.072                           | 0                                  | (219)                                                | (0,01)                  |        |
|            | 08.2025          | TWD                    | 69.066                   | 2.141                            | 0                                  | (260)                                                | (0,02)                  |        |
|            | MYI              | 08.2025                | \$                       | 2.173                            | CNH 15.749                         | 34                                                   | 0                       | 0,00   |
| 07.2025    |                  | €                      | 199                      | \$ 233                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | ¥                      | 663.372                  | 4.549                            | 0                                  | (44)                                                 | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | NOK                    | 232                      | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | SGD                    | 163                      | 128                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | \$                     | 135                      | € 115                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | 164                      | £ 119                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | 579                      | ¥ 83.681                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | 1                        | SGD 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  | CNH                    | 4.502                    | \$ 629                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  | \$                     | 1.985                    | CNH 14.412                       | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  |                        | 4.549                    | ¥ 660.933                        | 44                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  |                        | 23                       | NOK 232                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | ILS                    | 41                       | \$ 12                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| SCX        |                  | 07.2025                | ¥                        | 823                              | 6                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD                    | 4.454                    | 153                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 8.735                    | CNY 62.558                       | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 4.374                    | IDR 71.265.576                   | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 2.810                    | SGD 3.625                        | 36                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 1.088                    | TWD 32.334                       | 25                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | CNH                    | 19.322                   | \$ 2.701                         | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | CNY                    | 62.390                   | 8.735                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 3.616                    | 2.810                            | 0                                  | (36)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | TWD                    | 18.088                   | 554                              | 0                                  | (74)                                                 | (0,01)                  |        |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.280                    | INR 109.862                      | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          |                        | 6                        | ¥ 820                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | ¥                      | 96.232                   | \$ 667                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | \$                     | 7                        | INR 633                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          |                        | 667                      | ¥ 95.879                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| SSB        | 08.2025          |                        | 1.930                    | TWD 63.230                       | 269                                | 0                                                    | 0,02                    |        |
|            | 07.2025          | £                      | 784                      | \$ 1.062                         | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 275                      | 216                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| UAG        | 07.2025          | ILS                    | 412                      | 115                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.381                    | 42                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 377                      | ¥ 54.601                         | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| WST        | 07.2025          |                        | 25                       | NOK 256                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 09.2025          | MXN                    | 228                      | \$ 12                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | ¥                      | 1.105.739                | 7.678                            | 23                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | \$                     | 7.678                    | ¥ 1.101.670                      | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |        |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$ 2.739                           | \$ (5.514)                                           | \$ (2.775)              | (0,19) |

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

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                 | \$                    | 521                           | \$ 0                            | \$ (5)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | AUD                   | 802                           | 5                               | 5                                              | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          |                     |                       | 23                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          |                     |                       | 731                           | 10                              | 10                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     |                       | 799                           | 9                               | 9                                              | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | AUD                 | \$                    | 521                           | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | AUD                   | 804                           | 8                               | 8                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 797                           | 1                               | 1                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | AUD                 | \$                    | 8                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 33                         | \$ (6)                          | \$ 27                                          | 0,00                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                 | \$                    | 1.903                         | \$ 0                            | \$ (6)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | CHF                   | 1.514                         | 6                               | 6                                              | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | CHF                 | \$                    | 20                            | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | \$                  | CHF                   | 47                            | 1                               | 0                                              | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | CHF                 | \$                    | 1.885                         | 0                               | (11)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CHF                   | 1.509                         | 63                              | 0                                              | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 1.503                         | 11                              | 0                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          |                     |                       | 1.856                         | 60                              | 0                                              | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          |                     |                       | 1.383                         | 51                              | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 192                        | \$ (18)                         | \$ 174                                         | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | \$                       | 100.516                          | \$ 0                               | \$ (255)                                             | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | €                        | 78.785                           | 2.965                              | 2.965                                                | 0,20                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 85.847                           | 254                                | 254                                                  | 0,02                    |
| BOA        | 07.2025          |                        |                          | 100.431                          | 3.235                              | 3.235                                                | 0,22                    |
| BPS        | 07.2025          | €                      | \$                       | 296                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        |                          | 32                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | €                        | 86.147                           | 3.292                              | 3.292                                                | 0,22                    |
| CBK        | 07.2025          | €                      | \$                       | 350                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | €                        | 204                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | €                      | \$                       | 99.374                           | 0                                  | (1.178)                                              | (0,08)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | €                        | 85.472                           | 1.176                              | 1.176                                                | 0,08                    |
| MBC        | 07.2025          | €                      | \$                       | 2.346                            | 0                                  | (45)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | €                        | 192                              | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | €                      | \$                       | 28                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$ 10.929                          | \$ (1.492)                                           | \$ 9.437                |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      | 0,64                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Nicht realisierte Kontrakte aus: |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |  |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|--|
| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |  |
| AZD                              | 07.2025          | £                   | \$                    | 6.187                         | \$ 8                            | \$ 8                                           | 0,00                 |  |
|                                  | 08.2025          | \$                  | £                     | 4.509                         | 0                               | (8)                                            | 0,00                 |  |
| BRC                              | 07.2025          | £                   | \$                    | 6.473                         | 0                               | (47)                                           | (0,01)               |  |
|                                  | 07.2025          | \$                  | £                     | 4.702                         | 95                              | 95                                             | 0,01                 |  |
|                                  | 08.2025          |                     |                       | 4.691                         | 46                              | 46                                             | 0,00                 |  |
| CBK                              | 07.2025          | £                   | \$                    | 38                            | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |  |
|                                  | 07.2025          | \$                  | £                     | 5                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |  |
| MBC                              | 07.2025          | £                   | \$                    | 12                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |  |
|                                  | 07.2025          | \$                  | £                     | 4.583                         | 99                              | 99                                             | 0,01                 |  |
| SSB                              | 07.2025          | £                   | \$                    | 6.393                         | 4                               | 4                                              | 0,00                 |  |
|                                  | 07.2025          | \$                  | £                     | 4.677                         | 76                              | 76                                             | 0,01                 |  |
|                                  | 08.2025          |                     |                       | 4.662                         | 0                               | (4)                                            | 0,00                 |  |
|                                  |                  |                     |                       | \$ 328                        | \$ (60)                         | \$ 268                                         | 0,02                 |  |

Zum 30. Juni 2025 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | \$                  | 5 CNH                 | 35                            | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 19                            | 1                               | 1                                              | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          |                     |                       | 3                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 2                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          |                     |                       | 88                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          |                     |                       | 6                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 2                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CNH                 | \$                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          |                     |                       | 2                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CNH                   | 13                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 2                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          |                     |                       | 82                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 4                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SOG        | 07.2025          |                     |                       | 46                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | CNH                 | \$                    | 635                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | CNH                   | 89                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | CNH                 | \$                    | 600                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | CNH                   | 84                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 1                          | \$ 0                            | \$ 1                                           | 0,00                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD                 | \$ 7.755              | 6.057                         | \$ 0                            | \$ (33)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 12.626                | SGD 16.275                    | 152                             | 0                                              | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 6.057                 | 7.737                         | 33                              | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     |                       | 245                           | 315                             | 2                                              | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          |                     |                       | 857                           | 1.100                           | 6                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          |                     |                       | 8.270                         | 10.653                          | 95                                             | 0,01                 |
| FAR        | 07.2025          | SGD                 | \$ 19.156             | 15.019                        | 0                               | (21)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 16.468                | SGD 21.190                    | 169                             | 0                                              | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 15.019                | 19.111                        | 23                              | 0                                              | 0,00                 |
| GLM        | 07.2025          | SGD                 | \$ 8.392              | 6.583                         | 0                               | (5)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 6.583                 | SGD 8.371                     | 6                               | 0                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | SGD                 | \$ 20.871             | 16.143                        | 0                               | (244)                                          | (0,02)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 13.666                | SGD 17.533                    | 100                             | 0                                              | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 14.988                | 19.338                        | 233                             | 0                                              | 0,02                 |
| MYI        | 07.2025          | SGD                 | \$ 34                 | 26                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 441                   | SGD 566                       | 3                               | 0                                              | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | SGD                 | \$ 3.297              | 2.556                         | 0                               | (32)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 2.556                 | SGD 3.289                     | 33                              | 0                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          |                     |                       | 346                           | 441                             | 1                                              | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          |                     |                       | 290                           | 372                             | 2                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 858                        | \$ (335)                        | \$ 523                                         | 0,04                 |

Summe OTC Finanzderivate

\$ 4.158 0,28

Summe Anlagen

\$ 1.470.978 100,22

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (3.173) (0,22)

Nettovermögen

\$ 1.467.805 100,00

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

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

(l) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 1,26 %):

| Emittentenbeschreibung   | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum               | Kosten           | Marktwert       | % des Nettovermögens |
|--------------------------|---------|------------------|-------------------------|------------------|-----------------|----------------------|
| Flourish Century         | 6,600 % | 04.02.2022       | 25.08.2021 - 27.08.2021 | \$ 10.747        | \$ 386          | 0,03                 |
| Franshion Brilliant Ltd. | 6,000   | 08.02.2026       | 10.05.2024              | 602              | 698             | 0,05                 |
| Grab Holdings Ltd.       | 0,000   | 15.06.2030       | 10.06.2025              | 6.000            | 6.429           | 0,44                 |
|                          |         |                  |                         | <b>\$ 17.349</b> | <b>\$ 7.513</b> | <b>0,52</b>          |

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 24.665 (31. Dezember 2024: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 260 (31. Dezember 2024: USD null) als Sicherheiten verpfändet.

(k) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.962 (31. Dezember 2024: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 2.550 (31. Dezember 2024: USD 7.810) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 89 (31. Dezember 2024: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 281 (31. Dezember 2024: USD null) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 14.694 (31. Dezember 2024: USD 11.302) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 1.345.492                                                    | \$ 6.947                                                     | \$ 1.352.439        |
| Investmentfonds               | 113.175                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 113.175             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | 5.364                                                           | 0                                                            | 5.364               |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 113.175</b>                                                           | <b>\$ 1.350.856</b>                                             | <b>\$ 6.947</b>                                              | <b>\$ 1.470.978</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 1.592.050                                                    | \$ 362                                                       | \$ 1.592.412        |
| Investmentfonds               | 178.595                                                                     | 4.878                                                           | 0                                                            | 183.473             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | (10.925)                                                        | 0                                                            | (10.925)            |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 178.595</b>                                                           | <b>\$ 1.586.003</b>                                             | <b>\$ 362</b>                                                | <b>\$ 1.764.960</b> |

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

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

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|-----------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BPS                                       | 3,750 %    | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (7.924)   | \$ (8.083)                                  | (0,55)                  |
| MYI                                       | (0,500)    | 22.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup> | (419)        | (419)                                       | (0,03)                  |
|                                           | 3,500      | 25.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup> | (3.482)      | (3.505)                                     | (0,24)                  |
|                                           | 4,200      | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup> | (1.629)      | (1.666)                                     | (0,11)                  |
| SCX                                       | 3,950      | 29.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup> | (4.100)      | (4.114)                                     | (0,28)                  |
|                                           | 4,000      | 05.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup> | (4.139)      | (4.165)                                     | (0,29)                  |
|                                           | 4,050      | 29.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup> | (1.603)      | (1.609)                                     | (0,11)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                       |                    |              | <b>\$ (23.561)</b>                          | <b>(1,61)</b>           |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 2.921                            | \$ (2.500)                            | \$ 421                              | \$ (282)                            | \$ 0                                  | \$ (282)                            |
| BOA        | 2.819                               | (2.710)                               | 109                                 | 198                                 | 0                                     | 198                                 |
| BPS        | (1.056)                             | 1.146                                 | 90                                  | (1.524)                             | 1.770                                 | 246                                 |
| BRC        | 3.162                               | (2.910)                               | 252                                 | (1.198)                             | 1.210                                 | 12                                  |
| CBK        | (1.364)                             | 1.307                                 | (57)                                | (328)                               | 260                                   | (68)                                |
| DBL        | (22)                                | 0                                     | (22)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| DUB        | (309)                               | 476                                   | 167                                 | (1.748)                             | 1.520                                 | (228)                               |

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| FAR        | \$ (210)                            | \$ 333                                | \$ 123                              | \$ k. A.                            | \$ k. A.                              | \$ k. A.                            |
| GLM        | 67                                  | (310)                                 | (243)                               | (161)                               | 0                                     | (161)                               |
| GST        | (499)                               | 630                                   | 131                                 | (676)                               | 780                                   | 104                                 |
| IND        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| JPM        | (1.108)                             | (1.120)                               | (2.228)                             | 80                                  | 0                                     | 80                                  |
| MBC        | (57)                                | 70                                    | 13                                  | (1.077)                             | 780                                   | (297)                               |
| MYC        | (552)                               | 430                                   | (122)                               | 113                                 | 0                                     | 113                                 |
| MYI        | 34                                  | (90)                                  | (56)                                | (213)                               | 90                                    | (123)                               |
| RBC        | 51                                  | 0                                     | 51                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SCX        | (46)                                | 0                                     | (46)                                | (1.670)                             | 1.400                                 | (270)                               |
| SOG        | 269                                 | (270)                                 | (1)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SSB        | 64                                  | 0                                     | 64                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| UAG        | (6)                                 | 0                                     | (6)                                 | (95)                                | 0                                     | (95)                                |
| WST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 3                                   | 0                                     | 3                                   |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 77,41             | 81,71             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 10,47             | 3,09              |
| Investmentfonds                                                        | 7,35              | 9,78              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,06              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,06              | 0,05              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,00              | 0,19              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 3,65              | 5,18              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                               | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                                                          | 0,55              | 0,65              |
| Bermuda                                                                             | 0,28              | 0,19              |
| Kanada                                                                              | 0,09              | k. A.             |
| Kaimaninseln                                                                        | 15,58             | 15,98             |
| China                                                                               | 0,18              | 0,25              |
| Kolumbien                                                                           | 0,35              | 0,54              |
| Frankreich                                                                          | 0,30              | 0,34              |
| Hongkong                                                                            | 7,36              | 8,05              |
| Indien                                                                              | 11,88             | 10,83             |
| Indonesien                                                                          | 2,09              | 1,80              |
| Japan                                                                               | 0,91              | 0,25              |
| Jersey, Kanalinseln                                                                 | 0,78              | 0,97              |
| Luxemburg                                                                           | 0,24              | k. A.             |
| Marshallinseln                                                                      | 0,55              | 0,43              |
| Mauritius                                                                           | 4,01              | 4,83              |
| Mexiko                                                                              | 0,39              | 0,50              |
| Mongolei                                                                            | 2,15              | 2,22              |
| Niederlande                                                                         | 2,39              | 1,30              |
| Pakistan                                                                            | 4,98              | 5,28              |
| Philippinen                                                                         | 5,02              | 3,43              |
| Singapur                                                                            | 2,45              | 2,78              |
| Südafrika                                                                           | 0,36              | 0,35              |
| Südkorea                                                                            | 1,17              | 0,40              |
| Spanien                                                                             | 0,48              | k. A.             |
| Sri Lanka                                                                           | 5,66              | 5,86              |
| Thailand                                                                            | 3,16              | 2,89              |
| Großbritannien                                                                      | 10,39             | 7,68              |
| USA                                                                                 | 1,68              | 1,57              |
| Vietnam                                                                             | 0,13              | 0,11              |
| Jungferninseln (Britisch)                                                           | 5,47              | 7,35              |
| Kurzfristige Instrumente                                                            | 1,11              | 0,00              |
| Investmentfonds                                                                     | 7,71              | 10,01             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                 |                   |                   |
| Futures                                                                             | 0,07              | (0,06)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                 |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf | 0,01              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                               | 0,01              | k. A.             |
| Zinsswaps                                                                           | 0,00              | (0,06)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                          |                   |                   |
| Optionskauf                                                                         |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                              | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                              | 0,00              | k. A.             |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | (0,24)            | (0,18)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | (0,02)            |
| Zinsswaps                                                                              | k. A.             | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,19)            | 0,09              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,71              | (0,36)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (0,22)            | 3,75              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|



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

| BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>INDIEN</b>                            |                |                          |                                   | <b>INDONESIA</b>                                        |                |                          |                                   | <b>MAURITIUS</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | <b>WADELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |
| Adani Electricity Mumbai Ltd.            |                |                          |                                   | Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT                          |                |                          |                                   | Export-Import Bank of Malaysia Bhd.       |                |                          |                                   |
| 3,949 % fällig am 12.02.2030             | 998            | \$ 895                   | 0,35                              | 5,375 % fällig am 23.03.2026                            | \$ 600         | \$ 596                   | 0,24                              | 1,831 % fällig am 26.11.2026              | 700            | 676                      | 0,27                              |
| Adani Green Energy UP Ltd.               |                |                          |                                   | LLPL Capital Pte. Ltd.                                  |                |                          |                                   | Summe Malaysia                            |                | 5.444                    | 2,16                              |
| 6,700 % fällig am 12.03.2042             | 794            | 741                      | 0,29                              | 6,875 % fällig am 04.02.2039                            | 582            | 594                      | 0,23                              |                                           |                |                          |                                   |
| Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. |                |                          |                                   | Majapahit Holding BV                                    |                |                          |                                   | <b>MAURITIUS</b>                          |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 30.07.2027             | 200            | 194                      | 0,08                              | 7,875 % fällig am 29.06.2037                            | 400            | 478                      | 0,19                              | <b>WADELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |
| 4,200 % fällig am 04.08.2027             | 300            | 289                      | 0,11                              | Minejasa Capital BV                                     |                |                          |                                   | MakeMyTrip Ltd.                           |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029             | 400            | 378                      | 0,15                              | 4,625 % fällig am 10.08.2030                            | 789            | 780                      | 0,31                              | 0,000 % fällig am 01.07.2030 (c)          | 300            | 320                      | 0,13                              |
| Adani Transmission Step-One Ltd.         |                |                          |                                   | Pakuwon Jati Tbk PT                                     |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 03.08.2026             | 900            | 891                      | 0,35                              | 4,875 % fällig am 29.04.2028                            | 200            | 195                      | 0,08                              | CA Magnun Holdings                        |                |                          |                                   |
| Axis Bank Ltd.                           |                |                          |                                   | Pertamina Hulu Energi PT                                |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 31.10.2026              | 1.100          | 1.095                    | 0,43                              |
| 4,100 % fällig am 08.09.2026             | 400            | 389                      | 0,15                              | 5,250 % fällig am 21.05.2030                            | 2.000          | 2.022                    | 0,80                              | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd. |                |                          |                                   |
| (e)(g)                                   |                |                          |                                   | Pertamina Persero PT                                    |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 25.03.2027              | 161            | 156                      | 0,06                              |
| Continuum Green Energy India Pvt         |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 27.05.2041                            | 1.800          | 1.867                    | 0,74                              | Greenko Dutch BV                          |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 26.06.2033             | 772            | 795                      | 0,32                              | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan              |                |                          |                                   | 3,850 % fällig am 29.03.2026              | 1.496          | 1.470                    | 0,58                              |
| GMR Hyderabad International Airport Ltd. |                |                          |                                   | Listrik Negara                                          |                |                          |                                   | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.      |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 27.10.2027             | 900            | 871                      | 0,35                              | 4,000 % fällig am 30.06.2050                            | 3.300          | 2.326                    | 0,92                              | 7,250 % fällig am 27.09.2028              | 200            | 202                      | 0,08                              |
| HDFC Bank Ltd.                           |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 21.05.2048                            | 800            | 780                      | 0,31                              | India Clean Energy Holdings               |                |                          |                                   |
| 3,700 % fällig am 25.08.2026             | 900            | 873                      | 0,35                              | 6,250 % fällig am 25.01.2049                            | 500            | 494                      | 0,19                              | 4,500 % fällig am 18.04.2027              | 200            | 193                      | 0,08                              |
| (e)(g)                                   |                |                          |                                   | Sarana Multi Infrastruktur Perusahaan Perseroan Persero |                |                          |                                   | India Cleantech Energy                    |                |                          |                                   |
| IIFL Finance Ltd.                        |                |                          |                                   | PT                                                      |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 10.08.2026              | 869            | 857                      | 0,34                              |
| 8,750 % fällig am 24.07.2028             | 1.500          | 1.510                    | 0,60                              | 2,050 % fällig am 11.05.2026                            | 700            | 685                      | 0,27                              | India Green Power Holdings                |                |                          |                                   |
| Indian Railway Finance Corp. Ltd.        |                |                          |                                   |                                                         |                | 18.225                   | 7,22                              | 4,000 % fällig am 22.02.2027              | 953            | 928                      | 0,37                              |
| 3,570 % fällig am 21.01.2032             | 1.000          | 920                      | 0,36                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | UPL Corp. Ltd.                            |                |                          |                                   |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.       |                |                          |                                   | Indonesia Government International Bond                 |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 08.03.2028              | 500            | 479                      | 0,19                              |
| 7,110 % fällig am 11.03.2032             | 1.200          | 1.204                    | 0,48                              | 3,650 % fällig am 10.09.2032                            | € 900          | 1.066                    | 0,42                              |                                           |                | 5.380                    | 2,13                              |
| JSW Hydro Energy Ltd.                    |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.01.2037                            | 600            | 713                      | 0,28                              | Summe Mauritius                           |                | 5.700                    | 2,26                              |
| 4,125 % fällig am 18.05.2031             | 994            | 916                      | 0,36                              | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia                      |                |                          |                                   | <b>MEXIKO</b>                             |                |                          |                                   |
| JSW Steel Ltd.                           |                |                          |                                   | 5,650 % fällig am 25.11.2054                            | \$ 600         | 591                      | 0,24                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   |
| 3,950 % fällig am 05.04.2027             | 200            | 194                      | 0,08                              |                                                         |                | 2.370                    | 0,94                              | Banco Mercantil del Norte S.A.            |                |                          |                                   |
| Manappuram Finance Ltd.                  |                |                          |                                   | Summe Indonesien                                        |                | 20.595                   | 8,16                              | 8,750 % fällig am                         |                |                          |                                   |
| 7,375 % fällig am 12.05.2028             | 700            | 710                      | 0,28                              | <b>JAPAN</b>                                            |                |                          |                                   | 20.05.2035 (e)(g)                         | 600            | 607                      | 0,24                              |
| Motherson Global Investments BV          |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | BBVA Bancomer S.A.                        |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 11.07.2029             | 700            | 712                      | 0,28                              | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.                    |                |                          |                                   | 7,625 % fällig am 11.02.2035 (g)          | 600            | 618                      | 0,24                              |
| Muthoot Finance Ltd.                     |                |                          |                                   | 8,200 % fällig am                                       |                |                          |                                   | El Puerto de Liverpool S.A.B. de C.V.     |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 23.04.2029             | 750            | 749                      | 0,30                              | 15.01.2029 (e)(g)                                       | 500            | 542                      | 0,22                              | 6,658 % fällig am 22.01.2037              | 600            | 619                      | 0,25                              |
| 7,125 % fällig am 14.02.2028             | 1.400          | 1.426                    | 0,56                              | Nomura Holdings, Inc.                                   |                |                          |                                   | Trust Fiba Uno                            |                |                          |                                   |
| Network I2I Ltd.                         |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am                                       |                |                          |                                   | 4,869 % fällig am 15.01.2030              | 600            | 570                      | 0,23                              |
| 3,975 % fällig am 03.03.2026 (e)         | 200            | 198                      | 0,08                              | 15.07.2030 (a)(e)(g)                                    | 600            | 608                      | 0,24                              | 7,700 % fällig am 23.01.2032              | 400            | 417                      | 0,16                              |
| Piramal Finance Ltd.                     |                |                          |                                   | Rakuten Group, Inc.                                     |                |                          |                                   | Summe Mexiko                              |                | 2.831                    | 1,12                              |
| 7,800 % fällig am 29.01.2028             | 1.100          | 1.107                    | 0,44                              | 5,125 % fällig am 22.04.2026 (e)                        | 600            | 590                      | 0,23                              | <b>MONGOLEI</b>                           |                |                          |                                   |
| ReNew Pvt Ltd.                           |                |                          |                                   | Resona Bank Ltd.                                        |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027             | 900            | 894                      | 0,35                              | 4,983 % fällig am 22.01.2028                            | 500            | 508                      | 0,20                              | City of Ulaanbaatar Mongolia              |                |                          |                                   |
| SAEL Ltd.                                |                |                          |                                   | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.                   |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am 21.08.2027              | 900            | 904                      | 0,36                              |
| 7,800 % fällig am 31.07.2031             | 1.360          | 1.326                    | 0,53                              | 6,450 % fällig am                                       |                |                          |                                   | Mongolia Government International Bond    |                |                          |                                   |
| Sammaan Capital Ltd.                     |                |                          |                                   | 05.06.2035 (e)(g)                                       | 500            | 491                      | 0,19                              | 6,625 % fällig am 25.02.2030              | 200            | 197                      | 0,08                              |
| 9,700 % fällig am 03.07.2027             | 800            | 810                      | 0,32                              | Summe Japan                                             |                | 2.739                    | 1,08                              | 7,875 % fällig am 05.06.2029              | 200            | 209                      | 0,08                              |
| Shriram Finance Ltd.                     |                |                          |                                   | <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                              |                |                          |                                   | 8,650 % fällig am 19.01.2028              | 623            | 654                      | 0,26                              |
| 4,150 % fällig am 18.07.2025             | 1.558          | 1.558                    | 0,62                              | <b>WADELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>                      |                |                          |                                   | Summe Mongolei                            |                | 1.964                    | 0,78                              |
| State Bank of India                      |                |                          |                                   | Goldman Sachs Finance Corp. International Ltd.          |                |                          |                                   | <b>NIEDERLANDE</b>                        |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 25.11.2029             | 1.000          | 1.020                    | 0,40                              | 0,000 % fällig am 04.04.2028 (c)                        | 1.200          | 1.271                    | 0,50                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   |
| UltraTech Cement Ltd.                    |                |                          |                                   | <b>LUXEMBURG</b>                                        |                |                          |                                   | ING Groep NV                              |                |                          |                                   |
| 2,800 % fällig am 16.02.2031             | 500            | 448                      | 0,18                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am                         |                |                          |                                   |
| Wipro IT Services LLC                    |                |                          |                                   | Chile Electricity Lux MPC SARL                          |                |                          |                                   | 16.05.2030 (e)(g)                         | 500            | 532                      | 0,21                              |
| 1,500 % fällig am 23.06.2026             | 200            | 194                      | 0,08                              | Greensaf Pipelines Bidco SARL                           |                |                          |                                   | Mong Duong Finance Holdings BV            |                |                          |                                   |
| Summe Indien                             |                | 22.212                   | 8,80                              | 5,853 % fällig am 23.02.2036                            | 800            | 810                      | 0,32                              | 5,125 % fällig am 07.05.2029              | 1.355          | 1.325                    | 0,52                              |
| <b>INDONESIEN</b>                        |                |                          |                                   | Raizen Fuels Finance S.A.                               |                |                          |                                   | Prosus NV                                 |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 08.07.2032 (a)                        | 600            | 596                      | 0,24                              | 4,193 % fällig am 19.01.2032              | 500            | 469                      | 0,19                              |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT              |                |                          |                                   | Summe Luxemburg                                         |                | 2.414                    | 0,96                              | VEON Holdings BV                          |                |                          |                                   |
| 4,900 % fällig am 24.03.2028             | 700            | 704                      | 0,28                              | <b>MALAYSIA</b>                                         |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 25.11.2027              | 400            | 370                      | 0,15                              |
| 5,500 % fällig am 04.04.2026             | 400            | 403                      | 0,16                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | Yinson Bergeia Production BV              |                |                          |                                   |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT     |                |                          |                                   | Khazanah Capital Ltd.                                   |                |                          |                                   | 8,498 % fällig am 31.01.2045 (a)          | 1.200          | 1.216                    | 0,48                              |
| 3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)         | 820            | 812                      | 0,32                              | 4,876 % fällig am 01.06.2033                            | 300            | 301                      | 0,12                              | Yinson Boronia Production BV              |                |                          |                                   |
| 4,300 % fällig am                        |                |                          |                                   | Khazanah Global Sukuk Bhd.                              |                |                          |                                   | 8,947 % fällig am 31.07.2042              | 297            | 317                      | 0,12                              |
| 24.03.2027 (e)(g)                        | 1.450          | 1.386                    | 0,55                              | 4,687 % fällig am 01.06.2028                            | 500            | 504                      | 0,20                              |                                           |                | 4.229                    | 1,67                              |
| Freeport Indonesia PT                    |                |                          |                                   | Petrolim Nasional Bhd.                                  |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 5,315 % fällig am 14.04.2032             | 1.500          | 1.505                    | 0,60                              | 7,625 % fällig am 15.10.2026                            | 700            | 728                      | 0,29                              |                                           |                |                          |                                   |
| Hutama Karya Persero PT                  |                |                          |                                   | Petronas Capital Ltd.                                   |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 11.05.2030             | 1.000          | 955                      | 0,38                              | 2,480 % fällig am 28.01.2032                            | 1.000          | 872                      | 0,35                              |                                           |                |                          |                                   |
| Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT        |                |                          |                                   | 3,404 % fällig am 28.04.2061                            | 550            | 359                      | 0,14                              |                                           |                |                          |                                   |
| 3,541 % fällig am 27.04.2032             | 500            | 457                      | 0,18                              |                                                         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| Indonesia Asahan Aluminium PT            |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 5,450 % fällig am 15.05.2030             | 500            | 509                      | 0,20                              |                                                         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 6,530 % fällig am 15.11.2028             | 500            | 528                      | 0,21                              |                                                         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>               |                |                          |                                   |
| <b>Veon Amsterdam</b>                                   |                |                          |                                   |
| 8,531 % - 10,750 % fällig am<br>25.03.2027              | \$ 800         | \$ 800                   | 0,32                              |
| Summe Niederlande                                       |                | 5.029                    | 1,99                              |
| <b>NEUSEELAND</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Westpac Banking Corp.</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am<br>21.09.2027 (e)(g)                  | 1.300          | 1.289                    | 0,51                              |
| <b>PAKISTAN</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Pakistan Government International Bond</b>           |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027                            | 900            | 852                      | 0,34                              |
| 7,375 % fällig am 08.04.2031                            | 800            | 713                      | 0,28                              |
| 7,875 % fällig am 31.03.2036                            | 1.100          | 896                      | 0,35                              |
| 8,250 % fällig am 30.09.2025                            | 900            | 899                      | 0,36                              |
| 8,875 % fällig am 08.04.2051                            | 1.700          | 1.398                    | 0,55                              |
| <b>Pakistan Water &amp; Power Development Authority</b> |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 04.06.2031                            | 300            | 241                      | 0,10                              |
| Summe Pakistan                                          |                | 4.999                    | 1,98                              |
| <b>PERU</b>                                             |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Banco de Credito del Peru S.A.</b>                   |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 01.07.2030 (g)                        | 200            | 200                      | 0,08                              |
| <b>Compania de Minas Buenaventura S.A.A.</b>            |                |                          |                                   |
| 6,800 % fällig am 04.02.2032                            | 600            | 610                      | 0,24                              |
| Summe Peru                                              |                | 810                      | 0,32                              |
| <b>PHILIPPINEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Development Bank of the Philippines</b>              |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 11.03.2031                            | 600            | 533                      | 0,21                              |
| <b>Globe Telecom, Inc.</b>                              |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 23.07.2030                            | 1.300          | 1.162                    | 0,46                              |
| <b>ICTSI Treasury BV</b>                                |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 16.11.2031                            | 1.300          | 1.194                    | 0,47                              |
| <b>Jollibee Worldwide Pte Ltd.</b>                      |                |                          |                                   |
| 5,332 % fällig am 02.04.2030                            | 700            | 715                      | 0,28                              |
| <b>Metropolitan Bank &amp; Trust Co.</b>                |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 06.03.2034                            | 700            | 715                      | 0,28                              |
| <b>Petron Corp.</b>                                     |                |                          |                                   |
| 5,950 % fällig am 19.04.2026 (e)                        | 900            | 893                      | 0,36                              |
| <b>PLDT, Inc.</b>                                       |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 23.01.2031                            | 700            | 628                      | 0,25                              |
| <b>San Miguel Corp.</b>                                 |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 29.07.2025 (e)                        | 900            | 899                      | 0,36                              |
| <b>San Miguel Global Power Holdings Corp.</b>           |                |                          |                                   |
| 8,125 % fällig am 02.12.2029 (e)                        | 1.100          | 1.089                    | 0,43                              |
| 8,750 % fällig am 12.06.2029 (e)                        | 1.500          | 1.509                    | 0,60                              |
| <b>SMIC SG Holdings Pte Ltd.</b>                        |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 24.07.2029                            | 900            | 915                      | 0,36                              |
|                                                         |                | 10.252                   | 4,06                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Philippines Government International Bond</b>        |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 17.07.2033                            | 400            | 404                      | 0,16                              |
| 5,000 % fällig am 13.01.2037                            | 200            | 199                      | 0,08                              |
| 5,175 % fällig am 05.09.2049                            | 2.100          | 1.943                    | 0,77                              |
| 6,500 % fällig am 19.05.2029                            | PHP 62.950     | 1.144                    | 0,46                              |
| 8,000 % fällig am 19.07.2031                            | 93.300         | 1.825                    | 0,72                              |
|                                                         |                | 5.515                    | 2,19                              |
| Summe Philippinen                                       |                | 15.767                   | 6,25                              |
| <b>SINGAPUR</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Continuum Energy Aura Pte Ltd.</b>                   |                |                          |                                   |
| 9,500 % fällig am 24.02.2027                            | \$ 500         | 517                      | 0,20                              |
| <b>DBS Group Holdings Ltd.</b>                          |                |                          |                                   |
| 1,822 % fällig am 10.03.2031 (g)                        | 200            | 196                      | 0,08                              |
| <b>GLP Pte. Ltd.</b>                                    |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 20.05.2028                            | 900            | 864                      | 0,34                              |

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Medco Cypress Tree Pte Ltd.</b>                   |                |                          |                                   |
| 8,625 % fällig am 19.05.2030                         | \$ 1.200       | \$ 1.230                 | 0,49                              |
| <b>Medco Maple Tree Pte Ltd.</b>                     |                |                          |                                   |
| 8,960 % fällig am 27.04.2029                         | 300            | 313                      | 0,12                              |
| <b>Nanshan Life Pte Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 5,450 % fällig am 11.09.2034                         | 1.000          | 940                      | 0,37                              |
| <b>Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.</b>            |                |                          |                                   |
| 4,602 % fällig am 15.06.2032 (g)                     | 1.500          | 1.503                    | 0,60                              |
| <b>United Overseas Bank Ltd.</b>                     |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 16.03.2031 (g)                     | 700            | 686                      | 0,27                              |
| <b>Yinson Production Financial Services Pte Ltd.</b> |                |                          |                                   |
| 9,625 % fällig am 03.05.2029                         | 600            | 624                      | 0,25                              |
| Summe Singapur                                       |                | 6.873                    | 2,72                              |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>Sasol Financing USA LLC</b>                       |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 08.11.2027                         | 600            | 553                      | 0,22                              |
| <b>SÜDKOREA</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>LG Chem Ltd.</b>                                  |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 18.07.2028                         | 800            | 833                      | 0,33                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| <b>GS Caltex Corp.</b>                               |                |                          |                                   |
| 1,625 % fällig am 27.07.2025                         | 1.300          | 1.297                    | 0,51                              |
| 5,375 % fällig am 07.08.2028                         | 900            | 920                      | 0,36                              |
| <b>Hanwha Life Insurance Co. Ltd.</b>                |                |                          |                                   |
| 6,300 % fällig am 24.06.2055                         | 1.200          | 1.237                    | 0,49                              |
| <b>Hyundai Card Co. Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 24.04.2029                         | 1.100          | 1.137                    | 0,45                              |
| <b>KB Capital Co. Ltd.</b>                           |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 28.10.2025                         | 500            | 495                      | 0,20                              |
| <b>Kodit Global Co. Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,954 % fällig am 25.05.2026                         | 800            | 804                      | 0,32                              |
| <b>Kookmin Bank</b>                                  |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)                     | 700            | 626                      | 0,25                              |
| <b>LG Energy Solution Ltd.</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 02.07.2029                         | 1.100          | 1.112                    | 0,44                              |
| 5,875 % fällig am 02.04.2035                         | 800            | 798                      | 0,32                              |
| <b>Mirae Asset Securities Co. Ltd.</b>               |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 30.07.2025                         | 250            | 250                      | 0,10                              |
| <b>POSCO</b>                                         |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 04.08.2025                         | 600            | 600                      | 0,24                              |
| 5,750 % fällig am 17.01.2028                         | 1.000          | 1.028                    | 0,41                              |
| <b>Shinhan Bank Co. Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 23.04.2029 (g)                     | 200            | 195                      | 0,08                              |
| 4,500 % fällig am 26.03.2028 (g)                     | 700            | 698                      | 0,28                              |
| <b>Shinhan Card Co. Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 1,375 % fällig am 19.10.2025                         | 400            | 396                      | 0,16                              |
| 2,500 % fällig am 27.01.2027                         | 1.600          | 1.551                    | 0,61                              |
| <b>SK Hynix, Inc.</b>                                |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 16.01.2029                         | 300            | 309                      | 0,12                              |
| 6,375 % fällig am 17.01.2028                         | 800            | 835                      | 0,33                              |
| <b>Tongyang Life Insurance Co. Ltd.</b>              |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 22.09.2025 (e)                     | 900            | 898                      | 0,35                              |
| 6,250 % fällig am 07.05.2035                         | 200            | 206                      | 0,08                              |
|                                                      |                | 15.392                   | 6,10                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Korea Housing Finance Corp.</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 27.08.2027                         | 400            | 406                      | 0,16                              |
| <b>Korea National Oil Corp.</b>                      |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 18.04.2032                         | 2.300          | 2.016                    | 0,80                              |
| 4,250 % fällig am 30.09.2029                         | 200            | 199                      | 0,08                              |
|                                                      |                | 2.621                    | 1,04                              |
| Summe Südkorea                                       |                | 18.846                   | 7,47                              |
| <b>SPANIEN</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| <b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>          |                |                          |                                   |
| 7,750 % fällig am<br>14.01.2032 (e)(g)               | 900            | 915                      | 0,36                              |

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SRI LANKA</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Sri Lanka Government International Bond</b>   |                |                          |                                   |
| 3,350 % fällig am 15.03.2033                     | \$ 2.365       | \$ 1.914                 | 0,76                              |
| 3,600 % fällig am 15.06.2035                     | 1.456          | 1.003                    | 0,40                              |
| 3,600 % fällig am 15.05.2036                     | 733            | 599                      | 0,24                              |
| 3,600 % fällig am 15.02.2038                     | 1.167          | 950                      | 0,38                              |
| 4,000 % fällig am 15.04.2028                     | 767            | 722                      | 0,28                              |
| Summe Sri Lanka                                  |                | 5.188                    | 2,06                              |
| <b>THAILAND</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Bangkok Bank PCL</b>                          |                |                          |                                   |
| 4,300 % fällig am 15.06.2027                     | 300            | 299                      | 0,12                              |
| 5,000 % fällig am<br>23.09.2025 (e)(g)           | 600            | 599                      | 0,24                              |
| 5,300 % fällig am 21.09.2028                     | 1.050          | 1.073                    | 0,43                              |
| <b>Kasikornbank PCL</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,275 % fällig am<br>14.10.2025 (e)(g)           | 1.300          | 1.299                    | 0,51                              |
| 5,458 % fällig am 07.03.2028                     | 700            | 714                      | 0,28                              |
| <b>Krung Thai Bank PCL</b>                       |                |                          |                                   |
| 4,400 % fällig am<br>25.03.2026 (e)(g)           | 600            | 591                      | 0,23                              |
| <b>RH International Singapore Corp. Pte Ltd.</b> |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 27.03.2028                     | 900            | 888                      | 0,35                              |
| <b>Thaiol Treasury Center Co. Ltd.</b>           |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 18.06.2050                     | 300            | 192                      | 0,08                              |
|                                                  |                | 5.655                    | 2,24                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Export Import Bank of Thailand</b>            |                |                          |                                   |
| 5,354 % fällig am 16.05.2029                     | 700            | 720                      | 0,29                              |
| Summe Thailand                                   |                | 6.375                    | 2,53                              |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.</b>        |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 25.07.2029                     | 900            | 909                      | 0,36                              |
| <b>NBK SPC Ltd.</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 06.06.2030                     | 800            | 823                      | 0,33                              |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate               |                | 1.732                    | 0,69                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Azule Energy Finance PLC</b>                  |                |                          |                                   |
| 8,125 % fällig am 23.01.2030                     | 500            | 496                      | 0,20                              |
| <b>Biocon Biologics Global PLC</b>               |                |                          |                                   |
| 6,670 % fällig am 09.10.2029                     | 200            | 190                      | 0,07                              |
| <b>Diamond Ltd.</b>                              |                |                          |                                   |
| 7,950 % fällig am 28.07.2026                     | 1.200          | 1.211                    | 0,48                              |
| <b>HSBC Holdings PLC</b>                         |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am<br>11.09.2029 (e)(g)           | 600            | 609                      | 0,24                              |
| 8,000 % fällig am<br>07.03.2028 (e)(g)(i)        | 200            | 210                      | 0,08                              |
| <b>Lloyds Banking Group PLC</b>                  |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am<br>27.09.2029 (e)(g)           | 500            | 529                      | 0,21                              |
| <b>Prudential Funding Asia PLC</b>               |                |                          |                                   |
| 2,950 % fällig am 03.11.2033                     | 500            | 468                      | 0,18                              |
| <b>Standard Chartered PLC</b>                    |                |                          |                                   |
| 3,603 % fällig am 12.01.2033                     | 500            | 454                      | 0,18                              |
| 4,300 % fällig am<br>19.08.2028 (e)(g)           | 500            | 456                      | 0,18                              |
| 5,905 % fällig am 14.05.2035                     | 500            | 520                      | 0,21                              |
| 6,000 % fällig am<br>26.07.2025 (e)(g)           | 600            | 600                      | 0,24                              |
| 6,170 % fällig am 09.01.2027                     | 400            | 403                      | 0,16                              |
| 6,187 % fällig am 06.07.2027                     | 700            | 711                      | 0,28                              |
| 7,018 % fällig am 08.02.2030                     | 2.100          | 2.258                    | 0,89                              |
| 7,625 % fällig am<br>16.01.2032 (e)(g)           | 710            | 723                      | 0,29                              |
| 7,750 % fällig am<br>15.08.2027 (e)(g)           | 800            | 832                      | 0,33                              |
| 7,875 % fällig am<br>08.03.2030 (e)(g)           | 990            | 1.033                    | 0,41                              |
| <b>Vedanta Resources Finance PLC</b>             |                |                          |                                   |
| 9,475 % fällig am 24.07.2030                     | 750            | 744                      | 0,29                              |
| 9,850 % fällig am 24.04.2033                     | 600            | 602                      | 0,24                              |
| 10,250 % fällig am 03.06.2028                    | 500            | 520                      | 0,21                              |
| 10,875 % fällig am 17.09.2029                    | 1.500          | 1.557                    | 0,62                              |
| Summe Großbritannien                             |                | 15.126                   | 5,99                              |

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

|                                                                           |     |           |        | % DES  |            |       |        |  |  |        |        | % DES  |        |       |  |
|---------------------------------------------------------------------------|-----|-----------|--------|--------|------------|-------|--------|--|--|--------|--------|--------|--------|-------|--|
| BESCHREIBUNG                                                              |     | PARI      | MARKT- | NETTO- |            |       | VERMÖ- |  |  | PARI   | MARKT- | NETTO- | VERMÖ- | % DES |  |
|                                                                           |     | (000S)    | (000S) | GENS   |            |       |        |  |  | (000S) | (000S) | GENS   |        |       |  |
| USA                                                                       |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                                          |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Cantor Fitzgerald LP                                                      |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 7,200 % fällig am 12.12.2028                                              | \$  | 358       | \$     | 380    | 0,15       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp.                                    |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,000 % fällig am 27.07.2028                                              |     | 400       |        | 407    | 0,16       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Hyundai Capital America                                                   |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 1,800 % fällig am 15.10.2025                                              |     | 300       |        | 298    | 0,12       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Kraton Corp.                                                              |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027                                              |     | 1.500     |        | 1.519  | 0,60       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Las Vegas Sands Corp.                                                     |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,625 % fällig am 15.06.2028                                              |     | 600       |        | 612    | 0,24       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 6,000 % fällig am 15.08.2029                                              |     | 800       |        | 823    | 0,33       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 6,000 % fällig am 14.06.2030 (i)                                          |     | 600       |        | 619    | 0,25       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Lendlease U.S. Capital, Inc.                                              |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 4,500 % fällig am 26.05.2026                                              |     | 1.100     |        | 1.098  | 0,43       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| SK Battery America, Inc.                                                  |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 4,875 % fällig am 23.01.2027                                              |     | 500       |        | 503    | 0,20       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Summe USA                                                                 |     |           |        |        | 6.259      | 2,48  |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| VIETNAM                                                                   |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| STAATSEMISSIONEN                                                          |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Vietnam Debt & Asset Trading Corp.                                        |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 1,000 % fällig am 10.10.2025                                              |     | 800       |        | 784    | 0,31       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Vietnam Government International Bond                                     |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,500 % fällig am 12.03.2028                                              |     | 1.750     |        | 1.680  | 0,67       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Summe Vietnam                                                             |     |           |        |        | 2.464      | 0,98  |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| JUNGFERNINSELN (BRITISCH)                                                 |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                                          |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| CAS Capital Ltd.                                                          |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 4,000 % fällig am 12.07.2026 (e)                                          |     | 600       |        | 594    | 0,24       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Celestial Dynasty Ltd.                                                    |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 6,375 % fällig am 22.08.2028                                              | \$  | 300       | \$     | 289    | 0,11       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Champion Path Holdings Ltd.                                               |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 4,500 % fällig am 27.01.2026                                              |     | 600       |        | 596    | 0,24       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Easy Tactic Ltd.                                                          |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 6,500 % fällig am 11.07.2027                                              |     | 0         |        | 0      | 0,00       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Elect Global Investments Ltd.                                             |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 7,200 % fällig am 11.09.2030 (e)                                          |     | 1.000     |        | 971    | 0,38       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| HKT Capital No. 4 Ltd.                                                    |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 3,000 % fällig am 14.07.2026                                              |     | 200       |        | 197    | 0,08       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Joy Treasure Assets Holdings, Inc.                                        |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,750 % fällig am 06.06.2029                                              |     | 600       |        | 619    | 0,25       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| NWD Finance BVI Ltd.                                                      |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)                                          |     | 550       |        | 150    | 0,06       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,250 % fällig am 22.03.2026 (e)                                          |     | 800       |        | 228    | 0,09       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 6,250 % fällig am 07.09.2025 (e)                                          |     | 900       |        | 234    | 0,09       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 10,131 % fällig am 30.07.2025 (e)                                         |     | 400       |        | 154    | 0,06       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| NWD MTN Ltd.                                                              |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 4,125 % fällig am 18.07.2029                                              |     | 800       |        | 414    | 0,16       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 4,500 % fällig am 19.05.2030                                              |     | 200       |        | 101    | 0,04       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 8,625 % fällig am 08.02.2028                                              |     | 400       |        | 262    | 0,10       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Peak RE BVI Holding Ltd.                                                  |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,350 % fällig am 28.10.2025 (e)                                          |     | 300       |        | 299    | 0,12       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Studio City Finance Ltd.                                                  |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 5,000 % fällig am 15.01.2029                                              |     | 1.600     |        | 1.469  | 0,58       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| TSMC Global Ltd.                                                          |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| 0,750 % fällig am 28.09.2025                                              |     | 600       |        | 595    | 0,24       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Summe Jungferneinseln (Britisch)                                          |     |           |        |        | 7.172      | 2,84  |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| KURZFRISTIGE INSTRUMENTE                                                  |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| KURZFRISTIGE SCHULDITITEL                                                 |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| SF Holding Investment Ltd.                                                |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| (0,251) % fällig am 08.07.2026 (a)(c)(d)                                  | HKD | 2.000     | \$     | 264    | 0,10       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Summe kurzfristige Instrumente                                            |     |           |        |        | 264        | 0,10  |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Summe Übertragbare Wertpapiere                                            |     |           |        |        | \$ 226.441 | 89,73 |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| AKTIEN                                                                    |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| INVESTMENTFONDS                                                           |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN                                         |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
|                                                                           |     | 2.107.332 |        | 21.014 | 8,33       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)          |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
|                                                                           |     | 1.880     |        | 27     | 0,01       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
|                                                                           |     |           |        |        | 21.041     | 8,34  |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| BÖRSENGEHADELTE FONDS                                                     |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)             |     |           |        |        |            |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
|                                                                           |     | 10.100    |        | 1.011  | 0,40       |       |        |  |  |        |        |        |        |       |  |
| Summe Investmentfonds                                                     |     |           |        |        | \$ 22.052  | 8,74  |        |  |  |        |        |        |        |       |  |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures            | Short | 09.2025     | 6                    | \$ (3)                                   | 0,00                 |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Short | 09.2025     | 6                    | 4                                        | 0,00                 |
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09.2025     | 4                    | 5                                        | 0,00                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025     | 7                    | (7)                                      | 0,00                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 182                  | 402                                      | 0,16                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 39                   | 95                                       | 0,04                 |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures                 | Long  | 09.2025     | 46                   | 129                                      | 0,05                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 33                   | 118                                      | 0,04                 |
|                                                                |       |             |                      | \$ 743                                   | 0,29                 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                      | \$ 743                                   | 0,29                 |

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

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

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

| Referenzeinheit                            | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | (1,000) %                   | 20.12.2029       | \$ 900                    | \$ 6                                     | 0,00                 |

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

| Index/Tranchen                       | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| iTraxx Asia Ex-Japan 43 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.06.2030       | \$ 4.200                  | \$ 17                                    | 0,01                 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz        | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 4.100    | \$ 61                                           | 0,02                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500           | 17.09.2035       | SGD 680    | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2030       | \$ 2.320   | (36)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2035       | 500        | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2055       | 2.100      | 20                                              | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 3-Month CNY-CNREPOFIX             | 1,500           | 17.09.2030       | CNY 40.130 | (28)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 3-Month HKD-HIBOR                 | 2,750           | 17.09.2027       | HKD 50.100 | (25)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2035       | € 1.400    | (16)                                            | (0,01)                  |
|                                                |                                   |                 |                  |            | \$ (36)                                         | (0,02)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                   |                 |                  |            | \$ (13)                                         | (0,01)                  |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

**OPTIONSKAUF****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                    | 0,650 %       | 20.08.2025    | 22.600                    | \$ 34  | \$ 10     | 0,00                    |

**VERKAUFSOPTIONEN****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900 %       | 20.08.2025    | 22.600                    | \$ (11) | \$ (4)    | 0,00                    |

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

<sup>(2)</sup> Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                              | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| BPS        | South Korea Government<br>International Bond | (1,000) %                      | 20.12.2033            | \$ 700                    | \$ (34)                                  | \$ 0                                            | \$ (34)   | (0,01)                  |
| BRC        | Honda Motor Co Ltd.                          | (1,000)                        | 20.12.2029            | ¥ 200.000                 | (39)                                     | 14                                              | (25)      | (0,01)                  |
| CBK        | Toyota Motor Corp.                           | (1,000)                        | 20.12.2029            | 175.000                   | (50)                                     | 8                                               | (42)      | (0,02)                  |
| DUB        | Mercedes-Benz Group AG                       | (1,000)                        | 20.12.2029            | € 2.400                   | (45)                                     | (9)                                             | (54)      | (0,02)                  |
| GST        | Toyota Motor Corp.                           | (1,000)                        | 20.12.2034            | ¥ 203.900                 | (109)                                    | 25                                              | (84)      | (0,03)                  |
| JPM        | South Korea Government<br>International Bond | (1,000)                        | 20.06.2030            | \$ 1.330                  | (42)                                     | (3)                                             | (45)      | (0,02)                  |
|            | Toyota Motor Corp.                           | (1,000)                        | 20.12.2029            | ¥ 175.000                 | (51)                                     | 9                                               | (42)      | (0,02)                  |
| MYC        | South Korea Government<br>International Bond | (1,000)                        | 20.12.2034            | \$ 1.000                  | (48)                                     | (5)                                             | (53)      | (0,02)                  |
|            |                                              |                                |                       |                           | \$ (418)                                 | \$ 39                                           | \$ (379)  | (0,15)                  |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                              | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| BPS        | Indonesia Government<br>International Bond   | 1,000 %                        | 20.06.2030            | \$ 200                    | \$ 1                                     | \$ 1                                            | \$ 2      | 0,00                    |
|            | Philippines Government International<br>Bond | 1,000                          | 20.06.2030            | 1.100                     | 12                                       | 6                                               | 18        | 0,01                    |
| DBL        | Ping An Insurance Group Co. of<br>China Ltd. | 1,000                          | 20.06.2028            | 1.100                     | (3)                                      | 0                                               | (3)       | 0,00                    |
| GST        | Alibaba Group Holding Ltd.                   | 1,000                          | 20.06.2029            | 2.000                     | 10                                       | 13                                              | 23        | 0,01                    |
|            | Indonesia Government<br>International Bond   | 1,000                          | 20.06.2030            | 600                       | 2                                        | 4                                               | 6         | 0,00                    |
|            |                                              |                                |                       |                           | \$ 22                                    | \$ 24                                           | \$ 46     | 0,02                    |

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

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

### ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------------|-------------------------|--------------------|------------------|------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| BPS        | Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,500 %            | 17.09.2030       | MYR 830    | \$ (1)                                   | \$ (2)                                          | \$ (3)    | 0,00                    |

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

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | 1.863 \$                 | 259 \$                           | 0 \$                               | (2) \$                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.090 AUD                | 3.218 AUD                        | 19                                 | 19                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 28 €                     | 25 €                             | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 3.218 \$                 | 2.091 AUD                        | 0                                  | (19)                                                 | (0,01)                  |
| BOA        | 08.2025          | CNH                    | 2.328                    | 323                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 3.101                    | 3.526                            | 0                                  | (114)                                                | (0,05)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 99.753                   | 73                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.366 KRW                | 1.848.861                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 128 SGD                  | 164                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 164 \$                   | 128                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 258 TWD                  | 8.296                            | 30                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 370 \$                   | 47                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | THB                    | 279                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 1.476                    | 37                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 7.565                    | 233                              | 0                                  | (28)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 157 IDR                  | 2.560.137                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 46 TWD                   | 1.383                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 6.223                    | 865                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY                    | 2.461                    | 59                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 6.697                    | 205                              | 0                                  | (27)                                                 | (0,01)                  |
| BRC        | 08.2025          | \$                     | 185 INR                  | 16.121                           | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 243 \$                   | 276                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 684                      | 931                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 820                      | 236                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 117 ILS                  | 394                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 13 ¥                     | 1.882                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.265 MYR                | 5.337                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 93 PLN                   | 349                              | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 36 TRY                   | 1.476                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 50 TWD                   | 1.463                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 931 £                    | 684                              | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 59 TRY                   | 2.461                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | CNY                    | 747 \$                   | 104                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 1.028.572                | 750                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 2.735                    | 82                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 11.603                   | 357                              | 0                                  | (43)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 602 IDR                  | 9.798.758                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 274 SGD                  | 352                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 593 \$                   | 82                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 233                      | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 39.162                   | 1.217                            | 0                                  | (144)                                                | (0,06)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.389 INR                | 119.700                          | 5                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 398 \$                   | 115                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 334                      | 260                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.896 €                  | 3.358                            | 45                                 | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 90 IDR                   | 1.472.715                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 45 TWD                   | 1.331                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 3.351 \$                 | 3.896                            | 0                                  | (46)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 644 INR                  | 55.546                           | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 34                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 3.117                    | 2.011                            | 0                                  | (32)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF                    | 1.135                    | 1.379                            | 0                                  | (48)                                                 | (0,02)                  |
| FAR        | 07.2025          | CNH                    | 948                      | 132                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 352                      | 45                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 349.968                  | 2.404                            | 0                                  | (19)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | SGD                    | 236                      | 183                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------------|
| GLM        | 07.2025          | \$                     | 1.416 CHF                | 1.134                            | \$ 8                               | \$ 0                                                 | \$ 8 0,00            |
|            | 07.2025          |                        | 4.099 ¥                  | 588.080                          | 0                                  | (28)                                                 | (28) (0,01)          |
|            | 07.2025          |                        | 183 SGD                  | 234                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | CHF                    | 1.129 \$                 | 1.416                            | 0                                  | (8)                                                  | (8) 0,00             |
|            | 08.2025          | CNH                    | 434                      | 61                               | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | SGD                    | 233                      | 183                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | \$                     | 308 INR                  | 26.603                           | 2                                  | 0                                                    | 2 0,00               |
|            | 08.2025          |                        | 2.404 ¥                  | 348.681                          | 19                                 | 0                                                    | 19 0,01              |
|            | 09.2025          |                        | 1.459 MXN                | 28.400                           | 33                                 | 0                                                    | 33 0,01              |
|            | 07.2025          | HKD                    | 40 \$                    | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | \$                     | 143 IDR                  | 2.324.303                        | 1                                  | 0                                                    | 1 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 13 MYR                   | 55                               | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 101 SGD                  | 129                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 30 TWD                   | 972                              | 4                                  | 0                                                    | 4 0,00               |
| IND<br>JPM | 08.2025          | SGD                    | 128 \$                   | 101                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | TWD                    | 5.371                    | 184                              | 0                                  | (3)                                                  | (3) 0,00             |
|            | 07.2025          | CNH                    | 1.796                    | 249                              | 0                                  | (2)                                                  | (2) 0,00             |
|            | 07.2025          | KRW                    | 46.819                   | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | PHP                    | 116.463                  | 2.085                            | 21                                 | 0                                                    | 21 0,01              |
|            | 07.2025          | SGD                    | 866                      | 674                              | 0                                  | (6)                                                  | (6) 0,00             |
|            | 07.2025          | TWD                    | 7.655                    | 235                              | 0                                  | (28)                                                 | (28) (0,01)          |
|            | 07.2025          | \$                     | 999 PLN                  | 3.752                            | 39                                 | 0                                                    | 39 0,02              |
|            | 07.2025          |                        | 84 SGD                   | 108                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | CNH                    | 2.140 \$                 | 297                              | 0                                  | (3)                                                  | (3) 0,00             |
|            | 08.2025          | SGD                    | 107                      | 84                               | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | TWD                    | 5.927                    | 181                              | 0                                  | (25)                                                 | (25) (0,01)          |
|            | 08.2025          | \$                     | 207 INR                  | 17.980                           | 2                                  | 0                                                    | 2 0,00               |
|            | 07.2025          | CAD                    | 2.862 \$                 | 2.084                            | 0                                  | (14)                                                 | (14) (0,01)          |
|            | 07.2025          | CNH                    | 861                      | 119                              | 0                                  | (1)                                                  | (1) 0,00             |
| MBC        | 07.2025          | €                      | 39                       | 45                               | 0                                  | (1)                                                  | (1) 0,00             |
|            | 07.2025          | HKD                    | 2.279                    | 291                              | 1                                  | 0                                                    | 1 0,00               |
|            | 07.2025          | ¥                      | 10.600                   | 73                               | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | PHP                    | 65.747                   | 1.178                            | 12                                 | 0                                                    | 12 0,00              |
|            | 07.2025          | SGD                    | 2.831                    | 2.206                            | 0                                  | (17)                                                 | (17) (0,01)          |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.365                    | 41                               | 0                                  | (1)                                                  | (1) 0,00             |
|            | 07.2025          | TWD                    | 3.887                    | 119                              | 0                                  | (15)                                                 | (15) (0,01)          |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.083 CAD                | 2.863                            | 15                                 | 0                                                    | 15 0,01              |
|            | 07.2025          |                        | 120 IDR                  | 1.951.687                        | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 317 ¥                    | 45.549                           | 0                                  | (2)                                                  | (2) 0,00             |
|            | 07.2025          |                        | 716 PLN                  | 2.682                            | 26                                 | 0                                                    | 26 0,01              |
|            | 07.2025          |                        | 2.219 SGD                | 2.870                            | 34                                 | 0                                                    | 34 0,01              |
|            | 07.2025          |                        | 3 TWD                    | 101                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | CAD                    | 2.858 \$                 | 2.083                            | 0                                  | (15)                                                 | (15) (0,01)          |
|            | 08.2025          | CNH                    | 863                      | 119                              | 0                                  | (1)                                                  | (1) 0,00             |
| MYI        | 08.2025          | SGD                    | 2.863                    | 2.219                            | 0                                  | (34)                                                 | (34) (0,01)          |
|            | 08.2025          | TWD                    | 10.183                   | 316                              | 0                                  | (38)                                                 | (38) (0,01)          |
|            | 07.2025          | ¥                      | 110.766                  | 760                              | 0                                  | (7)                                                  | (7) 0,00             |
|            | 07.2025          | NOK                    | 463                      | 46                               | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | SGD                    | 461                      | 362                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | \$                     | 2 £                      | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 162 ¥                    | 23.457                           | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | CNH                    | 1.953 \$                 | 270                              | 0                                  | (4)                                                  | (4) 0,00             |
|            | 08.2025          | \$                     | 760 ¥                    | 110.359                          | 7                                  | 0                                                    | 7 0,00               |
|            | 08.2025          |                        | 46 NOK                   | 462                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | ILS                    | 6 \$                     | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | \$                     | 105 CNY                  | 749                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 663 IDR                  | 10.809.608                       | 2                                  | 0                                                    | 2 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 443 SGD                  | 572                              | 6                                  | 0                                                    | 6 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 136 TWD                  | 4.042                            | 3                                  | 0                                                    | 3 0,00               |
| SCX        | 08.2025          | CNH                    | 2.208 \$                 | 309                              | 0                                  | (1)                                                  | (1) 0,00             |
|            | 08.2025          | CNY                    | 747                      | 105                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | SGD                    | 570                      | 443                              | 0                                  | (6)                                                  | (6) 0,00             |
|            | 08.2025          | TWD                    | 2.220                    | 68                               | 0                                  | (9)                                                  | (9) 0,00             |
|            | 08.2025          | \$                     | 217 INR                  | 18.637                           | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | ¥                      | 16.174 \$                | 112                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | SGD                    | 2                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          | TWD                    | 6.159                    | 188                              | 0                                  | (26)                                                 | (26) (0,01)          |
|            | 08.2025          | \$                     | 1 INR                    | 107                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 08.2025          |                        | 112 ¥                    | 16.115                           | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          |                        | 926 £                    | 684                              | 11                                 | 0                                                    | 11 0,00              |
|            | 08.2025          | SGD                    | 279 \$                   | 219                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | HKD                    | 57                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | ILS                    | 60                       | 17                               | 0                                  | (1)                                                  | (1) 0,00             |
|            | 07.2025          | \$                     | 106 ¥                    | 15.305                           | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
| WST        | 07.2025          |                        | 50 NOK                   | 511                              | 0                                  | 0                                                    | 0 0,00               |
|            | 07.2025          | AUD                    | 101 \$                   | 65                               | 0                                  | (1)                                                  | (1) 0,00             |
|            | 07.2025          | ¥                      | 185.847                  | 1.291                            | 4                                  | 0                                                    | 4 0,00               |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.291 ¥                  | 185.163                          | 0                                  | (4)                                                  | (4) 0,00             |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$ 380                             | \$ (883)                                             | \$ (503) (0,20)      |



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

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |      |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | 1.995                    | \$                               | 2.336                              | \$ 0                                                 | (6)                     | \$ (6) | 0,00 |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.137                    | €                                | 1.881                              | 71                                                   | 0                       | 71     | 0,03 |
|            | 08.2025          |                        | 2.341                    |                                  | 1.995                              | 6                                                    | 0                       | 6      | 0,00 |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 16                       | \$                               | 19                                 | 0                                                    | 0                       | 0      | 0,00 |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.268                    | €                                | 1.994                              | 73                                                   | 0                       | 73     | 0,03 |
| BPS        | 07.2025          |                        | 12                       |                                  | 10                                 | 0                                                    | 0                       | 0      | 0,00 |
| BRC        | 07.2025          |                        | 2.263                    |                                  | 1.992                              | 76                                                   | 0                       | 76     | 0,03 |
| CBK        | 07.2025          | €                      | 69                       | \$                               | 79                                 | 0                                                    | (2)                     | (2)    | 0,00 |
| MBC        | 07.2025          |                        | 17                       |                                  | 20                                 | 0                                                    | 0                       | 0      | 0,00 |
|            | 07.2025          | \$                     | 52                       | €                                | 45                                 | 1                                                    | 0                       | 1      | 0,00 |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 227                                | \$ (8)                                               | \$                      | 219    | 0,09 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GDF ("negated") ausschließlich die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BRC        | 07.2025          | £                   | 131                   | \$                            | 178                             | \$ 0 (1)                                       | \$ (1) 0,00          |
|            | 07.2025          | \$                  | 174                   | £                             | 129                             | 3 0                                            | 3 0,00               |
|            | 08.2025          |                     | 177                   |                               | 130                             | 1 0                                            | 1 0,00               |
| MBC        | 07.2025          |                     | 166                   |                               | 123                             | 3 0                                            | 3 0,00               |
|            | 07.2025          | £                   | 129                   | \$                            | 176                             | 0 0                                            | 0 0,00               |
| SSB        | 07.2025          | \$                  | 174                   | £                             | 128                             | 2 0                                            | 2 0,00               |
|            | 08.2025          |                     | 177                   |                               | 129                             | 0 0                                            | 0 0,00               |
|            |                  |                     |                       |                               | \$ 9                            | \$ (1)                                         | \$ 8 0,00            |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Zu zahlende Währung |                  |                     |        |                       |        |                               |       |                                 |        | Zu erhaltende Währung                          |      |                      |  |  |  |  |  |  |  | Nicht realisierte Wertzunahme |  |  |  |  |  |  |  |  |  | Nicht realisierte (Wertabnahme) |  |  |  |  |  |  |  |  |  | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) |  |  |  |  |  |  |  |  |  | % des Nettovermögens |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|---------------------|------------------|---------------------|--------|-----------------------|--------|-------------------------------|-------|---------------------------------|--------|------------------------------------------------|------|----------------------|--|--|--|--|--|--|--|-------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|---------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|------------------------------------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|----------------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| Kontrahent          | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung |        | Zu erhaltende Währung |        | Nicht realisierte Wertzunahme |       | Nicht realisierte (Wertabnahme) |        | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) |      | % des Nettovermögens |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| BOA                 | 07.2025          | SGD                 | 7.231  | \$                    | 5.647  | \$                            | 0     | \$                              | (30)   | \$                                             | (30) | (0,01)               |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 07.2025          | \$                  | 15.328 | SGD                   | 19.757 | 184                           | 0     | 184                             | 0,07   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 08.2025          |                     | 5.647  |                       | 7.214  | 31                            | 0     | 31                              | 0,01   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| BRC                 | 07.2025          |                     | 564    |                       | 726    | 6                             | 0     | 6                               | 0,00   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 07.2025          |                     | 714    |                       | 915    | 5                             | 0     | 5                               | 0,00   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| FAR                 | 07.2025          | SGD                 | 17.934 | \$                    | 14.061 | 0                             | (20)  | (20)                            | (0,01) |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 07.2025          | \$                  | 15.329 | SGD                   | 19.724 | 157                           | 0     | 157                             | 0,06   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 08.2025          |                     | 14.061 |                       | 17.891 | 22                            | 0     | 22                              | 0,01   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| GLM                 | 07.2025          | SGD                 | 7.860  | \$                    | 6.166  | 0                             | (5)   | (5)                             | 0,00   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 08.2025          | \$                  | 6.166  | SGD                   | 7.841  | 6                             | 0     | 6                               | 0,00   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| MBC                 | 07.2025          | SGD                 | 18.111 | \$                    | 14.005 | 0                             | (215) | (215)                           | (0,08) |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 07.2025          | \$                  | 11.693 | SGD                   | 14.998 | 83                            | 0     | 83                              | 0,03   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 08.2025          |                     | 13.855 |                       | 17.876 | 216                           | 0     | 216                             | 0,09   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| MYI                 | 07.2025          |                     | 708    |                       | 910    | 6                             | 0     | 6                               | 0,00   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 07.2025          | SGD                 | 3.048  | \$                    | 2.363  | 0                             | (31)  | (31)                            | (0,01) |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| SCX                 | 08.2025          | \$                  | 2.363  | SGD                   | 3.041  | 31                            | 0     | 31                              | 0,01   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     | 07.2025          |                     | 3.833  |                       | 4.937  | 43                            | 0     | 43                              | 0,02   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| SSB                 | 07.2025          |                     | 181    |                       | 231    | 0                             | 0     | 0                               | 0,00   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| UAG                 | 07.2025          |                     | 79     |                       | 101    | 1                             | 0     | 1                               | 0,00   |                                                |      |                      |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|                     |                  |                     |        |                       |        | \$                            | 791   | \$                              | (301)  | \$                                             | 490  | 0,19                 |  |  |  |  |  |  |  |                               |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                                                |  |  |  |  |  |  |  |  |  |                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|                                  |  |  |  |  |  |    |         |        |
|----------------------------------|--|--|--|--|--|----|---------|--------|
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |  |  |  |  |  | \$ | (116)   | (0,05) |
| Summe Anlagen                    |  |  |  |  |  | \$ | 249.107 | 98,70  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |  |  |  |  |  | \$ | 3.269   | 1,30   |
| Nettovermögen                    |  |  |  |  |  | \$ | 252.376 | 100,00 |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,65 %):

| Emittentenbeschreibung | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum               | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------------------|---------|------------------|-------------------------|----------|-----------|----------------------|
| Flourish Century       | 6,600 % | 04.02.2022       | 25.08.2021 - 27.08.2021 | \$ 1.676 | \$ 60     | 0,02                 |
| Grab Holdings Ltd.     | 0,000   | 15.06.2030       | 10.06.2025              | 1.000    | 1.072     | 0,43                 |
|                        |         |                  |                         | \$ 2.676 | \$ 1.132  | 0,45                 |

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 829 (31. Dezember 2024: USD null) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 2.087 (31. Dezember 2024: USD 1.565) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von USD 50 (31. Dezember 2024: USD 360) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 225.501                                                      | \$ 940                                                       | \$ 226.441 |
| Investmentfonds               | 22.052                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 22.052     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 6                                                                           | 608                                                             | 0                                                            | 614        |
| Summen                        | \$ 22.058                                                                   | \$ 226.109                                                      | \$ 940                                                       | \$ 249.107 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 199.026                                                      | \$ 106                                                       | \$ 199.132 |
| Investmentfonds               | 21.506                                                                      | 1.012                                                           | 0                                                            | 22.518     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 15                                                                          | (1.716)                                                         | 0                                                            | (1.701)    |
| Summen                        | \$ 21.521                                                                   | \$ 198.322                                                      | \$ 106                                                       | \$ 219.949 |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|-----------------------|------------------|--------------|------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                | 3,500 %    | 23.06.2025            | 01.08.2025       | \$ (161)     | \$ (161)                                       | (0,06)                  |
|                                    | 4,300      | 18.06.2025            | 01.08.2025       | (540)        | (541)                                          | (0,22)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                       |                  |              | \$ (702)                                       | (0,28)                  |

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                           |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                           |                                     |
|------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 67                               | \$ 0                                      | \$ 67                               | \$ (113)                            | \$ 0                                      | \$ (113)                            |
| BOA        | 174                                 | (280)                                     | (106)                               | (31)                                | 0                                         | (31)                                |
| BPS        | (76)                                | 0                                         | (76)                                | (77)                                | 270                                       | 193                                 |
| BRC        | 52                                  | 0                                         | 52                                  | (89)                                | 0                                         | (89)                                |
| CBK        | (232)                               | 0                                         | (232)                               | (29)                                | 0                                         | (29)                                |
| DBL        | (3)                                 | 0                                         | (3)                                 | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               |
| DUB        | (56)                                | 0                                         | (56)                                | 39                                  | 0                                         | 39                                  |
| FAR        | 83                                  | 0                                         | 83                                  | (87)                                | 0                                         | (87)                                |
| GLM        | 12                                  | 0                                         | 12                                  | (29)                                | 0                                         | (29)                                |
| GST        | (55)                                | 50                                        | (5)                                 | (91)                                | 90                                        | (1)                                 |
| IND        | (3)                                 | 0                                         | (3)                                 | 1                                   | 0                                         | 1                                   |
| JPM        | (89)                                | 0                                         | (89)                                | 21                                  | 0                                         | 21                                  |
| MBC        | 37                                  | 0                                         | 37                                  | (169)                               | 0                                         | (169)                               |
| MYC        | (53)                                | 0                                         | (53)                                | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               |
| MYI        | 2                                   | (20)                                      | (18)                                | (23)                                | 0                                         | (23)                                |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               | 16                                  | 0                                         | 16                                  |
| SCX        | (5)                                 | 0                                         | (5)                                 | (100)                               | 0                                         | (100)                               |
| SOG        | 17                                  | 0                                         | 17                                  | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               |



| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                           |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                           |                                     |
|------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| SSB        | \$ 13                               | \$ 0                                      | \$ 13                               | \$ k. A.                            | \$ k. A.                                  | \$ k. A.                            |
| UAG        | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               | (49)                                | 0                                         | (49)                                |
| WST        | (1)                                 | 0                                         | (1)                                 | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 74,06             | 83,74             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 13,36             | 2,05              |
| Investmentfonds                                                        | 8,51              | 9,70              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,29              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,04              | 0,03              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,57              | 0,14              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 3,17              | 4,34              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                                                             | 1,75              | 1,71              |
| Bermuda                                                                                | 0,42              | 0,55              |
| Brasilien                                                                              | 0,53              | k. A.             |
| Kanada                                                                                 | 0,24              | k. A.             |
| Kaimaninseln                                                                           | 11,52             | 12,39             |
| Chile                                                                                  | 0,25              | k. A.             |
| China                                                                                  | 1,93              | 2,07              |
| Kolumbien                                                                              | 0,47              | k. A.             |
| Frankreich                                                                             | 0,27              | 0,26              |
| Hongkong                                                                               | 7,04              | 7,41              |
| Indien                                                                                 | 8,80              | 8,44              |
| Indonesien                                                                             | 8,16              | 7,63              |
| Japan                                                                                  | 1,08              | 0,48              |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 0,50              | 0,64              |
| Luxemburg                                                                              | 0,96              | 0,43              |
| Malaysia                                                                               | 2,16              | 1,48              |
| Mauritius                                                                              | 2,26              | 2,99              |
| Mexiko                                                                                 | 1,12              | 0,43              |
| Mongolei                                                                               | 0,78              | 0,90              |
| Niederlande                                                                            | 1,99              | 1,04              |
| Neuseeland                                                                             | 0,51              | 0,52              |
| Pakistan                                                                               | 1,98              | 2,06              |
| Peru                                                                                   | 0,32              | 0,09              |
| Philippinen                                                                            | 6,25              | 7,00              |
| Singapur                                                                               | 2,72              | 2,90              |
| Südafrika                                                                              | 0,22              | 0,24              |
| Südkorea                                                                               | 7,47              | 6,87              |
| Spanien                                                                                | 0,36              | k. A.             |
| Sri Lanka                                                                              | 2,06              | 2,31              |
| Thailand                                                                               | 2,53              | 2,84              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 0,69              | 0,92              |
| Großbritannien                                                                         | 5,99              | 5,97              |
| USA                                                                                    | 2,48              | 1,76              |
| Vietnam                                                                                | 0,98              | 1,18              |
| Jungfernseln (Britisch)                                                                | 2,84              | 3,63              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,10              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                                        | 8,74              | 9,85              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,29              | (0,13)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzverkauf | k. A.             | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes - Schutzverkauf                                 | 0,01              | k. A.             |
| Zinsswaps                                                                              | (0,02)            | (0,26)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes                                             | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes                                             | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | (0,15)            | (0,12)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzverkauf | 0,02              | (0,01)            |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | k. A.             | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,20)            | 0,08              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,28              | (0,30)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | 1,30              | 3,75              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

Halbjahresbericht | 30. Juni 2025 143

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

| BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Centene Corp.<br>2,500 % fällig am 01.03.2031                                      | \$ 100         | \$ 86                    | 0,00                              | Verisk Analytics, Inc.<br>5,250 % fällig am 15.03.2035                  | \$ 2.100       | \$ 2.113                 | 0,08                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055 | \$ 113.418     | \$ 116.946               | 4,59                              |
| 3,375 % fällig am 15.02.2030                                                       | 2.300          | 2.120                    | 0,08                              | Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,050 % fällig am 27.03.2028 | 1.500          | 1.509                    | 0,06                              | 7,000 % fällig am 01.09.2055 | 75             | 79                       | 0,00                              |
| 4,250 % fällig am 15.12.2027                                                       | 1.500          | 1.478                    | 0,06                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| CGI, Inc.<br>4,950 % fällig am 14.03.2030                                          | 400            | 404                      | 0,02                              | Windstream Services LLC<br>8,250 % fällig am 01.10.2031                 | 1.200          | 1.258                    | 0,05                              |                              |                |                          |                                   |
| Choice Hotels International, Inc.<br>5,850 % fällig am 01.08.2034                  | 100            | 101                      | 0,01                              |                                                                         |                | 56.090                   | 2,21                              |                              |                |                          |                                   |
| Clarivate Corp. (6,500 % bar oder 0,750 % PIK)<br>7,250 % fällig am 31.03.2031 (c) | 1.083          | 763                      | 0,03                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| DISH DBS Corp.<br>5,250 % fällig am 01.12.2026                                     | 1.500          | 1.364                    | 0,05                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Elevance Health, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.02.2030                              | 100            | 101                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Energy Transfer LP<br>3,750 % fällig am 15.05.2030                                 | 2.100          | 2.016                    | 0,08                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 5,200 % fällig am 01.04.2030                                                       | 1.400          | 1.432                    | 0,06                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Harbour Energy PLC<br>6,327 % fällig am 01.04.2035                                 | 300            | 298                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| HCA, Inc.<br>5,250 % fällig am 01.03.2030                                          | 3.300          | 3.384                    | 0,13                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU<br>3,375 % fällig am 21.04.2029        | € 1.500        | 1.785                    | 0,07                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Imperial Brands Finance PLC<br>3,875 % fällig am 12.02.2034                        | 200            | 231                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 30.06.2028 (b)                                                   | \$ 200         | 200                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Informa PLC<br>3,000 % fällig am 23.10.2027                                        | € 600          | 711                      | 0,03                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 23.10.2030                                                       | 600            | 703                      | 0,03                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Intelsat Jackson Holdings S.A.<br>6,500 % fällig am 15.03.2030                     | \$ 1.300       | 1.329                    | 0,05                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| LG Energy Solution Ltd.<br>5,250 % fällig am 02.04.2028                            | 300            | 301                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Marriott International, Inc.<br>5,100 % fällig am 15.04.2032                       | 900            | 911                      | 0,04                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Mars, Inc.<br>4,450 % fällig am 01.03.2027                                         | 300            | 301                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 4,600 % fällig am 01.03.2028                                                       | 900            | 907                      | 0,04                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 4,800 % fällig am 01.03.2030                                                       | 400            | 405                      | 0,02                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.03.2032                                                       | 300            | 304                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| MPH Acquisition Holdings LLC<br>5,750 % fällig am 31.12.2030                       | 125            | 103                      | 0,00                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 11,500 % fällig am 31.12.2030                                                      | 192            | 190                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| NetApp, Inc.<br>5,500 % fällig am 17.03.2032                                       | 100            | 103                      | 0,00                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 5,700 % fällig am 17.03.2035                                                       | 200            | 205                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Norsk Hydro ASA<br>3,625 % fällig am 23.01.2032                                    | € 1.600        | 1.889                    | 0,08                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Oracle Corp.<br>4,800 % fällig am 03.08.2028                                       | \$ 500         | 508                      | 0,02                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Petroleos Mexicanos<br>6,500 % fällig am 02.06.2041                                | 2.500          | 1.859                    | 0,07                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust<br>4,100 % fällig am 01.10.2029                 | 1.325          | 1.218                    | 0,05                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Synopsys, Inc.<br>4,550 % fällig am 01.04.2027                                     | 300            | 302                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 4,650 % fällig am 01.04.2028                                                       | 100            | 101                      | 0,00                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 4,850 % fällig am 01.04.2030                                                       | 200            | 203                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.04.2032                                                       | 300            | 304                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 5,150 % fällig am 01.04.2035                                                       | 200            | 202                      | 0,01                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC<br>9,750 % fällig am 10.10.2027               | £ 63           | 95                       | 0,00                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027                                                       | 57             | 86                       | 0,00                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Thames Water Utilities Ltd.<br>0,000 % fällig am 22.03.2027 (e)                    | 18             | 21                       | 0,00                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| United Airlines, Inc.<br>4,625 % fällig am 15.04.2029 (l)                          | \$ 700         | 680                      | 0,03                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Var Energi ASA<br>3,875 % fällig am 12.03.2031                                     | € 2.100        | 2.477                    | 0,10                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>3,875 % fällig am 15.08.2029                  | \$ 2.800       | 2.642                    | 0,10                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| Venture Global LNG, Inc.<br>7,000 % fällig am 15.01.2030                           | 1.000          | 1.012                    | 0,04                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| 9,500 % fällig am 01.02.2029 (l)                                                   | 1.200          | 1.308                    | 0,05                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |
| VeriSign, Inc.<br>5,250 % fällig am 01.06.2032                                     | 2.100          | 2.141                    | 0,09                              |                                                                         |                |                          |                                   |                              |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                                |                |                          |                                   | <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>     |                |                          |                                   | <b>Ares European CLO DAC</b>                    |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.04.2037                                      | \$ 1.426       | \$ 1.262                 | 0,05                              | 4,694 % fällig am 25.12.2036                                 | \$ 172         | \$ 158                   | 0,01                              | 3,086 % fällig am 20.04.2032                    | € 277          | \$ 325                   | 0,01                              |
| 4,994 % fällig am 25.07.2035                                      | 83             | 60                       | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.05.2037                                 | 7.840          | 7.339                    | 0,29                              | <b>Bain Capital Euro CLO DAC</b>                |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037                                      | 1.501          | 547                      | 0,02                              | 6,084 % fällig am 25.12.2034                                 | 545            | 541                      | 0,02                              | 3,486 % fällig am 20.04.2032                    | 1.000          | 1.176                    | 0,05                              |
| <b>Lehman XS Trust</b>                                            |                |                          |                                   | 6,384 % fällig am 25.08.2035                                 | 750            | 697                      | 0,03                              | <b>Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.</b> |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.08.2046                                      | 868            | 835                      | 0,03                              | <b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>                      |                |                          |                                   | 5,699 % fällig am 11.04.2045                    | \$ 2.000       | 1.999                    | 0,08                              |
| <b>MA Money Pinnacle Residential Securitisation Trust</b>         |                |                          |                                   | 5,534 % fällig am 25.05.2037                                 | 146            | 143                      | 0,01                              | 5,709 % fällig am 11.04.2045                    | 2.300          | 2.299                    | 0,09                              |
| 4,535 % fällig am 15.04.2066AUD                                   | 188            | 123                      | 0,01                              | <b>Fremont Home Loan Trust</b>                               |                |                          |                                   | <b>Blackrock European CLO DAC</b>               |                |                          |                                   |
| <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>                      |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.10.2036                                 | 6.193          | 2.477                    | 0,10                              | 3,156 % fällig am 20.01.2036                    | € 2.000        | 2.343                    | 0,09                              |
| 4,914 % fällig am 25.05.2037                                      | \$ 521         | 205                      | 0,01                              | 5,499 % fällig am 25.06.2035                                 | 301            | 296                      | 0,01                              | <b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Merrion Square Residential DAC</b>                             |                |                          |                                   | <b>GSAMP Trust</b>                                           |                |                          |                                   | 3,529 % fällig am 15.04.2031                    | 1.100          | 1.278                    | 0,05                              |
| 2,999 % fällig am 24.03.2081                                      | € 1.517        | 1.783                    | 0,07                              | 5,109 % fällig am 25.11.2035                                 | 220            | 214                      | 0,01                              | <b>Bosphorus CLO DAC</b>                        |                |                          |                                   |
| <b>Newgate Funding PLC</b>                                        |                |                          |                                   | <b>Home Equity Asset Trust</b>                               |                |                          |                                   | 4,149 % fällig am 25.05.2034                    | 2.200          | 2.590                    | 0,10                              |
| 4,557 % fällig am 01.12.2050                                      | £ 2.074        | 2.702                    | 0,11                              | 5,109 % fällig am 25.02.2036                                 | 1.856          | 1.822                    | 0,07                              | <b>Catamaran CLO Ltd.</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>                     |                |                          |                                   | <b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>                  |                |                          |                                   | 5,634 % fällig am 22.04.2030                    | \$ 153         | 154                      | 0,01                              |
| 4,954 % fällig am 25.06.2046                                      | \$ 1.259       | 283                      | 0,01                              | 4,959 % fällig am 25.02.2036                                 | 1.000          | 850                      | 0,03                              | <b>CIFC European Funding CLO DAC</b>            |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036                                      | 261            | 219                      | 0,01                              | <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>                   |                |                          |                                   | 3,186 % fällig am 18.08.2035                    | € 1.500        | 1.757                    | 0,07                              |
| <b>RMAC Securities PLC</b>                                        |                |                          |                                   | 4,644 % fällig am 25.10.2036                                 | 16             | 16                       | 0,00                              | 3,269 % fällig am 23.11.2034                    | 2.000          | 2.346                    | 0,09                              |
| 4,628 % fällig am 12.06.2044                                      | £ 480          | 643                      | 0,03                              | 4,734 % fällig am 25.03.2037                                 | 1.000          | 973                      | 0,04                              | <b>Cumulus Static CLO DAC</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>Stratton Hawksmoor PLC</b>                                     |                |                          |                                   | <b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>                        |                |                          |                                   | 4,043 % fällig am 15.11.2033                    | 1.300          | 1.529                    | 0,06                              |
| 5,737 % fällig am 25.02.2053                                      | 1.800          | 2.484                    | 0,10                              | 5,034 % fällig am 25.01.2036                                 | 1.894          | 1.749                    | 0,07                              | <b>CVC Cordatus Loan Fund DAC</b>               |                |                          |                                   |
| <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                              |                |                          |                                   | 5,709 % fällig am 25.02.2035                                 | 359            | 353                      | 0,01                              | 3,699 % fällig am 26.08.2032                    | 2.275          | 2.677                    | 0,11                              |
| 5,139 % fällig am 28.06.2050                                      | 1.000          | 1.372                    | 0,05                              | <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>                   |                |                          |                                   | <b>CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC</b>   |                |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>                |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.05.2037                                 | 430            | 418                      | 0,01                              | 3,683 % fällig am 15.08.2033                    | 4.400          | 5.173                    | 0,20                              |
| 4,734 % fällig am 25.02.2037                                      | \$ 302         | 289                      | 0,01                              | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                |                |                          |                                   | <b>DB Master Finance LLC</b>                    |                |                          |                                   |
| <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                            |                |                          |                                   | 5,364 % fällig am 25.07.2035                                 | 500            | 501                      | 0,02                              | 2,045 % fällig am 20.11.2051                    | \$ 4.246       | 4.091                    | 0,16                              |
| 5,637 % fällig am 20.02.2054                                      | £ 936          | 1.286                    | 0,05                              | <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>                |                |                          |                                   | 2,791 % fällig am 20.11.2051                    | 4.632          | 4.052                    | 0,16                              |
| 7,798 % fällig am 20.07.2053                                      | 1.250          | 1.731                    | 0,07                              | 4,544 % fällig am 25.03.2037                                 | 1.265          | 539                      | 0,02                              | 4,021 % fällig am 20.05.2049                    | 9.142          | 9.067                    | 0,36                              |
| 8,798 % fällig am 20.07.2053                                      | 1.250          | 1.732                    | 0,07                              | 4,564 % fällig am 25.10.2036                                 | 73             | 65                       | 0,00                              | <b>Domino's Pizza Master Issuer LLC</b>         |                |                          |                                   |
| <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                                   |                |                          |                                   | 4,574 % fällig am 25.10.2036                                 | 998            | 436                      | 0,02                              | 3,151 % fällig am 25.04.2051                    | 4.863          | 4.389                    | 0,17                              |
| 5,398 % fällig am 20.01.2066                                      | 866            | 1.189                    | 0,05                              | 4,734 % fällig am 25.06.2036                                 | 217            | 188                      | 0,01                              | <b>Dryden Euro CLO DAC</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Trinity Square PLC</b>                                         |                |                          |                                   | 5,684 % fällig am 25.07.2037                                 | 800            | 712                      | 0,03                              | 3,236 % fällig am 18.04.2033                    | € 1.271        | 1.491                    | 0,06                              |
| 5,617 % fällig am 15.07.2059                                      | 1.900          | 2.602                    | 0,10                              | <b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>  |                |                          |                                   | 3,779 % fällig am 15.04.2034                    | 1.000          | 1.171                    | 0,05                              |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>              |                |                          |                                   | 5,064 % fällig am 25.02.2036                                 | 1.147          | 1.072                    | 0,04                              | <b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b>   |                |                          |                                   |
| 5,094 % fällig am 25.01.2045                                      | \$ 1.671       | 1.679                    | 0,07                              | <b>Option One Mortgage Loan Trust</b>                        |                |                          |                                   | 3,256 % fällig am 20.07.2034                    | 4.000          | 4.696                    | 0,18                              |
| 5,234 % fällig am 25.01.2045                                      | 448            | 433                      | 0,02                              | 5,169 % fällig am 25.05.2035                                 | 300            | 290                      | 0,01                              | <b>Harvest CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,354 % fällig am 25.10.2044                                      | 71             | 69                       | 0,00                              | 5,304 % fällig am 25.05.2035                                 | 1.151          | 981                      | 0,04                              | 3,129 % fällig am 15.01.2032                    | 752            | 882                      | 0,03                              |
| <b>Warwick Finance Residential Mortgages PLC</b>                  |                |                          |                                   | <b>People's Choice Home Loan Securities Trust</b>            |                |                          |                                   | <b>Henley CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   |
| 5,889 % fällig am 21.12.2049                                      | £ 2.013        | 2.776                    | 0,11                              | 6,159 % fällig am 25.10.2034                                 | 719            | 651                      | 0,02                              | 3,148 % fällig am 25.04.2034                    | 1.200          | 1.407                    | 0,06                              |
| <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                |                          |                                   | <b>Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust</b>               |                |                          |                                   | <b>Invesco Euro CLO DAC</b>                     |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036                                      | \$ 413         | 297                      | 0,01                              | 4,929 % fällig am 25.07.2036                                 | 208            | 198                      | 0,01                              | 2,929 % fällig am 15.07.2031                    | 370            | 434                      | 0,02                              |
|                                                                   |                | 61.603                   | 2,42                              | <b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>              |                |                          |                                   | <b>Marzio Finance SRL</b>                       |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,684 % fällig am 25.11.2036                                 | 2.579          | 2.308                    | 0,09                              | 2,809 % fällig am 28.05.2049                    | 1.959          | 2.312                    | 0,09                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | <b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>        |                |                          |                                   | <b>OCF Euro CLO DAC</b>                         |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,134 % fällig am 25.05.2037                                 | 108            | 83                       | 0,00                              | 3,116 % fällig am 22.09.2034                    | 815            | 956                      | 0,04                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 25.02.2034                                 | 208            | 215                      | 0,01                              | <b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>  |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | <b>Soundview Home Loan Trust</b>                             |                |                          |                                   | 2,999 % fällig am 15.10.2031                    | 722            | 845                      | 0,03                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.01.2037                                 | 1.256          | 1.218                    | 0,05                              | 4,033 % fällig am 15.05.2034                    | 1.700          | 2.000                    | 0,08                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | <b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>                |                |                          |                                   | <b>Providus CLO DAC</b>                         |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,984 % fällig am 25.09.2034                                 | 2.295          | 2.228                    | 0,09                              | 3,071 % fällig am 20.05.2034                    | 1.500          | 1.750                    | 0,07                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,054 % fällig am 25.01.2036                                 | 351            | 331                      | 0,01                              | <b>Rockford Tower Europe CLO DAC</b>            |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,064 % fällig am 25.11.2035                                 | 428            | 420                      | 0,02                              | 3,561 % fällig am 24.04.2037                    | 1.300          | 1.527                    | 0,06                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b> |                |                          |                                   | <b>Sculptor European CLO DAC</b>                |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,004 % fällig am 25.10.2036                                 | 133            | 133                      | 0,01                              | 3,129 % fällig am 15.04.2034                    | 1.300          | 1.520                    | 0,06                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,229 % fällig am 25.02.2036                                 | 200            | 197                      | 0,01                              | 3,329 % fällig am 15.10.2034                    | 1.000          | 1.171                    | 0,05                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,439 % fällig am 25.11.2035                                 | 567            | 566                      | 0,02                              | <b>Segovia European CLO DAC</b>                 |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | <b>WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust</b>             |                |                          |                                   | 3,116 % fällig am 20.07.2032                    | 635            | 747                      | 0,03                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,604 % fällig am 25.07.2047                                 | 3.052          | 1.770                    | 0,07                              | <b>SLM Student Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,674 % fällig am 25.05.2037                                 | 1.906          | 1.693                    | 0,07                              | 2,558 % fällig am 25.10.2039                    | 1.971          | 2.158                    | 0,08                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,684 % fällig am 25.05.2037                                 | 637            | 566                      | 0,02                              | 2,708 % fällig am 25.07.2039                    | 896            | 993                      | 0,04                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | <b>Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust</b>     |                |                          |                                   | <b>Sound Point CLO Ltd.</b>                     |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,744 % fällig am 25.08.2036                                 | 401            | 387                      | 0,01                              | 5,681 % fällig am 18.04.2031                    | \$ 380         | 381                      | 0,01                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                | 40.650                   | 1,59                              | <b>Sound Point Euro CLO Funding DAC</b>         |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 2,978 % fällig am 25.05.2034                    | € 3.500        | 4.091                    | 0,16                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | <b>Taco Bell Funding LLC</b>                    |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 1,946 % fällig am 25.08.2051                    | \$ 4.323       | 4.124                    | 0,16                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 2,542 % fällig am 25.08.2051                    | 5.620          | 4.825                    | 0,19                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | <b>Tikehau CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 4,079 % fällig am 15.04.2032                    | € 1.014        | 1.194                    | 0,05                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | <b>Toro European CLO DAC</b>                    |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 3,185 % fällig am 12.01.2032                    | 285            | 335                      | 0,01                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 3,269 % fällig am 15.07.2034                    | 1.300          | 1.526                    | 0,06                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | <b>Trinitas Euro CLO DAC</b>                    |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 3,166 % fällig am 20.10.2032                    | 1.325          | 1.556                    | 0,06                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | <b>TSTAT Ltd.</b>                               |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   | 5,419 % fällig am 20.07.2037                    | \$ 622         | 623                      | 0,02                              |



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

| Beschreibung                                                                | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Wingstop Funding LLC<br>2,841 % fällig am 05.12.2050                        | \$ 6.427       | \$ 6.099                 | 0,24                              |
|                                                                             |                | 99.840                   | 3,92                              |
| Sicherheiten für Whole Loans                                                |                |                          |                                   |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>4,869 % fällig am 25.11.2036         | 98             | 98                       | 0,00                              |
| 5,334 % fällig am 25.01.2036                                                | 985            | 977                      | 0,04                              |
| First Franklin Mortgage Loan Trust<br>4,554 % fällig am 25.11.2036          | 460            | 443                      | 0,02                              |
| 5,139 % fällig am 25.11.2036                                                | 1.473          | 1.437                    | 0,06                              |
| 5,334 % fällig am 25.07.2035                                                | 973            | 967                      | 0,04                              |
| 5,379 % fällig am 25.06.2034                                                | 539            | 528                      | 0,02                              |
| Residential Asset Mortgage Products Trust<br>4,784 % fällig am 25.10.2036   | 378            | 369                      | 0,01                              |
|                                                                             |                | 4.819                    | 0,19                              |
|                                                                             |                | 151.500                  | 5,95                              |
| Staatsemissionen                                                            |                |                          |                                   |
| Argentina Government International Bond<br>0,750 % fällig am 09.07.2030     | 1.403          | 1.012                    | 0,04                              |
| 3,500 % fällig am 09.07.2041                                                | 700            | 436                      | 0,02                              |
| 4,125 % fällig am 09.07.2035                                                | 653            | 425                      | 0,02                              |
| Bulgaria Government International Bond<br>3,500 % fällig am 07.05.2034      | € 1.300        | 1.544                    | 0,06                              |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038                                                | 1.300          | 1.556                    | 0,06                              |
| Chile Government International Bond<br>3,750 % fällig am 14.01.2032         | 600            | 718                      | 0,03                              |
| Israel Government International Bond<br>5,375 % fällig am 19.02.2030        | \$ 1.100       | 1.122                    | 0,04                              |
| 5,625 % fällig am 19.02.2035                                                | 1.000          | 1.018                    | 0,04                              |
| Japan Government International Bond<br>1,900 % fällig am 20.06.2044         | ¥ 590.000      | 3.826                    | 0,15                              |
| Magyar Export-Import Bank<br>4,500 % fällig am 27.11.2031                   | € 600          | 716                      | 0,03                              |
| Mexico Government International Bond<br>2,750 % fällig am<br>27.11.2031 (g) | MXN 171.062    | 8.025                    | 0,31                              |
| 4,000 % fällig am<br>30.11.2028 (g)                                         | 1.476          | 77                       | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am<br>24.08.2034 (g)                                         | 59.506         | 2.931                    | 0,11                              |
| 4,625 % fällig am 04.05.2033                                                | € 500          | 587                      | 0,02                              |
| 6,000 % fällig am 13.05.2030                                                | \$ 200         | 207                      | 0,01                              |
| 6,875 % fällig am<br>13.05.2037 (l)                                         | 400            | 418                      | 0,02                              |
| 7,375 % fällig am 13.05.2055                                                | 200            | 207                      | 0,01                              |
| 7,750 % fällig am 29.05.2031                                                | MXN 900        | 45                       | 0,00                              |
| 8,500 % fällig am 01.03.2029                                                | 5.400          | 285                      | 0,01                              |
| 8,500 % fällig am 31.05.2029                                                | 3.600          | 190                      | 0,01                              |
| Peru Government International Bond<br>1,862 % fällig am 01.12.2032          | \$ 1.800       | 1.438                    | 0,06                              |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032                                                | PEN 37.300     | 10.873                   | 0,43                              |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033                                                | 300            | 92                       | 0,00                              |
| 7,600 % fällig am 12.08.2039                                                | 1.900          | 571                      | 0,02                              |
| Poland Government International Bond<br>4,875 % fällig am 12.02.2030        | \$ 1.400       | 1.429                    | 0,06                              |
| Romania Government International Bond<br>5,250 % fällig am 10.03.2030       | € 1.000        | 1.200                    | 0,05                              |
| 5,250 % fällig am 30.05.2032                                                | 1.700          | 1.967                    | 0,08                              |
| 5,625 % fällig am<br>30.05.2037 (l)                                         | 1.700          | 1.881                    | 0,07                              |
| 6,250 % fällig am 10.09.2034                                                | 2.100          | 2.490                    | 0,10                              |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>3,375 % fällig am 05.03.2032  | 400            | 468                      | 0,02                              |
| 3,750 % fällig am 05.03.2037                                                | 500            | 572                      | 0,02                              |
| South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031  | ZAR 185.500    | 9.603                    | 0,38                              |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030                                                | 5.000          | 277                      | 0,01                              |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037                                                | 9.800          | 480                      | 0,02                              |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035                                                | 17.100         | 899                      | 0,03                              |
| 9,000 % fällig am 31.01.2040                                                | 2.700          | 131                      | 0,01                              |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026                                               | 58.550         | 3.418                    | 0,13                              |
| Spain Government International Bond<br>0,700 % fällig am 30.04.2032         | € 5.000        | 5.120                    | 0,20                              |
| Turkey Government International Bond<br>47,469 % fällig am<br>06.09.2028    | TRY 1.400      | 34                       | 0,00                              |
| 49,053 % fällig am<br>20.05.2026                                            | 200            | 5                        | 0,00                              |
| 49,053 % fällig am<br>19.08.2026                                            | 100            | 3                        | 0,00                              |
| 49,053 % fällig am<br>17.05.2028                                            | 29.700         | 724                      | 0,03                              |
|                                                                             |                | 69.020                   | 2,71                              |

| Beschreibung                                                              | Aktien    | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|---------------------------------------------------------------------------|-----------|--------------------------|-----------------------------------|
| Stammaktien                                                               |           |                          |                                   |
| Kommunikationsdienste                                                     |           |                          |                                   |
| Advanced Info Service<br>PCL 'A'                                          | 174.200   | \$ 1.493                 | 0,06                              |
| Alphabet, Inc. 'A'                                                        | 126.227   | 22.245                   | 0,87                              |
| Alphabet, Inc. 'C'                                                        | 114.796   | 20.364                   | 0,80                              |
| Comcast Corp. 'A' (d)                                                     | 313.796   | 11.199                   | 0,44                              |
| Electronic Arts, Inc.<br>Emirates<br>Telecommunications<br>Group Co. PJSC | 42.061    | 6.717                    | 0,26                              |
| Hellenic<br>Telecommunications<br>Organization S.A. (d)                   | 110.157   | 528                      | 0,02                              |
| Indus Towers Ltd. (d)                                                     | 174.385   | 855                      | 0,03                              |
| International Games<br>System Co. Ltd.<br>'C' (d)                         | 43.000    | 1.262                    | 0,05                              |
| Kingsoft Corp. Ltd.                                                       | 135.400   | 708                      | 0,03                              |
| Koninklijke KPN NV                                                        | 566.791   | 2.755                    | 0,11                              |
| Krafton, Inc. (d)                                                         | 2.372     | 637                      | 0,03                              |
| Meta Platforms, Inc. 'A'                                                  | 53.239    | 39.295                   | 1,54                              |
| NetEase, Inc.                                                             | 295.800   | 7.972                    | 0,31                              |
| Ooredoo QPSC                                                              | 99.484    | 350                      | 0,01                              |
| PLDT, Inc.                                                                | 5.895     | 127                      | 0,01                              |
| SK Telecom Co. Ltd.                                                       | 9.149     | 385                      | 0,02                              |
| Telkom Indonesia<br>Persero Tbk PT                                        | 8.006.600 | 1.370                    | 0,05                              |
| Tencent Holdings Ltd.                                                     | 70.800    | 4.562                    | 0,18                              |
| TIM S.A.                                                                  | 144.200   | 583                      | 0,02                              |
| Verizon<br>Communications,<br>Inc. (d)                                    | 489.129   | 21.165                   | 0,83                              |
| Vodacom Group Ltd.                                                        | 88.777    | 683                      | 0,03                              |
| Vodafone Group PLC                                                        | 2.710.947 | 2.897                    | 0,11                              |
| Walt Disney Co.                                                           | 41.208    | 5.110                    | 0,20                              |
|                                                                           |           | 153.676                  | 6,03                              |
| Luxusgüter                                                                |           |                          |                                   |
| Abu Dhabi National Oil<br>Co. for Distribution<br>PJSC                    | 491.813   | 491                      | 0,02                              |
| Airbnb, Inc. 'A' (d)                                                      | 54.474    | 7.209                    | 0,28                              |
| Amazon.com, Inc. (d)                                                      | 211.523   | 46.406                   | 1,82                              |
| Aptiv PLC (d)                                                             | 38.979    | 2.659                    | 0,10                              |
| Booking Holdings, Inc.<br>Bosideng International<br>Holdings Ltd. (d)     | 3.236     | 18.734                   | 0,74                              |
| 570.000                                                                   | 338       | 0,01                     |                                   |
| Canadian Tire Corp.<br>Ltd. 'A' (d)                                       | 7.416     | 1.008                    | 0,04                              |
| Cie Generale des<br>Etablissements<br>Michelin S.C.A.                     | 114.057   | 4.227                    | 0,17                              |
| eBay, Inc.                                                                | 79.165    | 5.895                    | 0,23                              |
| Evolution AB                                                              | 24.888    | 1.962                    | 0,08                              |
| Expedia Group, Inc.                                                       | 20.952    | 3.534                    | 0,14                              |
| Geely Automobile<br>Holdings Ltd.                                         | 267.000   | 545                      | 0,02                              |
| General Motors Co.                                                        | 76.866    | 3.783                    | 0,15                              |
| Haidilao International<br>Holding Ltd.                                    | 284.000   | 541                      | 0,02                              |
| Home Product Center<br>PCL 'A'                                            | 829.500   | 166                      | 0,01                              |
| JUMBO S.A.                                                                | 15.756    | 542                      | 0,02                              |
| Kingfisher PLC                                                            | 303.316   | 1.209                    | 0,05                              |
| Lowe's Cos., Inc. (d)                                                     | 15.685    | 3.480                    | 0,14                              |
| Meituan 'B' (d)                                                           | 649.000   | 10.440                   | 0,41                              |
| MercadoLibre, Inc. (d)                                                    | 3.058     | 7.992                    | 0,31                              |
| Midea Group Co. Ltd.<br>'A'                                               | 33.100    | 334                      | 0,01                              |
| Nien Made Enterprise<br>Co. Ltd.                                          | 25.000    | 349                      | 0,01                              |
| O'Reilly Automotive,<br>Inc. (d)                                          | 45.810    | 4.129                    | 0,16                              |
| OPAP S.A.                                                                 | 29.151    | 659                      | 0,03                              |

| Beschreibung                                            | Aktien    | MarktWert<br>(000S) | % Des<br>NettoVermög<br>ENS |
|---------------------------------------------------------|-----------|---------------------|-----------------------------|
| PDD Holdings, Inc. (d)                                  | 117.964   | \$ 12.346           | 0,49                        |
| SAIC Motor Corp.<br>Ltd. 'A' (d)                        | 74.900    | 168                 | 0,01                        |
| Subaru Corp. (d)                                        | 89.200    | 1.542               | 0,06                        |
| Vipshop Holdings Ltd.                                   | 47.872    | 720                 | 0,03                        |
| Williams-Sonoma, Inc.<br>(d)                            | 1.734     | 283                 | 0,01                        |
| Yamaha Motor Co.<br>Ltd. (d)                            | 149.200   | 1.113               | 0,04                        |
|                                                         |           | 142.804             | 5,61                        |
| Basiskonsumgüter                                        |           |                     |                             |
| Albertsons Cos., Inc.<br>'A'                            | 49.891    | 1.073               | 0,04                        |
| Altria Group, Inc.                                      | 286.480   | 16.796              | 0,66                        |
| Associated British<br>Foods PLC                         | 49.072    | 1.384               | 0,05                        |
| BRF S.A. (d)                                            | 66.900    | 247                 | 0,01                        |
| British American<br>Tobacco PLC (d)                     | 243.035   | 11.536              | 0,45                        |
| China Feihe Ltd.                                        | 508.000   | 370                 | 0,02                        |
| Clorox Co.                                              | 2.165     | 260                 | 0,01                        |
| Colgate-Palmolive<br>Co. (d)                            | 79.330    | 7.211               | 0,28                        |
| Empire Co. Ltd. 'A' (d)                                 | 19.452    | 806                 | 0,03                        |
| George Weston Ltd.                                      | 9.350     | 1.871               | 0,07                        |
| Gruma S.A.B. de<br>C.V. 'B' (d)                         | 7.970     | 137                 | 0,01                        |
| Imperial Brands PLC (d)                                 | 133.064   | 5.249               | 0,21                        |
| Indofood Sukses<br>Makmur Tbk PT (d)                    | 322.400   | 161                 | 0,01                        |
| Inner Mongolia Yili<br>Industrial Group<br>Co. Ltd. 'A' | 56.200    | 219                 | 0,01                        |
| Kimberly-Clark Corp.                                    | 53.899    | 6.949               | 0,27                        |
| Koninklijke Ahold<br>Delhaize NV                        | 46.786    | 1.947               | 0,08                        |
| Kroger Co. (d)                                          | 105.644   | 7.578               | 0,30                        |
| Loblaw Cos. Ltd.                                        | 17.467    | 2.883               | 0,11                        |
| Monster Beverage<br>Corp. (d)                           | 17.570    | 1.101               | 0,04                        |
| Philip Morris<br>International, Inc.                    | 107.955   | 19.662              | 0,77                        |
| Target Corp. (d)                                        | 32.374    | 3.194               | 0,13                        |
| Tingyi Cayman Islands<br>Holding Corp.                  | 336.000   | 493                 | 0,02                        |
| Want Want China<br>Holdings Ltd. (d)                    | 762.000   | 533                 | 0,02                        |
| WH Group Ltd.                                           | 1.281.000 | 1.235               | 0,05                        |
| Zabka Group S.A. (d)                                    | 29.252    | 175                 | 0,01                        |
|                                                         |           | 93.070              | 3,66                        |
| Energie                                                 |           |                     |                             |
| Aker BP ASA                                             | 48.421    | 1.233               | 0,05                        |
| ARC Resources Ltd.                                      | 71.065    | 1.495               | 0,06                        |
| Bharat Petroleum Corp.<br>Ltd. (d)                      | 245.162   | 949                 | 0,04                        |
| EOG Resources, Inc. (d)                                 | 93.698    | 11.207              | 0,44                        |
| Equinor ASA (d)                                         | 5.630     | 142                 | 0,01                        |
| ORLEN S.A. (d)                                          | 98.844    | 2.247               | 0,09                        |
| Petronet LNG Ltd. (d)                                   | 99.540    | 351                 | 0,01                        |
| PTT Exploration &<br>Production PCL 'A'                 | 203.400   | 686                 | 0,02                        |
| Tenaris S.A.                                            | 65.097    | 1.216               | 0,05                        |
| United Tractors Tbk PT                                  | 158.500   | 209                 | 0,01                        |
| Whitecap Resources,<br>Inc. (k)                         | 94.438    | 633                 | 0,02                        |
|                                                         |           | 20.368              | 0,80                        |
| Finanzwerte                                             |           |                     |                             |
| 3i Group PLC                                            | 165.576   | 9.355               | 0,37                        |
| Absa Group Ltd.                                         | 139.945   | 1.388               | 0,05                        |
| Admiral Group PLC                                       | 44.287    | 1.985               | 0,08                        |
| Aflac, Inc.                                             | 47.655    | 5.026               | 0,20                        |
| AIB Group PLC                                           | 356.498   | 2.932               | 0,12                        |
| Akbank T.A.S.                                           | 504.290   | 865                 | 0,03                        |

| BESCHREIBUNG                                              | AKTIEN     | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | AKTIEN    | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | AKTIEN     | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------|------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|------------|--------------------------|-----------------------------------|
| American Express Co. (d)                                  | 48.838     | \$ 15.578                | 0,61                              | Muthoot Finance Ltd.                               | 20.459    | \$ 627                   | 0,02                              | Universal Health Services, Inc. 'B'                  | 9.359      | \$ 1.695                 | 0,07                              |
| Ameriprise Financial, Inc.                                | 14.922     | 7.964                    | 0,31                              | National Bank of Greece S.A.                       | 140.302   | 1.783                    | 0,07                              |                                                      |            | 124.382                  | 4,88                              |
| Amundi S.A.                                               | 1.622      | 131                      | 0,01                              | NatWest Group PLC                                  | 574.433   | 4.027                    | 0,16                              | INDUSTRIEWERTE                                       |            |                          |                                   |
| Arch Capital Group Ltd.                                   | 48.731     | 4.437                    | 0,17                              | Nedbank Group Ltd.                                 | 72.937    | 998                      | 0,04                              | ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A. (d) | 28.602     | 1.981                    | 0,08                              |
| Banca Mediolanum SpA                                      | 36.795     | 632                      | 0,02                              | New China Life Insurance Co. Ltd. 'A' (d)          | 11.800    | 96                       | 0,00                              | AerCap Holdings NV                                   | 30.580     | 3.578                    | 0,14                              |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                      | 980.437    | 15.044                   | 0,59                              | Northern Trust Corp.                               | 32.037    | 4.062                    | 0,16                              | Allegion PLC                                         | 8.981      | 1.294                    | 0,05                              |
| Banco de Chile                                            | 7.166.732  | 1.082                    | 0,04                              | OTP Bank Nyrt                                      | 38.131    | 3.037                    | 0,12                              | ANA Holdings, Inc. (d)                               | 21.200     | 414                      | 0,02                              |
| Banco de Sabadell S.A.                                    | 878.354    | 2.787                    | 0,11                              | PayPal Holdings, Inc. (d)                          | 159.652   | 11.865                   | 0,47                              | AP Moller - Maersk A/S 'A'                           | 435        | 800                      | 0,03                              |
| Banco do Brasil S.A. (d)                                  | 257.700    | 1.043                    | 0,04                              | People's Insurance Co. Group of China Ltd. 'H' (d) | 1.483.000 | 1.132                    | 0,04                              | AP Moller - Maersk A/S 'B'                           | 718        | 1.331                    | 0,05                              |
| Banco Santander Chile                                     | 11.226.101 | 704                      | 0,03                              | PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H' (d)          | 1.172.000 | 2.277                    | 0,09                              | BAE Systems PLC                                      | 231.950    | 6.010                    | 0,24                              |
| Banco Santander S.A.                                      | 1.912.571  | 15.783                   | 0,62                              | Poste Italiane SpA                                 | 48.674    | 1.042                    | 0,04                              | BOC Aviation Ltd.                                    | 29.200     | 242                      | 0,01                              |
| Bank Hapoalim B.M.                                        | 213.171    | 4.096                    | 0,16                              | Power Finance Corp. Ltd.                           | 233.992   | 1.167                    | 0,05                              | Bouygues S.A.                                        | 29.852     | 1.345                    | 0,05                              |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.                                 | 254.760    | 4.741                    | 0,19                              | Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. (d)  | 148.997   | 3.105                    | 0,12                              | Brambles Ltd.                                        | 223.081    | 3.431                    | 0,13                              |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT                               | 5.988.600  | 1.799                    | 0,07                              | Powszechny Zaklad Ubezpieczen S.A. (d)             | 102.930   | 1.795                    | 0,07                              | Broadridge Financial Solutions, Inc.                 | 18.622     | 4.526                    | 0,18                              |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT                      | 2.090.000  | 530                      | 0,02                              | Qifu Technology, Inc.                              | 16.914    | 733                      | 0,03                              | Caterpillar, Inc. (d)                                | 16.551     | 6.425                    | 0,25                              |
| Bank of Baroda                                            | 166.986    | 485                      | 0,02                              | Qualitas Controladora S.A.B. de C.V. (d)           | 26.100    | 266                      | 0,01                              | China Airlines Ltd. (d)                              | 323.000    | 239                      | 0,01                              |
| Bank of Ireland Group PLC                                 | 162.006    | 2.301                    | 0,09                              | Raymond James Financial, Inc. (d)                  | 31.052    | 4.762                    | 0,19                              | Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A'         | 44.900     | 1.583                    | 0,06                              |
| Bank of New York Mellon Corp.                             | 103.376    | 9.419                    | 0,37                              | REC Ltd. (d)                                       | 207.453   | 975                      | 0,04                              | COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'A'                 | 107.200    | 225                      | 0,01                              |
| Bank Polska Kasa Opieki S.A.                              | 28.950     | 1.487                    | 0,06                              | Sanlam Ltd.                                        | 283.113   | 1.413                    | 0,06                              | COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'H'                 | 489.500    | 852                      | 0,03                              |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT                      | 11.024.600 | 2.542                    | 0,10                              | Santander Bank Polska S.A.                         | 4.001     | 548                      | 0,02                              | Daikin Industries Ltd. (d)                           | 42.600     | 4.985                    | 0,20                              |
| BB Seguridade Participacoes S.A.                          | 119.100    | 781                      | 0,03                              | SBI Holdings, Inc. (d)                             | 44.000    | 1.529                    | 0,06                              | Dassault Aviation S.A.                               | 2.839      | 1.000                    | 0,04                              |
| Berkshire Hathaway, Inc. 'B' (d)                          | 2.391      | 1.161                    | 0,05                              | SCB PCL                                            | 133.200   | 482                      | 0,02                              | Delta Air Lines, Inc. (d)                            | 27.731     | 1.364                    | 0,05                              |
| BPER Banca SpA                                            | 156.781    | 1.418                    | 0,06                              | Shriram Finance Ltd. (d)                           | 208.187   | 1.717                    | 0,07                              | Eiffage S.A.                                         | 11.076     | 1.551                    | 0,06                              |
| Canara Bank                                               | 206.786    | 275                      | 0,01                              | Singapore Exchange Ltd.                            | 145.800   | 1.704                    | 0,07                              | Embraer S.A. (d)                                     | 103.200    | 1.456                    | 0,06                              |
| Cboe Global Markets, Inc.                                 | 11.483     | 2.678                    | 0,11                              | Sompo Holdings, Inc. (d)                           | 151.600   | 4.555                    | 0,18                              | EMCOR Group, Inc.                                    | 7.725      | 4.132                    | 0,16                              |
| Chailase Holding Co. Ltd. (d)                             | 139.423    | 604                      | 0,02                              | Standard Bank Group Ltd.                           | 224.294   | 2.869                    | 0,11                              | Eva Airways Corp. (d)                                | 371.000    | 506                      | 0,02                              |
| China Merchants Bank Co. Ltd. 'A' (d)                     | 169.800    | 1.089                    | 0,04                              | State Street Corp. (d)                             | 47.380    | 5.038                    | 0,20                              | Fuji Electric Co. Ltd. (d)                           | 21.200     | 973                      | 0,04                              |
| CME Group, Inc.                                           | 48.599     | 13.395                   | 0,53                              | Synchrony Financial                                | 66.042    | 4.408                    | 0,17                              | GEA Group AG                                         | 24.919     | 1.741                    | 0,07                              |
| Credicorp Ltd.                                            | 10.913     | 2.439                    | 0,10                              | T. Rowe Price Group, Inc.                          | 35.097    | 3.387                    | 0,13                              | General Dynamics Corp. (d)                           | 12.232     | 3.568                    | 0,14                              |
| DB Insurance Co. Ltd.                                     | 7.555      | 689                      | 0,03                              | TMBThanachart Bank PCL 'A'                         | 2.266.500 | 132                      | 0,01                              | HD Hyundai Electric Co. Ltd.                         | 3.768      | 1.413                    | 0,05                              |
| Equitable Holdings, Inc.                                  | 50.643     | 2.841                    | 0,11                              | Tokio Marine Holdings, Inc. (d)                    | 35.600    | 1.504                    | 0,06                              | HD Hyundai Heavy Industries Co. Ltd.                 | 3.782      | 1.194                    | 0,05                              |
| Erste Group Bank AG                                       | 49.710     | 4.217                    | 0,17                              | Union Bank of India (d)                            | 213.966   | 383                      | 0,01                              | HMM Co. Ltd.                                         | 36.736     | 613                      | 0,02                              |
| Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A'          | 397.520    | 1.364                    | 0,05                              | W.R. Berkley Corp.                                 | 44.236    | 3.250                    | 0,13                              | International Container Terminal Services, Inc.      | 143.610    | 1.047                    | 0,04                              |
| EXOR NV                                                   | 10.336     | 1.040                    | 0,04                              | Yapi ve Kredi Bankasi A/S                          | 473.300   | 377                      | 0,01                              | Intertek Group PLC                                   | 26.074     | 1.696                    | 0,07                              |
| Fairfax Financial Holdings Ltd.                           | 1.813      | 3.266                    | 0,13                              |                                                    |           | 289.389                  | 11,36                             | Japan Airlines Co. Ltd. (d)                          | 22.700     | 462                      | 0,02                              |
| FirstRand Ltd.                                            | 831.536    | 3.541                    | 0,14                              | GESUNDHEITSWESEN                                   |           |                          |                                   | Knorr-Bremse AG                                      | 11.699     | 1.131                    | 0,04                              |
| Fiserv, Inc. (d)                                          | 9.527      | 1.643                    | 0,06                              | Amgen, Inc.                                        | 14.014    | 3.913                    | 0,15                              | Kongsberg Gruppen ASA (d)                            | 70.995     | 2.742                    | 0,11                              |
| Goldman Sachs Group, Inc.                                 | 18.382     | 13.010                   | 0,51                              | Bristol-Myers Squibb Co. (d)                       | 199.090   | 9.216                    | 0,36                              | Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd.   | 6.279      | 1.696                    | 0,07                              |
| Hartford Insurance Group, Inc.                            | 48.484     | 6.151                    | 0,24                              | Bumrungrad Hospital PCL 'A'                        | 76.400    | 328                      | 0,01                              | Latam Airlines Group S.A.                            | 33.352.897 | 674                      | 0,03                              |
| IGM Financial, Inc.                                       | 10.975     | 346                      | 0,01                              | Cigna Group                                        | 2.393     | 791                      | 0,03                              | Leidos Holdings, Inc.                                | 20.488     | 3.232                    | 0,13                              |
| Intesa Sanpaolo SpA                                       | 1.712.954  | 9.833                    | 0,39                              | Daiichi Sankyo Co. Ltd. (d)                        | 292.100   | 6.747                    | 0,26                              | Makita Corp. (d)                                     | 36.800     | 1.130                    | 0,04                              |
| Israel Discount Bank Ltd. 'A'                             | 208.864    | 2.084                    | 0,08                              | DaVita, Inc. (d)                                   | 6.791     | 967                      | 0,04                              | Mitsubishi Electric Corp. (d)                        | 307.100    | 6.585                    | 0,26                              |
| JPMorgan Chase & Co. (d)                                  | 13.949     | 4.044                    | 0,16                              | Genmab A/S (d)                                     | 3.136     | 649                      | 0,03                              | NARI Technology Co. Ltd. 'A'                         | 44.800     | 140                      | 0,01                              |
| Kasikornbank PCL 'A'                                      | 78.600     | 371                      | 0,01                              | Gilead Sciences, Inc.                              | 74.149    | 8.221                    | 0,32                              | Orient Overseas International Ltd.                   | 15.000     | 255                      | 0,01                              |
| Krung Thai Bank PCL 'A'                                   | 463.800    | 304                      | 0,01                              | GSK PLC                                            | 645.238   | 12.282                   | 0,48                              | Qantas Airways Ltd.                                  | 116.747    | 821                      | 0,03                              |
| Mastercard, Inc. 'A' (d)                                  | 9.053      | 5.087                    | 0,20                              | Ipsen S.A.                                         | 5.323     | 632                      | 0,02                              | Recruit Holdings Co. Ltd. (d)                        | 138.700    | 8.132                    | 0,32                              |
| Meritz Financial Group, Inc.                              | 13.357     | 1.111                    | 0,04                              | Johnson & Johnson                                  | 159.382   | 24.346                   | 0,96                              | Rolls-Royce Holdings PLC                             | 29.230     | 387                      | 0,01                              |
| Metropolitan Bank & Trust Co.                             | 232.670    | 299                      | 0,01                              | Medtronic PLC                                      | 53.593    | 4.672                    | 0,18                              | Ryanair Holdings PLC                                 | 144.635    | 4.088                    | 0,16                              |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd.                                 | 24.447     | 1.595                    | 0,06                              | Merck & Co., Inc.                                  | 220.830   | 17.481                   | 0,69                              | Schindler Holding AG                                 | 4.428      | 1.644                    | 0,06                              |
| Morgan Stanley                                            | 49.417     | 6.961                    | 0,27                              | Novartis AG                                        | 77.720    | 9.403                    | 0,37                              | SF Holding Co. Ltd. 'A' (d)                          | 40.400     | 275                      | 0,01                              |
| MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. (d)                  | 152.800    | 3.406                    | 0,13                              | Richter Gedeon Nyrt (d)                            | 6.319     | 185                      | 0,01                              | SGS S.A.                                             | 27.372     | 2.770                    | 0,11                              |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 1.800      | 1.165                    | 0,05                              | Roche Holding AG                                   | 50.443    | 16.520                   | 0,65                              | Singapore Airlines Ltd. (d)                          | 234.400    | 1.283                    | 0,05                              |
|                                                           |            |                          |                                   | Royalty Pharma PLC 'A'                             | 60.845    | 2.192                    | 0,09                              |                                                      |            |                          |                                   |
|                                                           |            |                          |                                   | Shionogi & Co. Ltd. (d)                            | 121.300   | 2.177                    | 0,08                              |                                                      |            |                          |                                   |
|                                                           |            |                          |                                   | United Therapeutics Corp. (d)                      | 6.838     | 1.965                    | 0,08                              |                                                      |            |                          |                                   |

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

| BESCHREIBUNG                                    | AKTIEN  | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | AKTIEN    | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | AKTIEN              | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------|---------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|-----------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|---------------------|--------------------------|-----------------------------------|
| SITC International Holdings Co. Ltd.            | 212.000 | \$ 679                   | 0,03                              | Yokogawa Electric Corp. (d)                   | 38.800    | \$ 1.033                 | 0,04                              | Tokyo Gas Co. Ltd. (d)                   | 52.200              | \$ 1.731                 | 0,07                              |
| Skanska AB 'B'                                  | 57.903  | 1.339                    | 0,05                              | Zoom Communications, Inc. (d)                 | 42.662    | 3.327                    | 0,13                              | Verbund AG                               | 11.584              | 887                      | 0,03                              |
| Turk Hava Yollari AO (d)                        | 73.153  | 521                      | 0,02                              | ZTE Corp. 'A'                                 | 19.800    | 90                       | 0,00                              |                                          |                     | 40.174                   | 1,58                              |
| United Airlines Holdings, Inc. (d)              | 13.436  | 1.070                    | 0,04                              | ZTE Corp. 'H'                                 | 100.000   | 311                      | 0,01                              |                                          |                     | 1.407.975                | 55,29                             |
| Vinci S.A.                                      | 84.217  | 12.376                   | 0,49                              |                                               |           | 377.799                  | 14,84                             |                                          |                     |                          |                                   |
| Wartsila Oyj Abp (d)                            | 85.563  | 2.015                    | 0,08                              | <b>BAUSTOFFE</b>                              |           |                          |                                   | <b>OPTIONSSCHEINE</b>                    |                     |                          |                                   |
| Wolters Kluwer NV                               | 22.308  | 3.718                    | 0,15                              | Amrize Ltd. (d)                               | 58.725    | 2.920                    | 0,11                              | YTL Corp. Bhd. - Exp. 2. Juni 2028       | 77.860              | 21                       | 0,00                              |
| Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd.          | 366.900 | 639                      | 0,02                              | Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'A'               | 12.900    | 39                       | 0,00                              | <b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>                |                     |                          |                                   |
| Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. 'H' (d)    | 52.700  | 212                      | 0,01                              | Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'H'               | 164.500   | 419                      | 0,02                              | Cia Energetica de Minas Gerais 0,000 %   | 225.700             | 447                      | 0,02                              |
|                                                 |         | 121.531                  | 4,77                              | Asia Cement Corp. (d)                         | 322.000   | 470                      | 0,02                              | Grupo Cibst S.A. 0,000 %                 | 64.172              | 726                      | 0,03                              |
| <b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>                  |         |                          |                                   | Baoshan Iron & Steel Co. Ltd. 'A'             | 223.300   | 205                      | 0,01                              | Nationwide Building Society 10,250 %     | 1.490               | 265                      | 0,01                              |
| AAC Technologies Holdings, Inc.                 | 128.000 | 666                      | 0,03                              | Cemex S.A.B. de C.V. (d)                      | 522.200   | 358                      | 0,01                              |                                          |                     | 1.438                    | 0,06                              |
| Adobe, Inc. (d)                                 | 60.293  | 23.326                   | 0,92                              | CF Industries Holdings, Inc.                  | 27.027    | 2.487                    | 0,10                              | <b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>     |                     |                          |                                   |
| Apple, Inc.                                     | 162.246 | 33.288                   | 1,31                              | China National Building Material Co. Ltd. 'H' | 600.000   | 287                      | 0,01                              | American Tower Corp.                     | 7.729               | 1.708                    | 0,07                              |
| Applied Materials, Inc. (d)                     | 9.554   | 1.749                    | 0,07                              | CMOC Group Ltd. 'H'                           | 489.000   | 499                      | 0,02                              | CapitaLand Ascendas REIT                 | 513.400             | 1.081                    | 0,04                              |
| ASML Holding NV                                 | 929     | 742                      | 0,03                              | Crown Holdings, Inc.                          | 4.529     | 466                      | 0,02                              | Fibra Uno Administracion S.A. de C.V.    | 462.500             | 635                      | 0,02                              |
| Atlassian Corp. Ltd. 'A' (d)                    | 10.283  | 2.088                    | 0,08                              | Harmony Gold Mining Co. Ltd.                  | 97.131    | 1.346                    | 0,05                              | Healthpeak Properties, Inc.              | 113.046             | 1.979                    | 0,08                              |
| Autodesk, Inc. (d)                              | 27.842  | 8.619                    | 0,34                              | Heidelberg Materials AG                       | 11.717    | 2.750                    | 0,11                              | Klepierre S.A.                           | 31.842              | 1.255                    | 0,05                              |
| Avary Holding Shenzhen Co. Ltd. 'A'             | 20.500  | 92                       | 0,00                              | Holcim AG                                     | 58.725    | 4.347                    | 0,17                              | Link REIT                                | 31.700              | 170                      | 0,01                              |
| Canon, Inc. (d)                                 | 25.100  | 726                      | 0,03                              | ICL Group Ltd.                                | 113.957   | 783                      | 0,03                              | Nippon Building Fund, Inc.               | 1.302               | 1.199                    | 0,05                              |
| Check Point Software Technologies Ltd. (d)      | 14.221  | 3.146                    | 0,12                              | Kinross Gold Corp.                            | 209.239   | 3.263                    | 0,13                              | Simon Property Group, Inc.               | 55.269              | 8.885                    | 0,35                              |
| Cisco Systems, Inc. (d)                         | 391.812 | 27.184                   | 1,07                              | Newmont Corp.                                 | 191.501   | 11.157                   | 0,44                              | WP Carey, Inc.                           | 35.371              | 2.206                    | 0,08                              |
| Computershare Ltd.                              | 85.047  | 2.222                    | 0,09                              |                                               |           | 31.796                   | 1,25                              |                                          |                     | 19.118                   | 0,75                              |
| F5, Inc. (d)                                    | 9.474   | 2.788                    | 0,11                              | <b>IMMOBILIEN</b>                             |           |                          |                                   | <b>PARI (000S)</b>                       |                     |                          |                                   |
| Fortinet, Inc. (d)                              | 26.206  | 2.770                    | 0,11                              | Aldar Properties PJSC                         | 603.930   | 1.468                    | 0,06                              | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>          |                     |                          |                                   |
| Gen Digital, Inc.                               | 84.995  | 2.499                    | 0,10                              | Barwa Real Estate Co.                         | 109.330   | 83                       | 0,00                              | <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>            |                     |                          |                                   |
| GoDaddy, Inc. 'A' (d)                           | 24.014  | 4.324                    | 0,17                              | Central Pattana PCL 'A'                       | 343.700   | 489                      | 0,02                              | 33,126 % fällig am 12.06.2026 (e)(f) NGN | 717.500             | 380                      | 0,02                              |
| HCL Technologies Ltd.                           | 149.653 | 3.017                    | 0,12                              | China Resources Land Ltd.                     | 518.500   | 1.765                    | 0,07                              | 33,156 % fällig am 11.06.2026 (e)(f)     | 718.200             | 380                      | 0,01                              |
| HubSpot, Inc. (d)                               | 3.893   | 2.167                    | 0,08                              | Daito Trust Construction Co. Ltd. (d)         | 9.200     | 999                      | 0,04                              |                                          |                     | 760                      | 0,03                              |
| Infosys Ltd.                                    | 465.531 | 8.697                    | 0,34                              | Emaar Development PJSC                        | 157.380   | 579                      | 0,02                              | <b>U.S. TREASURY BILLS</b>               |                     |                          |                                   |
| Intuit, Inc. (d)                                | 28.358  | 22.336                   | 0,88                              | Emaar Properties PJSC                         | 1.126.120 | 4.177                    | 0,16                              | 4,243 % fällig am 03.07.2025 (e)(f) \$   | 300                 | 300                      | 0,01                              |
| MediaTek, Inc. (d)                              | 259.000 | 11.098                   | 0,43                              | Hulic Co. Ltd. (d)                            | 72.500    | 729                      | 0,03                              | 4,293 % fällig am 29.07.2025 (b)(e)(f)   | 2.500               | 2.492                    | 0,10                              |
| Microsoft Corp. (d)                             | 148.774 | 74.002                   | 2,91                              | Sun Hung Kai Properties Ltd.                  | 234.000   | 2.697                    | 0,11                              | 4,297 % fällig am 25.09.2025 (e)(f)      | 1.400               | 1.386                    | 0,06                              |
| Murata Manufacturing Co. Ltd. (d)               | 274.600 | 4.046                    | 0,16                              |                                               |           | 12.986                   | 0,51                              | 4,310 % fällig am 29.07.2025 (b)(e)(f)   | 3.400               | 3.389                    | 0,13                              |
| NetApp, Inc. (d)                                | 35.060  | 3.736                    | 0,15                              | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                 |           |                          |                                   | 4,317 % fällig am 07.10.2025 (e)(f)      | 1.100               | 1.087                    | 0,04                              |
| Nice Ltd. (d)                                   | 10.409  | 1.765                    | 0,07                              | Acciona S.A. (d)                              | 4.200     | 755                      | 0,03                              | 4,319 % fällig am 21.10.2025 (e)(f)      | 1.100               | 1.086                    | 0,04                              |
| Nokia Oyj (d)                                   | 905.971 | 4.684                    | 0,18                              | Canadian Utilities Ltd. 'A'                   | 21.515    | 594                      | 0,02                              | 4,324 % fällig am 18.09.2025 (e)(f)      | 200                 | 198                      | 0,01                              |
| Novatek Microelectronics Corp. (d)              | 98.000  | 1.828                    | 0,07                              | CEZ A/S                                       | 27.465    | 1.608                    | 0,06                              | 4,337 % fällig am 07.10.2025 (e)(f)      | 12.400              | 12.258                   | 0,48                              |
| Nutanix, Inc. 'A' (d)                           | 41.138  | 3.145                    | 0,12                              | CLP Holdings Ltd.                             | 265.500   | 2.242                    | 0,09                              | 4,344 % fällig am 14.10.2025 (e)(f)      | 5.500               | 5.433                    | 0,22                              |
| NVIDIA Corp.                                    | 287.031 | 45.348                   | 1,78                              | DTE Energy Co. (d)                            | 7.952     | 1.053                    | 0,04                              | 4,351 % fällig am 04.09.2025 (e)(f)      | 1.100               | 1.092                    | 0,04                              |
| Oracle Corp. Japan                              | 6.200   | 737                      | 0,03                              | Dubai Electricity & Water Authority PJSC      | 702.967   | 540                      | 0,02                              |                                          |                     | 28.721                   | 1,13                              |
| Oracle Financial Services Software Ltd.         | 3.689   | 387                      | 0,01                              | Edison International (d)                      | 62.573    | 3.229                    | 0,13                              | Summe kurzfristige Instrumente           |                     | 29.481                   | 1,16                              |
| QUALCOMM, Inc.                                  | 153.094 | 24.382                   | 0,96                              | Endesa S.A.                                   | 51.282    | 1.619                    | 0,06                              | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>    | <b>\$ 2.670.246</b> | <b>104,86</b>            |                                   |
| Realtek Semiconductor Corp. (d)                 | 80.000  | 1.554                    | 0,06                              | Enel SpA (d)                                  | 1.071.392 | 10.133                   | 0,40                              |                                          |                     |                          |                                   |
| Sage Group PLC                                  | 36.694  | 629                      | 0,02                              | Energisa S.A.                                 | 32.000    | 283                      | 0,01                              |                                          |                     |                          |                                   |
| Salesforce, Inc.                                | 47.328  | 12.906                   | 0,51                              | Engie S.A.                                    | 310.714   | 7.277                    | 0,29                              |                                          |                     |                          |                                   |
| SK Hynix, Inc.                                  | 22.253  | 4.795                    | 0,19                              | Guangdong Investment Ltd.                     | 342.000   | 287                      | 0,01                              |                                          |                     |                          |                                   |
| SS&C Technologies Holdings, Inc.                | 8.266   | 684                      | 0,03                              | Osaka Gas Co. Ltd. (d)                        | 58.700    | 1.501                    | 0,06                              |                                          |                     |                          |                                   |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. (d) | 219.000 | 8.009                    | 0,31                              | PG&E Corp.                                    | 71.910    | 1.002                    | 0,04                              |                                          |                     |                          |                                   |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' (d)         | 472.651 | 4.009                    | 0,16                              | PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (d)        | 152.826   | 483                      | 0,02                              |                                          |                     |                          |                                   |
| Vanguard International Semiconductor Corp. (d)  | 145.000 | 499                      | 0,02                              | Power Grid Corp. of India Ltd. (d)            | 732.727   | 2.561                    | 0,10                              |                                          |                     |                          |                                   |
| VeriSign, Inc.                                  | 13.979  | 4.037                    | 0,16                              | RWE AG                                        | 21.437    | 893                      | 0,04                              |                                          |                     |                          |                                   |
| Wix.com Ltd. (d)                                | 8.984   | 1.424                    | 0,06                              | Tenaga Nasional Bhd.                          | 437.700   | 1.496                    | 0,06                              |                                          |                     |                          |                                   |
| Workday, Inc. 'A' (d)                           | 28.702  | 6.888                    | 0,27                              |                                               |           |                          |                                   |                                          |                     |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                                                | AKTIEN     | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---------------------------|-----------------------------------|
| <b>INVESTMENTFONDS<br/>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                |            |                           |                                   |
| PIMCO Select<br>Funds plc -<br>PIMCO<br>US Dollar<br>Short-Term<br>Floating NAV<br>Fund (I) | 16.155.916 | \$ 161.103                | 6,33                              |
| Summe Investmentfonds                                                                       |            | \$ 161.103                | 6,33                              |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                                    | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS                     | 4,480 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 12.700     | Ginnie Mae 4.000 %<br>fällig am 20.01.2049                                         | \$ (14.001)                | \$ 12.700                      | \$ 12.702                                                      | 0,50                    |
| DEU                     | 4,470      | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 13.800        | U.S. Treasury Inflation<br>Protected Securities<br>1,250 % fällig<br>am 15.04.2028 | (14.102)                   | 13.800                         | 13.802                                                         | 0,54                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                                                    | \$ (28.103)                | \$ 26.500                      | \$ 26.504                                                      | 1,04                    |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

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

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures            | Long  | 09.2025     | 132                     | \$ 63                                           | 0,00                    |
| CAC 40 Index July Futures                                      | Long  | 07.2025     | 10                      | (4)                                             | 0,00                    |
| E-mini S&P 500 Index September Futures                         | Short | 09.2025     | 5                       | (55)                                            | 0,00                    |
| Euro STOXX 50 September Futures                                | Long  | 09.2025     | 16                      | 2                                               | 0,00                    |
| FTSE 100 Index September Futures                               | Long  | 09.2025     | 3                       | (1)                                             | 0,00                    |
| FTSE China Index July Futures                                  | Long  | 07.2025     | 146                     | 19                                              | 0,00                    |
| FTSE/JSE TOP 40 Index September Futures                        | Long  | 09.2025     | 66                      | 52                                              | 0,00                    |
| IBEX 35 Index July Futures                                     | Long  | 07.2025     | 5                       | 0                                               | 0,00                    |
| IFSC Nifty 50 Index July Futures                               | Long  | 07.2025     | 61                      | 61                                              | 0,00                    |
| Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures             | Short | 09.2025     | 10                      | (11)                                            | 0,00                    |
| MSCI Singapore Index July Futures                              | Short | 07.2025     | 2                       | (1)                                             | 0,00                    |
| OMX Stockholm 30 Index July Futures                            | Long  | 07.2025     | 33                      | 7                                               | 0,00                    |
| S&P 60 Index September Futures                                 | Short | 09.2025     | 6                       | (18)                                            | 0,00                    |
| SPI 200 Index September Futures                                | Short | 09.2025     | 5                       | 1                                               | 0,00                    |
| Topix Index September Futures                                  | Short | 09.2025     | 13                      | (63)                                            | 0,00                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 1.333                   | 1.455                                           | 0,06                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 472                     | 952                                             | 0,04                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 151                     | 381                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures                 | Long  | 09.2025     | 21                      | 59                                              | 0,00                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 58                      | 207                                             | 0,01                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025     | 425                     | 1.251                                           | 0,05                    |
| WIG20 Index September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 59                      | 44                                              | 0,00                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                         | \$ 4.401                                        | 0,17                    |

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

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

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

| Referenzeinheit   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Barclays Bank PLC | 1,000 %                        | 20.12.2025       | € 900                     | \$ (1)                                          | 0,00                    |
| Boeing Co.        | 1,000                          | 20.06.2030       | \$ 2.500                  | 23                                              | 0,00                    |
| Deutsche Bank AG  | 1,000                          | 20.12.2029       | € 500                     | 5                                               | 0,00                    |
|                   |                                |                  |                           | \$ 27                                           | 0,00                    |

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

| Index/Tranchen         | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.IG-43 5-Year Index | (1,000) %                      | 20.12.2029       | \$ 11.995                 | \$ (32)                                         | 0,00                    |



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

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

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-41 5-Year Index             | 5,000 %                        | 20.12.2028       | \$ 396                    | \$ 2                                            | 0,00                    |
| CDX.HY-43 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2029       | 34.890                    | (307)                                           | (0,01)                  |
| CDX.HY-44 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2030       | 36.280                    | 1.424                                           | 0,05                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2030       | 3.570                     | 8                                               | 0,00                    |
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index   | 5,000                          | 20.06.2030       | € 2.350                   | 17                                              | 0,00                    |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 10.150                    | 16                                              | 0,00                    |
|                                    |                                |                  |                           | \$ 1.160                                        | 0,04                    |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %            | 19.03.2030       | £ 4.800    | \$ (73)                                         | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500              | 19.03.2035       | 8.200      | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750              | 19.03.2055       | 2.000      | (74)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 4,000              | 17.09.2035       | 9.700      | 58                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 0,050              | 15.12.2031       | ¥ 690.000  | 24                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 0,450              | 15.12.2051       | 300.000    | 254                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 0,700              | 18.09.2029       | 2.530.000  | 44                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 0,750              | 19.03.2027       | 3.050.000  | (48)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 0,750              | 19.03.2030       | 3.160.000  | (76)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 21.03.2034       | 573.500    | 55                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 18.09.2034       | 1.531.800  | 26                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 19.03.2035       | 1.416.750  | (50)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 17.09.2035       | 2.118.900  | (155)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,500              | 19.03.2055       | 160.000    | 79                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 1,750              | 15.06.2029       | \$ 800     | (43)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 1,750              | 15.06.2052       | 3.100      | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 2,385              | 08.06.2032       | 6.100      | (298)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 2,750              | 21.06.2053       | 4.000      | 21                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 19.03.2027       | 101.900    | 334                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 19.03.2028       | 10.200     | 150                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 19.03.2030       | 42.400     | (858)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 21.06.2033       | 5.100      | (217)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,085              | 13.02.2034       | 23.920     | (760)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 18.06.2030       | 10.400     | 136                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 19.03.2032       | 34.000     | (1.008)                                         | (0,05)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 19.03.2035       | 21.000     | (139)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 19.03.2055       | 2.000      | 69                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,300              | 28.02.2029       | 3.690      | 34                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,300              | 30.06.2031       | 4.130      | 62                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,300              | 15.11.2053       | 1.130      | 136                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,308              | 21.02.2029       | 10.400     | 270                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 20.12.2030       | 26.600     | (816)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 20.12.2033       | 27.240     | (853)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 20.12.2033       | 19.140     | 398                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 20.06.2054       | 1.000      | 92                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,620              | 30.11.2029       | 6.420      | (60)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.12.2028       | 6.200      | 102                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.06.2029       | 400        | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.12.2029       | 1.100      | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.06.2031       | 4.600      | 169                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.12.2031       | 7.220      | 95                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 15.05.2032       | 5.792      | (83)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.06.2034       | 19.800     | 660                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.09.2034       | 3.400      | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.12.2034       | 6.400      | (27)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 17.09.2035       | 8.600      | 113                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.06.2036       | 10.100     | (312)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,760              | 23.08.2033       | 7.135      | 207                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,800              | 10.03.2028       | 4.504      | 106                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,800              | 30.08.2033       | 4.300      | 126                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000              | 20.06.2027       | 7.600      | 95                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000              | 19.03.2035       | 13.100     | (354)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,100              | 15.11.2052       | 1.642      | (40)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250              | 22.11.2033       | 1.700      | (52)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250              | 20.03.2034       | 7.600      | (32)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,203             | 04.01.2027       | BRL 71.600 | 99                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,256             | 04.01.2027       | 51.600     | (434)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,604             | 04.01.2027       | 27.900     | (297)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000              | 15.09.2035       | CAD 7.800  | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250              | 20.03.2034       | 1.700      | 60                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250              | 18.09.2034       | 2.600      | 7                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500              | 19.03.2035       | 10.000     | 87                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month NZD-BBR                     | 4,750              | 19.06.2029       | NZD 2.500  | 59                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,500              | 19.03.2027       | AUD 14.200 | 89                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,150              | 19.03.2055       | 800        | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250              | 19.03.2030       | 11.900     | 141                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500              | 20.03.2034       | 6.400      | 189                                             | 0,01                    |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW    | 4,500 %         | 19.03.2035       | AUD 3.300  | \$ 50                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW    | 4,500           | 18.06.2035       | 19.500     | 174                                             | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,000           | 17.09.2027       | € 16.600   | 102                                             | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250           | 17.09.2030       | 1.700      | 17                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250           | 17.09.2035       | 12.080     | (83)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250           | 17.09.2055       | 24.100     | 1.109                                           | 0,04                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,500           | 19.03.2035       | 1.700      | 21                                              | 0,00                    |
|                                                |                         |                 |                  |            | \$ (1.124)                                      | (0,04)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                 |                  |            | \$ 31                                           | 0,00                    |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                 | Ausübungs-<br>kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------------------------------------------------------------------|--------------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,500 % fällig am 01.08.2055 | \$ 77,000          | 06.08.2025    | 100.000                   | \$ 4   | \$ 0      | 0,00                    |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung      | Anfänglicher<br>Index | Variabler Zinssatz                                         | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Cap - OTC CPALEMU | \$ 100,151            | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035    | 8.200                     | \$ (359) | \$ (224)  | (0,01)                  |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| BPS        | Romania Government International Bond | 1,000 %                        | 20.12.2025       | \$ 1.300                  | \$ 2                                         | \$ 0                                               | \$ 2      | 0,00                         |
| GST        | Israel Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2029       | 100                       | (3)                                          | 4                                                  | 1         | 0,00                         |
|            | Petroleos Mexicanos                   | 4,850                          | 07.05.2026       | 5.184                     | 0                                            | 62                                                 | 62        | 0,00                         |
| MYC        | Israel Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2029       | 200                       | (5)                                          | 6                                                  | 1         | 0,00                         |
|            |                                       |                                |                  |                           | \$ (6)                                       | \$ 72                                              | \$ 66     | 0,00                         |

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

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.12.2029       | € 591                     | \$ 116                                       | \$ 12                                              | \$ 128    | 0,01                         |
| GST        | CMBX.NA.AAA.10 Index             | 0,500                          | 17.11.2059       | \$ 2.900                  | (9)                                          | 21                                                 | 12        | 0,00                         |
| MYC        | CMBX.NA.AAA.10 Index             | 0,500                          | 17.11.2059       | 12.200                    | (40)                                         | 92                                                 | 52        | 0,00                         |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.12 Index             | 0,500                          | 17.08.2061       | 2.200                     | (22)                                         | 34                                                 | 12        | 0,00                         |
|            |                                  |                                |                  |                           | \$ 45                                        | \$ 159                                             | \$ 204    | 0,01                         |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier     | Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Einheiten | Variabler Zinssatz                       | Nennbetrag    | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------|----------------|--------------------------------------------|------------------------------------------|---------------|------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| MBC        | Erhalt             | NDUEACWF Index | 20.969                                     | FEDL01 zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | \$ 10.070     | 01.10.2025       | \$ 0                                         | \$ 415                                             | \$ 415    | 0,02                         |
|            | Erhalt             | NDUEACWF Index | 18.000                                     | FEDL01 zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 8.645         | 03.11.2025       | 0                                            | 354                                                | 354       | 0,01                         |
| MEI        | Zahlung            | BOVESPA Index  | 147                                        | 0,000 %                                  | BRL 20.902    | 13.08.2025       | 0                                            | 27                                                 | 27        | 0,00                         |
|            | Erhalt             | NDUEACWF Index | 31.385                                     | FEDL01 zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | \$ 15.073     | 02.07.2025       | 0                                            | 623                                                | 623       | 0,03                         |
|            | Erhalt             | NDUEACWF Index | 22.826                                     | 4,390                                    | 10.962        | 06.08.2025       | 0                                            | 455                                                | 455       | 0,02                         |
|            | Erhalt             | NDUEACWF Index | 35.411                                     | 4,660                                    | 17.326        | 04.02.2026       | 0                                            | 407                                                | 407       | 0,02                         |
| MYI        | Erhalt             | KOSPI2 Index   | 2.750.000                                  | 0,000                                    | KRW 1.063.194 | 11.09.2025       | 0                                            | 60                                                 | 60        | 0,00                         |
|            | Erhalt             | SET 50 Index   | 64.200                                     | 0,000                                    | THB 44.214    | 29.09.2025       | 0                                            | 28                                                 | 28        | 0,00                         |
|            | Erhalt             | NDUEACWF Index | 26.540                                     | FEDL01 zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | \$ 12.746     | 02.07.2025       | 0                                            | 526                                                | 526       | 0,02                         |
|            | Erhalt             | NDUEACWF Index | 91.994                                     | FEDL01 zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 44.180        | 20.08.2025       | 0                                            | 1.814                                              | 1.814     | 0,07                         |
|            | Erhalt             | NDUEACWF Index | 143.670                                    | 4,540                                    | 69.746        | 03.09.2025       | 0                                            | 2.134                                              | 2.134     | 0,08                         |
| TOR        | Erhalt             | NDUEACWF Index | 5.661                                      | FEDL01 zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 2.719         | 01.10.2025       | 0                                            | 112                                                | 112       | 0,01                         |
|            |                    |                |                                            |                                          |               |                  | \$ 0                                         | \$ 6.955                                           | \$ 6.955  | 0,28                         |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | 9                        | \$ 1                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 472                      | 552                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 5.043                    | AUD 7.763                        | 44                                 | 44                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.162                    | NZD 5.254                        | 28                                 | 28                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 7.763                    | \$ 5.046                         | 0                                  | (44)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 82                       | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 5.254                    | 3.166                            | 0                                  | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 518                      | € 441                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 120.063                  | \$ 136.518                       | 0                                  | (4.420)                                              | (0,17)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 35                       | PLN 127                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 82                       | SGD 105                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 105                      | \$ 82                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 847                      | CZK 18.139                       | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 100                      | PEN 358                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | BRL                    | 110                      | \$ 19                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 1.909.974                | 117                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.025                    | 31                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 982                      | AUD 1.513                        | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4.955                    | € 4.283                          | 73                                 | 73                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 15                       | IDR 246.221                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 237                      | \$ 33                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CZK                    | 24.582                   | 1.104                            | 0                                  | (65)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 11.094                   | 128                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY                    | 3.199                    | 77                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.564                    | HUF 547.088                      | 39                                 | 39                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PLN                    | 371                      | \$ 100                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 100                      | PEN 363                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 05.2026          |                        | 5                        | KWD 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 06.2026          |                        | 4                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 06.2027          |                        | 2                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2029          | KWD                    | 9                        | \$ 30                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 05.2030          |                        | 6                        | 20                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | AUD                    | 9.598                    | 6.185                            | 0                                  | (105)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 1.839.830                | 113                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 2.926                    | 840                              | 0                                  | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 10.511                   | 1.032                            | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 11.573                   | 6.972                            | 0                                  | (53)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 1.436                    | 383                              | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 17.111                   | 421                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 100                      | AUD 153                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 100                      | BRL 557                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 46.513                   | £ 34.185                         | 334                                | 334                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 417                      | ILS 1.407                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 109                      | PLN 407                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.276                    | TRY 216.052                      | 90                                 | 90                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 855                      | ZAR 15.420                       | 11                                 | 11                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 111.586                  | \$ 6.158                         | 0                                  | (111)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CZK                    | 912                      | 41                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 34.185                   | 46.519                           | 0                                  | (335)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 25                       | CNH 181                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.059                    | TRY 43.873                       | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 8.199                    | \$ 2.244                         | 0                                  | (61)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 100                      | CLP 93.996                       | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 61                       | NZD 100                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 93                       | PEN 338                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK        | 07.2025          | CAD 870                | \$ 630                   | \$ 0                             | \$ (8)                             | \$ (8)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH 253                | 35                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR 9.240.900          | 567                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 2.052.472          | 1.498                    | 0                                | (24)                               | (24)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK 210                | 22                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB 53.651             | 1.613                    | 0                                | (39)                               | (39)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 15.161              | AUD 23.222               | 58                               | 0                                  | 58                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.968                  | BRL 11.094               | 64                               | 0                                  | 64                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 4.147                  | CHF 3.365                | 80                               | 0                                  | 80                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 58                     | IDR 942.368              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 78                     | PEN 277                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.130                  | PHP 63.546               | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 4.367                  | SEK 41.391               | 0                                | (24)                               | (24)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 72                 | \$ 10                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | COP 4.088.559          | 980                      | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD 21.744             | 2.780                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR 72.870             | 845                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK 41.302             | 4.367                    | 24                               | 0                                  | 24                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 590                 | THB 19.078               | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | £ 600                  | \$ 816                   | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | IDR 1.635.870          | 100                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN 278                | 78                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 198                 | PEN 729                  | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025          | PEN 31.101             | \$ 8.444                 | 0                                | (282)                              | (282)                                                | (0,01)                  |
| CIB        | 09.2025          | \$ 136                 | £ 100                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 200                    | SGD 255                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | AUD 903                | \$ 582                   | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS 1.421              | 410                      | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | \$ 15                  | DKK 96                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 139.905                | € 120.597                | 1.659                            | 0                                  | 1.659                                                | 0,06                    |
|            | 07.2025          | 22                     | SGD 28                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 1.856              | \$ 260                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK 95                 | 15                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 120.333              | 139.905                  | 0                                | (1.657)                            | (1.657)                                              | (0,06)                  |
|            | 08.2025          | INR 31.707             | 367                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 357                 | CNH 2.556                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 344                    | THB 11.190               | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN 0                  | \$ 0                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 0                   | MXN 0                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD 22.261             | \$ 14.376                | 0                                | (213)                              | (213)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | BRL 14.278             | 2.497                    | 0                                | (119)                              | (119)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF 7.240              | 8.792                    | 0                                | (304)                              | (304)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH 79                 | 11                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD 3.087              | 394                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 1.524.949            | 10.517                   | 19                               | (60)                               | (41)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK 78.915             | 8.239                    | 0                                | (41)                               | (41)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 335                | 260                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 9.437               | BRL 53.860               | 433                              | 0                                  | 433                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025          | 4.846                  | CHF 3.880                | 28                               | 0                                  | 28                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 20                     | DKK 130                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 14.381                 | ¥ 2.064.575              | 5                                | (94)                               | (89)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 102                    | SGD 131                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF 3.864              | \$ 4.846                 | 0                                | (28)                               | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 92                 | 13                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK 130                | 20                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥ 100.092              | 690                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 101                | 80                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 990                 | AUD 1.513                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 7.728                  | ¥ 1.120.709              | 60                               | 0                                  | 60                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          | AUD 400                | \$ 260                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | BRL 2.674              | 477                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | € 700                  | 816                      | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 123                 | CHF 99                   | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 09.2025          | 3.379                  | MXN 65.791               | 76                               | 0                                  | 76                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 137                    | SEK 1.293                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL 51.213             | \$ 9.290                 | 0                                | (93)                               | (93)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR 2.191.987          | 135                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MYR 5.596              | 1.322                    | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PEN 277                | 74                       | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 14                  | IDR 223.535              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2                      | MYR 7                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 36                     | SGD 46                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 177                    | ZAR 3.200                | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HUF 962.800            | \$ 2.658                 | 0                                | (162)                              | (162)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | SGD 46                 | 36                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 94                  | HUF 34.137               | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | NOK 9.302              | \$ 920                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 200                 | IDR 3.273.600            | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| IND        | 09.2025          | 100                    | MXN 1.917                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 100                    | MYR 422                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025          | 9.290                  | BRL 52.385               | 90                               | 0                                  | 90                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 12.129                 | NZD 20.000               | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 35                 | \$ 5                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| JPM        | 07.2025          | CNH                    | 9                        | \$ 1                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 225                      | 34                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 151.700                  | 111                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PHP                    | 150.100                  | 2.687                            | 23                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 8.065                    | 2.174                            | 0                                  | (57)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 1.319                    | 1.027                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 27                       | AUD 41                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 98                       | KRW 132.971                      | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.032                    | PLN 3.846                        | 32                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 54                       | SGD 69                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 59.982                   | \$ 3.356                         | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 41                       | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 78                       | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 12.373                   | 143                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 69                       | 54                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 254                      | CNH 1.812                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | ¥                      | 31.259                   | \$ 218                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 25.655                   | 18.679                           | 0                                  | (123)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF                    | 10                       | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 12                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 5.425                    | 6.239                            | 0                                  | (129)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 55                       | 75                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 29.565                   | 3.771                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | ¥                      | 25.156                   | 175                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 13.681                   | 8.160                            | 0                                  | (145)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | PLN                    | 102                      | 28                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 3.188                    | 2.485                            | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 26.932                   | 814                              | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 72                       | AUD 111                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 19.509                   | CAD 26.527                       | 32                                 | (100)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.248                    | € 1.080                          | 19                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.203                    | £ 891                            | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 12                       | IDR 187.697                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.329                    | ¥ 336.227                        | 2                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.367                    | NOK 53.125                       | 0                                  | (117)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4.013                    | SEK 38.050                       | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.421                    | SGD 1.838                        | 22                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 5.841                    | \$ 4.257                         | 0                                  | (32)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 1.833                    | 1.421                            | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | HUF                    | 35.079                   | 100                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 200                      | CLP 187.616                      | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 200                      | THB 6.509                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 274                      | \$ 178                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 60                       | 75                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 228                      | 268                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 10                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 411.569                  | 2.825                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | PLN                    | 18                       | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 2.160                    | 1.694                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 64                       | CNH 459                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5                        | £ 3                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 590                      | ¥ 85.487                         | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.091                    | NOK 51.351                       | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.777                    | SGD 2.276                        | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 78                       | \$ 11                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 33.659                   | 232                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 51.342                   | 5.091                            | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.517                    | ¥ 365.574                        | 24                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | CZK                    | 2.133                    | \$ 100                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | HUF                    | 34.808                   | 100                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | ILS                    | 350                      | 100                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | NZD                    | 300                      | 181                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 131                      | AUD 200                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 147                      | CAD 199                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 201                      | COP 832.397                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 182                      | NOK 1.801                        | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | ZAR                    | 1.784                    | \$ 100                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 146                      | HKD 1.149                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 1.145                    | \$ 146                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 116                      | € 100                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | SEK                    | 290                      | \$ 31                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 100                      | COP 412.280                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | CNH                    | 2.329                    | \$ 325                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 10.194.198               | 626                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 22                       | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 2.066                    | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 64                       | IDR 1.039.589                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3                        | ¥ 376                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 284                      | SGD 366                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 167                      | \$ 23                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 9.574                    | 112                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 375                      | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 365                      | 284                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| SOG        | 08.2025          | \$                     | ¥ 14                     | 2.058                            | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | CAD                    | \$ 199                   | 146                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | CHF                    | 495                      | 618                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 624.310                  | 4.325                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 386                      | 55.758                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 532                      | 5.346                            | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 31                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HUF                    | 45.443                   | 125                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 74                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 55.553                   | 386                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 5.345                    | 532                              | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 4                        | 1.611                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 4.325                    | 622.019                          | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PLN                    | 368                      | 100                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 200                      | 3.852                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | CNH                    | 420                      | 59                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 38.732                   | 52.428                           | 0                                  | (650)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 32                       | 232                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 232                      | 32                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | INR                    | 8.667                    | 100                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | KRW                    | 136.069                  | 100                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PHP                    | 5.696                    | 100                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | SEK                    | 6.667                    | 702                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | SGD                    | 255                      | 200                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 200                      | 1.122                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 27                       | 3.881                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 200                      | 270.970                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 100                      | 1.922                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 200                      | 11.419                           | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | ZAR                    | 1.796                    | 100                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| UAG        | 12.2025          | PEN                    | 744                      | 201                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CLP                    | 2.881.784                | 3.069                            | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 2.747                    | 350                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 220                      | 61                               | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 5.897                    | 41                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 99.309                   | 9.779                            | 0                                  | (34)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 4.276                    | 129                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.217                    | 2.074.749                        | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 398                      | 2.849                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.026                    | 3.711                            | 59                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 263                      | 38.109                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 2.842                    | 398                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 15.635                   | 807                              | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | THB                    | 3.239                    | 100                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 100                      | 93.535                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 200                      | 17.283                           | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 131                      | 2.540                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 3.611                         | \$ (10.169)                        | \$ (6.558)                                           | (0,26)                  |

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Institutional AUD (Hedged) ausschüttend II und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                    | 16.845                   | \$ 10.943                        | \$ 0                               | \$ (97)                                              | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | €                      | 60                       | 70                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 8                        | NZD 13                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 13                       | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 10.949                   | AUD 16.845                       | 97                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 08.2025          |                        | 52                       | € 44                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 601                      | \$ 389                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 1.316                    | 1.497                            | 0                                  | (48)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.243                    | AUD 3.460                        | 24                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 12                       | £ 9                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          |                        | 2                        | SGD 3                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 27                       | TWD 800                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 3                        | \$ 2                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY                    | 239                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 1.539                    | 999                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | €                      | 19                       | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 40.699                   | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 420                      | 13                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 0                        | BRL 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 703                      | \$ 22                            | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 1.515                    | 983                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 104                      | 18                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 106                      | 121                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MYR                    | 57                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 61                       | 16                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |

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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK        | 07.2025          | \$                     | 11.455 AUD               | 17.763                           | \$ 186                             | \$ 0                                                 | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 32 CHF                   | 26                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 40 €                     | 35                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 660 £                    | 485                              | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 473 \$                   | 644                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MYR                    | 15                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 4.201                    | 2.732                            | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 45                       | 33                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 16                       | 19                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CLP                    | 7.040                    | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 559                      | 78                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 33                       | 37                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 331.809                  | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 11.236                   | 79                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 22                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PHP                    | 435                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 1                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 936                      | 32                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.732                    | AUD 2.656                        | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 41                       | CAD 56                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 7                        | CLP 7.040                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 16                       | € 14                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 20                       | £ 15                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CLP                    | 7.040                    | \$ 7                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 2.497                    | 319                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 2.149                    | 66                               | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | \$                     | 9.238 AUD                | 14.346                           | 164                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 46 DKK                   | 291                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.602 €                  | 1.381                            | 19                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 291                      | \$ 46                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 08.2025          | €                      | 1.378                    | 1.602                            | 0                                  | (19)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 15.854                   | 10.365                           | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 335                      | 59                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 356                      | 433                              | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | ¥                      | 122.061                  | 851                              | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 1.177                    | 123                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 10.556                   | AUD 16.360                       | 166                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 80                       | BRL 439                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 431                      | CHF 345                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 62                       | DKK 396                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 505                      | ¥ 73.562                         | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | BRL                    | 443                      | \$ 80                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 344                      | 431                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 395                      | 62                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 73.292                   | 505                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 10.372                   | AUD 15.854                       | 25                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AED                    | 83                       | \$ 23                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 629                      | 19                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 0                        | BRL 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| IND        | 09.2025          | MYR                    | 24                       | \$ 6                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 125                      | SEK 1.182                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 08.2025          | SEK                    | 1.180                    | \$ 125                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 15.681                   | 10.278                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 41                       | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 687                      | 104                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | NZD                    | 13                       | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 17                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 373                      | 11                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1                        | SGD 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 2                        | \$ 1                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 10.284                   | AUD 15.681                       | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 281                      | \$ 180                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 760                      | 554                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 61                       | 70                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 20                       | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 492                      | 63                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 57                       | 16                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 15.456                   | 107                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 234.659                  | 171                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 207                      | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 42                       | 33                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.272                    | AUD 1.973                        | 21                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 557                      | CAD 766                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 191                      | € 165                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 102                      | ¥ 14.672                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 17                       | PLN 61                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 34                       | SGD 44                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 19                       | THB 629                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 47                       | ZAR 839                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 764                      | \$ 557                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| MYI        | 08.2025          | PLN                 | 61                    | \$ 17                         | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 44                    | 34                            | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | THB                 | 628                   | 19                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 706                   | 22                            | 0                               | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ZAR                 | 841                   | 47                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | INR                 | 30.864                | 356                           | 0                               | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 2.757                 | 19                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | MXN                 | 595                   | 31                            | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 4.202                 | 142                           | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 18                    | HKD 142                       | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 169                   | ¥ 24.586                      | 2                               | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 40                    | NOK 399                       | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 24.496                | \$ 169                        | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 399                   | 40                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TRY                 | 180                   | 4                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          | \$                  | 18                    | CAD 25                        | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 230                   | HKD 1.801                     | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 13                    | MYR 57                        | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | HKD                 | 1.796                 | \$ 230                        | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | MYR                 | 57                    | 13                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| RYL SCX    | 07.2025          | ZAR                 | 442                   | 24                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HKD                 | 888                   | 114                           | 1                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 78                    | CNY 560                       | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 2                     | ¥ 247                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 31                    | MXN 595                       | 1                               | 1                                              | 0,00                 |
| SOG        | 07.2025          |                     | 7                     | SGD 9                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNY                 | 558                   | \$ 78                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 246                   | 2                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | MXN                 | 595                   | 31                            | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 9                     | 7                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 423                   | 13                            | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HKD                 | 2.913                 | 373                           | 2                               | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 41                    | HKD 320                       | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 278                   | ¥ 40.155                      | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 4                     | NOK 42                        | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 401                   | \$ 22                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 36.451                | 253                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 41                    | 4                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 489                   | 662                           | 0                               | (8)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | INR                 | 2.980                 | 35                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | TWD                 | 618                   | 21                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 28                    | INR 2.365                     | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 21                    | £ 15                          | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HKD                 | 476                   | \$ 61                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 1.799                 | 12                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | NOK                 | 211                   | 21                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 20                    | IDR 331.809                   | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 367                   | INR 31.494                    | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 202                   | KRW 275.358                   | 2                               | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 8                     | PHP 434                       | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 0                     | \$ 0                          | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | IDR                 | 331.809               | 20                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | INR                 | 31.538                | 367                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | KRW                 | 275.358               | 202                           | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | PHP                 | 434                   | 8                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 1.444                 | 45                            | 0                               | (5)                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 750                        | \$ (341)                        | \$ 409                                         | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse M Retail CHF (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | AUD                 | 35                    | \$ 23                         | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 17                    | 13                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 12                    | 14                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 726                   | 826                           | 0                               | (27)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HKD                 | 79                    | 10                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 17.004                | 12                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 389                   | CHF 316                       | 8                               | 8                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1                     | SGD 2                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 2                     | \$ 1                          | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 851                   | 27                            | 0                               | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | IDR                 | 11.975                | 1                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 91.514                | 67                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PHP                 | 144                   | 3                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PLN                 | 2                     | 1                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 92                    | 10                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | THB                 | 22                    | 1                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 579                   | 18                            | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 0                     | BRL 0                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | INR                 | 3.615                 | \$ 42                         | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |



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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK        | 08.2025          | TWD                    | 1.068                    | \$ 33                            | \$ 0                               | \$ (4)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 28                       | 35                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 237                      | 33                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 343                      | 52                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 11                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 5.128                    | 36                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 36.709                   | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 12                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 2                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 212                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 857                      | 26                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 6.250                    | CHF 5.086                        | 140                                | 140                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 43                       | CNY 305                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 0                        | DKK 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 73                       | SEK 691                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNY                    | 304                      | \$ 43                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 3.670                    | 42                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK                    | 689                      | 73                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 1.283                    | 39                               | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 3                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | \$                     | 23                       | DKK 145                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 878                      | € 757                            | 10                                 | 10                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 145                      | \$ 23                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 755                      | 878                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 5.785                    | 67                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 0                        | MXN 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 210                      | \$ 135                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 225                      | 39                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 4.681                    | 5.847                            | 0                                  | (34)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 65.900                   | 459                              | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | NZD                    | 7                        | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 596                      | 62                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 7                        | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 160                      | AUD 245                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 41                       | BRL 225                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.134                    | CHF 4.228                        | 177                                | 177                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 31                       | DKK 198                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 277                      | ¥ 40.339                         | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1                        | SGD 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 245                      | \$ 160                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 197                      | 31                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 3.552                    | 41                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 40.191                   | 277                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 1                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 0                        | BRL 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 5.847                    | CHF 4.662                        | 34                                 | 34                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          | BRL                    | 228                      | \$ 41                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 305                      | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 63.094                   | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 219                      | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | ZAR                    | 615                      | 34                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | AED                    | 37                       | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MYR                    | 40                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 16                       | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 418                      | 305                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 41                       | 48                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 29                       | 40                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 2.298                    | 294                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 53.172                   | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 3.722                    | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | PHP                    | 81                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 18                       | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 22                       | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 106                      | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 367                      | 11                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 307                      | CAD 423                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.877                    | CHF 4.823                        | 182                                | 182                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 21                       | SGD 27                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1                        | THB 22                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 422                      | \$ 307                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 27                       | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 461                      | 14                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 117                      | CHF 94                           | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 216                      | ¥ 31.375                         | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 21                       | NOK 208                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 31.259                   | \$ 216                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 208                      | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 107                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 22                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 129                      | 4                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | CNY                    | 67                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 243                      | 329                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 9                        | CAD 13                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| UAG        | 07.2025          | \$                     | 364 £                    | 265 \$                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 13 \$                    | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 265                      | 364                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 905                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 436                      | 13                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CLP                    | 3.654                    | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 32                       | 9                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 4.028                    | 28                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 111                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 562                           | \$ (117)                           | \$ 445                                               | 0,02                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend und M Retail EUR (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | 171.824 \$               | 201.185                          | \$ 0                               | \$ (510)                                             | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 5.360 AUD                | 8.252                            | 47                                 | 47                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 10 CHF                   | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 157.565 €                | 138.675                          | 5.218                              | 0                                                    | 0,20                    |
|            | 07.2025          |                        | 242 NZD                  | 402                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 8.252 \$                 | 5.363                            | 0                                  | (48)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 8                        | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 402                      | 242                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 201.626 €                | 171.824                          | 509                                | 509                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 187.071                  | 164.523                          | 6.055                              | 6.055                                                | 0,24                    |
| BOA        | 07.2025          |                        | 52 SGD                   | 66                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 66 \$                    | 52                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | €                      | 246                      | 285                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 61 €                     | 53                               | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | €                      | 215 \$                   | 243                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MYR                    | 2.672                    | 634                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 162                      | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 2.265                    | 604                              | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 16.086                   | 397                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 4 BRL                    | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 0 CZK                    | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 210.233 €                | 185.024                          | 6.958                              | 0                                                    | 0,27                    |
|            | 07.2025          |                        | 12.128 £                 | 8.914                            | 87                                 | 87                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 0 NZD                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BSH        | 08.2025          | £                      | 8.914 \$                 | 12.130                           | 0                                  | (87)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 8.237                    | 1.255                            | 0                                  | (42)                                                 | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | CHF                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CLP                    | 144.422                  | 153                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 10.718                   | 1.495                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 4                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 5.072                    | 5.875                            | 0                                  | (79)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 10.684.364               | 655                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PHP                    | 31.016                   | 558                              | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 62                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 7                        | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 152 CLP                  | 144.422                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          |                        | 545 €                    | 473                              | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 0 ¥                      | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CLP                    | 144.422 \$               | 152                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 43.667                   | 5.582                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 176.204                  | 204.415                          | 0                                  | (2.423)                                              | (0,10)                  |
|            | 07.2025          | SGD                    | 7                        | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 670 DKK                  | 4.264                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 4.254                    | 670                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 204.415 €                | 175.818                          | 2.420                              | 0                                                    | 0,09                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 8.252 \$                 | 5.324                            | 0                                  | (84)                                                 | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | BRL                    | 9.802                    | 1.714                            | 0                                  | (82)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 6.335                    | 7.694                            | 0                                  | (266)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 2.302.976                | 16.053                           | 110                                | 110                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 22.966                   | 2.398                            | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 10                       | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.778 BRL                | 9.796                            | 17                                 | 17                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 7.915 CHF                | 6.336                            | 45                                 | 45                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.324 DKK                | 8.428                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 9.035 ¥                  | 1.315.204                        | 70                                 | 70                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 42 SGD                   | 53                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 08.2025          | BRL                    | 9.870 \$                 | 1.778                            | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 6.310                    | 7.915                            | 0                                  | (46)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 8.408                    | 1.324                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 1.310.368                | 9.035                            | 0                                  | (70)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 53                       | 42                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 15                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 42.921                   | 1.315                            | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.476 INR                | 211.787                          | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 16 SGD                   | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |      |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|------|
| IND        | 08.2025          | INR                    | 212.082                  | \$ 2.476                         | \$ 7                               | \$ 7                                                 | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | SGD                    | 21                       | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 3                        | BRL 15                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 2.437                    | SEK 23.057                       | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | SEK                    | 23.008                   | \$ 2.437                         | 18                                 | 18                                                   | 0,00                    |      |
| JPM        | 07.2025          | DKK                    | 6.383                    | 967                              | 0                                  | (38)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | NZD                    | 402                      | 240                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | SGD                    | 456                      | 355                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |      |
| MBC        | 07.2025          | \$                     | 34                       | SGD 43                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | SGD                    | 43                       | \$ 34                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | CAD                    | 13.403                   | 9.758                            | 0                                  | (64)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | CHF                    | 9                        | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | €                      | 303                      | 349                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |      |
| MYI        | 07.2025          | HKD                    | 9.062                    | 1.160                            | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | ILS                    | 779                      | 221                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | ¥                      | 105.189                  | 732                              | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | KRW                    | 4.804.393                | 3.501                            | 0                                  | (53)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | SGD                    | 1.095                    | 854                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 9.754                    | CAD 13.408                       | 72                                 | 72                                                   | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 1                        | CZK 11                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 1.507                    | € 1.302                          | 21                                 | 21                                                   | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 626                      | PLN 2.261                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 892                      | SGD 1.154                        | 14                                 | 14                                                   | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 1.316                    | THB 42.921                       | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 893                      | ZAR 15.879                       | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | CAD                    | 13.385                   | \$ 9.754                         | 0                                  | (72)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | CZK                    | 11                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | PLN                    | 2.262                    | 626                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | SGD                    | 1.151                    | 892                              | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | THB                    | 42.853                   | 1.317                            | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | ZAR                    | 15.918                   | 893                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | CZK                    | 3.669                    | 167                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | HUF                    | 40                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    | INR              | 539.889                | 6.233                    | 0                                | (60)                               | 0,00                                                 |                         |      |
| 07.2025    | ¥                | 52.024                 | 360                      | 0                                | 0                                  | 0,00                                                 |                         |      |
| 07.2025    | MXN              | 16.774                 | 862                      | 0                                | (26)                               | 0,00                                                 |                         |      |
| 07.2025    | TWD              | 199.616                | 6.761                    | 0                                | (97)                               | 0,00                                                 |                         |      |
| 07.2025    | \$               | 3.034                  | ¥ 442.275                | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | 152                    | NOK 1.537                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    | ¥                | 440.649                | \$ 3.034                 | 1                                | (28)                               | (27)                                                 | 0,00                    |      |
| 08.2025    | NOK              | 1.537                  | 152                      | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    | \$               | 4.014                  | HKD 31.498               | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | 6                      | KRW 8.157                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | 631                    | MYR 2.672                | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    | HKD              | 31.396                 | \$ 4.014                 | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    | MYR              | 2.672                  | 632                      | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |      |
| 07.2025    | AED              | 2.106                  | 574                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    | HKD              | 16.377                 | 2.097                    | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |      |
| 07.2025    | \$               | 1.500                  | CNY 10.743               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | 34                     | ¥ 4.927                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | 873                    | MXN 16.774               | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | 178                    | SGD 230                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    | CNY              | 10.714                 | \$ 1.500                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    | ¥                | 4.909                  | 34                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    | MXN              | 16.774                 | 869                      | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |      |
| 08.2025    | SGD              | 229                    | 178                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |      |
| 07.2025    | HKD              | 49.842                 | 6.381                    | 32                               | 0                                  | 32                                                   | 0,00                    |      |
| 07.2025    | \$               | 5.057                  | ¥ 729.963                | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | 16                     | NOK 160                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    | ZAR              | 23.067                 | \$ 1.284                 | 0                                | (14)                               | (14)                                                 | 0,00                    |      |
| 08.2025    | ¥                | 727.284                | 5.057                    | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    | NOK              | 160                    | 16                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    | £                | 8.914                  | 12.069                   | 0                                | (146)                              | (146)                                                | (0,01)                  |      |
| SSB        | 07.2025          | HKD                    | 35                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| UAG        | 07.2025          | HUF                    | 150.459                  | 422                              | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | ¥                      | 33.945                   | 235                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | NOK                    | 1.535                    | 151                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | TWD                    | 466                      | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 173                      | CZK 3.647                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 656                      | IDR 10.684.364                   | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 3.519                    | KRW 4.796.237                    | 29                                 | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 548                      | PHP 30.980                       | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 3                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | CZK                    | 3.644                    | 173                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | IDR                    | 10.684.364               | 655                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | KRW                    | 4.796.237                | 3.525                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | PHP                    | 31.002                   | 548                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$ 21.841                          | \$ (4.581)                                           | \$ 17.260               | 0,68 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und M Retail GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung |        | Zu erhaltende<br>Währung |        | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------|--------------------------|--------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | 5      | \$                       | 6      | \$                               | 0                                  | \$                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 2.685  |                          | 3.684  |                                  | 5                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 112    | AUD                      | 173    |                                  | 1                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4      | CAD                      | 5      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 13     | €                        | 11     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2      | NZD                      | 4      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 173    | \$                       | 112    |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 5      |                          | 4      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 11     |                          | 13     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 4      |                          | 2      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 3.685  | £                        | 2.685  |                                  | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 13     | \$                       | 8      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 474    |                          | 539    |                                  | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 10     | CHF                      | 8      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 8      | INR                      | 671    |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 11     | ¥                        | 1.542  |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1      | SGD                      | 1      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 1      | \$                       | 1      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY                    | 55     |                          | 1      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 242    |                          | 8      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 10     |                          | 11     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 3.310  |                          | 4.501  |                                  | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR                    | 3.866  |                          | 45     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 13.906 |                          | 10     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
| BPS<br>BRC | 07.2025          | MYR                    | 18     |                          | 4      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 13     |                          | 3      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 0      | BRL                      | 0      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.585  | £                        | 2.654  |                                  | 53                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 4.156  |                          | 3.054  |                                  | 30                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 134    | \$                       | 20     |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 14     |                          | 9      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 0      |                          | 0      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CLP                    | 2.171  |                          | 2      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 165    |                          | 23     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 0      |                          | 0      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 53     |                          | 61     |                                  | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| BSH<br>CBK | 07.2025          | IDR                    | 68.920 |                          | 4      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR                    | 936    |                          | 11     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 6      |                          | 1      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PHP                    | 132    |                          | 2      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 1      |                          | 0      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 0      |                          | 0      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 6      | AUD                      | 9      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2      | CLP                      | 2.171  |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 329    | £                        | 243    |                                  | 3                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CLP                    | 2.171  | \$                       | 2      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 979    |                          | 125    |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 16     | DKK                      | 101    |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          |                        | 595    | €                        | 513    |                                  | 7                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 101    | \$                       | 16     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 512    |                          | 595    |                                  | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 155    |                          | 100    |                                  | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 136    |                          | 24     |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 129    |                          | 157    |                                  | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 42.792 |                          | 298    |                                  | 2                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 469    |                          | 49     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 25     | BRL                      | 136    |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 164    | CHF                      | 131    |                                  | 1                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 22     | DKK                      | 137    |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 185    | ¥                        | 26.929 |                                  | 1                                  |                                                      | 0,00                    |
| FAR        | 08.2025          | BRL                    | 137    | \$                       | 25     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 131    |                          | 164    |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 137    |                          | 22     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 26.830 |                          | 185    |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 0      |                          | 0      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 206    |                          | 6      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 0      | BRL                      | 0      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 50     | SEK                      | 471    |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK                    | 470    | \$                       | 50     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 10     |                          | 12     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 104    |                          | 16     |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 4      |                          | 2      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | SGD                    | 8      |                          | 6      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.944  | £                        | 2.927  |                                  | 68                                 |                                                      | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 1      | SGD                      | 1      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 8      | TWD                      | 229    |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 1      | \$                       | 1      |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 294    |                          | 214    |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 17     |                          | 19     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 608    |                          | 823    |                                  | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 185    |                          | 24     |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
| MBC        |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |        |                          |        |                                  |                                    |                                                      |                         |

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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025          | ILS                    | 19 \$                    | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 5.313                    | 37                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 80.645                   | 59                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 19                       | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 205                      | CAD 282                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 40 €                     | 35                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.279                    | £ 947                            | 18                                 | 18                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4                        | PLN 13                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 16                       | SGD 20                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 6                        | THB 206                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 23                       | ZAR 413                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 282                      | \$ 205                           | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PLN                    | 13                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 20                       | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | THB                    | 206                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ZAR                    | 414                      | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | INR                    | 6.441                    | 74                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 5.015                    | 35                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MXN                    | 186                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 3.806                    | 129                              | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 62                       | ¥ 9.095                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 14                       | NOK 139                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 9.061                    | \$ 62                            | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 139                      | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RBC        | 08.2025          | TRY                    | 41                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 2                        | CAD 3                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 84                       | HKD 658                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4                        | MYR 18                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 656                      | \$ 84                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | MYR                    | 18                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | NOK                    | 88                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | AED                    | 25                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 335                      | 43                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 23                       | CNY 166                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1                        | ¥ 108                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 10                       | MXN 186                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3                        | SGD 4                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNY                    | 165                      | \$ 23                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 108                      | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | MXN                    | 186                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 4                        | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | HKD                    | 1.019                    | 131                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 12                       | HKD 92                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 111                      | ¥ 16.039                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1                        | NOK 15                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 265                      | \$ 15                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 15.980                   | 111                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | MXN                    | 112                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 08.2025          | NOK                    | 15                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 3.045                    | 4.175                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR                    | 907                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 8.192                    | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 309                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 3                        | CAD 4                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.841                    | £ 2.837                          | 46                                 | 46                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 4                        | \$ 3                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 08.2025          | \$                     | 4.176                    | £ 3.045                          | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 193                      | \$ 25                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 631                      | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 60                       | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 54                       | £ 40                             | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4                        | IDR 68.920                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 134                      | INR 11.485                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 75                       | KRW 102.743                      | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2                        | PHP 132                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 150                      | \$ 8                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | IDR                    | 68.920                   | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 11.501                   | 134                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | KRW                    | 102.743                  | 76                               | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PHP                    | 132                      | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 244                           | \$ (102)                           | \$ 142                                               | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional JPY (Hedged) ausschüttend II und M Retail JPY (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | 103                      | \$ 0                             | \$ (4)                             | \$ (4)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 659                      | AUD 1.015                        | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 1.015                    | \$ 660                           | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 2.877                    | 3.272                            | 0                                  | (106)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 8.571                    | 60                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025          | \$                     | SGD 5                    | 7                                | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 7                        | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY                    | 323                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | ¥                      | 244.859                  | 1.697                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 76                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 43                       | 37                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.297                    | 328.894                          | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 127                      | 4                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | INR                    | 26.058                   | 301                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MYR                    | 194                      | 46                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 75                       | 20                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 0                        | BRL 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.392                    | £ 1.023                          | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.685                    | ¥ 242.306                        | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 1.023                    | \$ 1.392                         | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | CHF                    | 1                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 1.020                    | 142                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 73                       | 83                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 491.072                  | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 45                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 9                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 3                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 1.599                    | 54                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 43                       | CAD 59                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 179                      | € 156                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.459                    | ¥ 350.104                        | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 5.452                    | \$ 697                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 388                      | 12                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | \$                     | 122                      | DKK 779                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.490                    | € 3.008                          | 41                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 777                      | \$ 122                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 3.001                    | 3.490                            | 0                                  | (41)                                                 | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | AUD                    | 1.015                    | 655                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 952                      | 166                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 799                      | 970                              | 0                                  | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 1.846.098                | 12.683                           | 0                                  | (98)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 3.167                    | 331                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 173                      | BRL 951                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 998                      | CHF 799                          | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 166                      | DKK 1.059                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 21.975                   | ¥ 3.152.480                      | 0                                  | (150)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | BRL                    | 958                      | \$ 173                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 796                      | 998                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 1.056                    | 166                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 08.2025          | \$                     | 12.683                   | ¥ 1.839.309                      | 98                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AED                    | 187                      | \$ 51                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 0                        | BRL 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| IND        | 09.2025          | MYR                    | 2                        | \$ 1                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 44                       | HKD 345                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 336                      | SEK 3.180                        | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK                    | 3.173                    | \$ 336                           | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | DKK                    | 1.836                    | 278                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 48                       | 37                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 67                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 51                       | £ 38                             | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4                        | SGD 5                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 08.2025          | SGD                    | 5                        | \$ 4                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 1.680                    | 1.223                            | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 147                      | 169                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 61                       | 82                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 1.093                    | 140                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 117                      | 33                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 351.549                  | 2.442                            | 10                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 549.558                  | 400                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 115                      | 90                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 29                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.179                    | CAD 1.621                        | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 37                       | £ 27                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 22.248                   | ¥ 3.203.608                      | 31                                 | (101)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 21                       | PLN 74                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 94                       | SGD 121                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1                        | THB 29                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 126                      | ZAR 2.247                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 1.619                    | \$ 1.179                         | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PLN                    | 74                       | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 121                      | 94                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | THB                    | 29                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 127                      | 4                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ZAR                    | 2.252                    | 126                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | INR                    | 43.418                   | 501                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 3.278.633                | 22.629                           | 10                                 | (79)                                                 | 0,00                    |

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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
|            | 07.2025          | MXN                 | 1.072 \$              | 55                            | \$ 0                            | \$ (2)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 21.789                | 738                           | 0                               | (11)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 10.536 ¥              | 1.522.091                     | 1                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 87 NOK                | 876                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 876 \$                | 87                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TRY                 | 243                   | 6                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 22.243 ¥              | 3.211.020                     | 78                              | (9)                                           | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          |                     | 501 HKD               | 3.932                         | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 46 MYR                | 194                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | HKD                 | 3.920 \$              | 501                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | MYR                 | 194                   | 46                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| RYL        | 07.2025          | \$                  | 546 ¥                 | 4                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 497                   | 49                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | HKD                 | 1.975                 | 253                           | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 1.169.576             | 8.101                         | 4                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 143 CNY               | 1.023                         | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 262 ¥                 | 37.581                        | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 56 MXN                | 1.072                         | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 19 SGD                | 24                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNY                 | 1.020 \$              | 143                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | MXN                 | 1.072                 | 56                            | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 24                    | 19                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 76                    | 2                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 7.680 ¥               | 1.105.051                     | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
| SOG        | 07.2025          | HKD                 | 6.676 \$              | 855                           | 4                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 3.341.260             | 23.147                        | 15                              | 15                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 104 ¥                 | 15.029                        | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 9 NOK                 | 91                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 2.255 \$              | 126                           | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 91                    | 9                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 23.147 ¥              | 3.328.999                     | 0                               | (15)                                          | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £                   | 1.027 \$              | 1.391                         | 0                               | (17)                                          | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | HKD                 | 4                     | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 426                   | 42                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 30 IDR                | 491.072                       | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 810 INR               | 69.510                        | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 12.443 ¥              | 1.800.932                     | 25                              | 25                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 403 KRW               | 549.558                       | 3                               | 3                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 1 \$                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | IDR                 | 491.072               | 30                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | INR                 | 69.605                | 810                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | KRW                 | 549.558               | 404                           | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 260                   | 8                             | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 367                        | \$ (841)                        | \$ (474)                                      | (0,02)               |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) thesaurierend, Institutional RMB (Hedged) ausschüttend und M Retail RMB (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                   | 28 \$                 | 32                            | \$ 0                            | \$ (1)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 330 AUD               | 508                           | 3                               | 3                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 58 CNH                | 421                           | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 26 €                  | 22                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 31 £                  | 23                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 5 NZD                 | 8                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | 508 \$                | 330                           | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | €                   | 22                    | 26                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £                   | 23                    | 31                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NZD                 | 8                     | 5                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 153 CNH               | 1.105                         | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | €                   | 1.388 \$              | 1.578                         | 0                               | (51)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 0 BRL                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 2 SGD                 | 2                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 2 \$                  | 2                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TRY                 | 157                   | 4                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | BRL                 | 140                   | 25                            | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 568                   | 79                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 3.585                 | 25                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 22                    | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.024 CNH             | 7.344                         | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 37 \$                 | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 2 CNH                 | 14                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | AUD                 | 37 \$                 | 24                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 49                    | 56                            | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 45                    | 61                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | INR                 | 12.167                | 141                           | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | MYR                 | 58                    | 14                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PLN                 | 67                    | 18                            | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 0 BRL                 | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 695 £                 | 511                           | 5                               | 5                                             | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK        | 08.2025          | £                      | 511                      | \$                               | 695                                | \$                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 1                        |                                  | 0                                  | \$                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CLP                    | 4.400                    |                                  | 5                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 0                        |                                  | 0                                  |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 35                       |                                  | 40                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 300.351                  |                                  | 18                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 7.798                    |                                  | 55                                 | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 22                       |                                  | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PHP                    | 277                      |                                  | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 4                        |                                  | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 1                        |                                  | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 1.022                    |                                  | 34                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 5                        | CLP                              | 4.400                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 11.522                   | CNH                              | 82.661                             | 18                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 500                      | CNY                              | 3.585                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CLP                    | 4.400                    | \$                               | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 2.698                    |                                  | 345                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 112                      |                                  | 3                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 417                      |                                  | 23                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 56                       | DKK                              | 354                                | 0                                                    | 0,00                    |
| CIB<br>DUB | 07.2025          |                        | 1.740                    | €                                | 1.500                              | 21                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 353                      | \$                               | 56                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 1.497                    |                                  | 1.740                              | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 471                      |                                  | 304                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 328                      |                                  | 57                                 | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 367                      |                                  | 445                                | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 834                      |                                  | 116                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 130.106                  |                                  | 907                                | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 1.426                    |                                  | 149                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 85                       | BRL                              | 467                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 458                      | CHF                              | 367                                | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 73                       | CNH                              | 523                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 76                       | DKK                              | 481                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 552                      | ¥                                | 80.304                             | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | BRL                    | 470                      | \$                               | 85                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 365                      |                                  | 458                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 480                      |                                  | 76                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 80.009                   |                                  | 552                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2                        | CNH                              | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | AED                    | 85                       | \$                               | 23                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 1                        |                                  | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 628                      |                                  | 19                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 0                        | BRL                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 151                      | SEK                              | 1.432                              | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK                    | 1.429                    | \$                               | 151                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 47                       |                                  | 34                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 834                      |                                  | 126                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 8                        |                                  | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 17                       |                                  | 13                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 19                       |                                  | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1                        | SGD                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 2                        | \$                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 276                      | CNH                              | 1.992                              | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 804                      | \$                               | 586                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 160                      |                                  | 22                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 22                       |                                  | 26                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 527                      |                                  | 67                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 64                       |                                  | 18                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 5.943                    |                                  | 41                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | KRW                    | 252.019                  |                                  | 184                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 242                      |                                  | 24                                 | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 41                       |                                  | 32                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 595                      | CAD                              | 818                                | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.560                    | CNH                              | 11.182                             | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 18                       | PLN                              | 67                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 33                       | SGD                              | 43                                 | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 19                       | THB                              | 628                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 70                       | ZAR                              | 1.239                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 817                      | \$                               | 595                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PLN                    | 67                       |                                  | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 43                       |                                  | 33                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | THB                    | 627                      |                                  | 19                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 37                       |                                  | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ZAR                    | 1.242                    |                                  | 70                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 2.071                    |                                  | 289                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HUF                    | 1.050                    |                                  | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR                    | 20.273                   |                                  | 234                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 2.939                    |                                  | 20                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MXN                    | 584                      |                                  | 30                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | TWD                    | 10.498                   |                                  | 356                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.713                    | CNH                              | 12.273                             | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 185                      | ¥                                | 27.005                             | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 42                       | NOK                              | 424                                | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |



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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| RBC        | 08.2025          | CNH                    | 2.594                    | \$ 362                           | \$ 0                               | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 26.905                   | 185                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 424                      | 42                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY                    | 118                      | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2                        | CNH 15                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 248                      | HKD 1.946                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 14                       | MYR 58                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HKD                    | 1.940                    | \$ 248                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | MYR                    | 58                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 2.757                    | 385                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | HKD                    | 952                      | 122                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 10.836                   | CNH 77.670                       | 7                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2                        | ¥ 301                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 30                       | MXN 584                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 7                        | SGD 9                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 300                      | \$ 2                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | MXN                    | 584                      | 30                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 9                        | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 22                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 4                        | CNH 26                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 08.2025          |                        | 385                      | CNY 2.750                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 2.897                    | \$ 371                           | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 8.301                    | CNH 59.607                       | 20                                 | 20                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 309                      | ¥ 44.571                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4                        | NOK 44                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 827                      | \$ 46                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 44.407                   | 309                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 44                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 88.717                   | 12.376                           | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 489                      | 662                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | INR                    | 2.020                    | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 35.452                   | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 24                       | CAD 32                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 57                       | CNH 412                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 32                       | \$ 24                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 12.241                   | CNH 87.519                       | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 83.767                   | \$ 11.691                        | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | HKD                    | 278                      | 36                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 1.918                    | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 204                      | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | \$                     | 18                       | IDR 300.351                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 402                      | INR 34.478                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 211                      | KRW 287.470                      | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5                        | PHP 277                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 0                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | IDR                    | 300.351                  | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 34.525                   | 402                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | KRW                    | 287.470                  | 211                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PHP                    | 277                      | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 11.691                   | CNH 83.558                       | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 123                           | \$ (175)                           | \$ (52)                                              | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend II, Administrative SGD (Hedged) thesaurierend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II, M Retail SGD (Hedged) thesaurierend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II and UM Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | \$                     | 3.465                    | AUD 5.334                        | \$ 31                              | \$ 31                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 372                      | £ 271                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 96                       | NZD 160                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 5.334                    | \$ 3.467                         | 0                                  | (31)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 271                      | 372                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 160                      | 96                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 14.238                   | 16.189                           | 0                                  | (525)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 264                      | 358                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 56.476                   | 44.104                           | 0                                  | (238)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | TWD                    | 7.364                    | 251                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 44.104                   | SGD 56.344                       | 245                                | 245                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 1                        | TWD 26                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS<br>BRC | 07.2025          | AUD                    | 569                      | \$ 367                           | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 874                      | 997                              | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR                    | 129.931                  | 1.502                            | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MYR                    | 591                      | 140                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 246                      | 24                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 686                      | 183                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 5.242                    | 129                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1                        | BRL 8                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 7.394                    | £ 5.434                          | 53                                 | 53                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 0                        | NZD 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.426                    | SGD 1.835                        | 14                                 | 14                                                   | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu zahlende Betrag | Zu erhaltende Währung | Zu erhaltende Betrag | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |      |
|------------|------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|------|
| CBK        | 08.2025          | £                   | 5.434              | \$                    | 7.395                | \$                            | 0                             | \$(53)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | AUD                 | 304                |                       | 199                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | BRL                 | 1.226              |                       | 222                  | 0                             | (3)                           | \$(3)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CAD                 | 665                |                       | 488                  | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CHF                 | 6                  |                       | 7                    | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CLP                 | 85.119             |                       | 90                   | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CNY                 | 4.963              |                       | 692                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | DKK                 | 5                  |                       | 1                    | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | €                   | 585                |                       | 685                  | 0                             | (2)                           | \$(2)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | IDR                 | 3.832.915          |                       | 235                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | ¥                   | 55.371             |                       | 389                  | 6                             | 0                             | 6                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | PHP                 | 5.298              |                       | 95                   | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SEK                 | 37                 |                       | 4                    | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 90                 | CLP                   | 85.119               | 2                             | 0                             | 2                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 13.402             | SGD                   | 17.167               | 77                            | 0                             | 77                                            | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | CLP                 | 85.119             | \$                    | 90                   | 0                             | (2)                           | \$(2)                                         | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | HKD                 | 28.858             |                       | 3.689                | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | \$                  | 1                  | TWD                   | 45                   | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | DUB              | 07.2025             |                    | 519                   | DKK                  | 3.307                         | 1                             | 0                                             | 1                    | 0,00 |
|            |                  | 07.2025             |                    | 18.236                | €                    | 15.719                        | 217                           | 0                                             | 217                  | 0,01 |
| 07.2025    |                  |                     | 50.554             | SGD                   | 65.125               | 580                           | 0                             | 580                                           | 0,02                 |      |
| 08.2025    |                  | DKK                 | 3.299              | \$                    | 519                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
| 08.2025    |                  | €                   | 15.685             |                       | 18.236               | 0                             | (217)                         | \$(217)                                       | (0,01)               |      |
| FAR        | 07.2025          | AUD                 | 4.461              |                       | 2.878                | 0                             | (45)                          | \$(45)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | BRL                 | 3.756              |                       | 657                  | 0                             | (31)                          | \$(31)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CHF                 | 3.852              |                       | 4.678                | 0                             | (162)                         | \$(162)                                       | (0,01)               |      |
|            | 07.2025          | ¥                   | 1.309.666          |                       | 9.129                | 62                            | 0                             | 62                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SEK                 | 13.565             |                       | 1.416                | 0                             | (7)                           | \$(7)                                         | 0,00                 |      |
| GLM        | 07.2025          | SGD                 | 127.379            |                       | 99.871               | 0                             | (141)                         | \$(141)                                       | (0,01)               |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 904                | BRL                   | 4.982                | 9                             | 0                             | 9                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 5.016              | CHF                   | 4.015                | 29                            | 0                             | 29                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 706                | DKK                   | 4.495                | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 5.802              | ¥                     | 844.504              | 45                            | 0                             | 45                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 97.682             | SGD                   | 125.680              | 996                           | 0                             | 996                                           | 0,04                 |      |
|            | 08.2025          | BRL                 | 5.020              | \$                    | 904                  | 0                             | (9)                           | \$(9)                                         | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | CHF                 | 3.999              |                       | 5.016                | 0                             | (29)                          | \$(29)                                        | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | DKK                 | 4.484              |                       | 706                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | ¥                   | 841.399            |                       | 5.802                | 0                             | (45)                          | \$(45)                                        | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | \$                  | 99.871             | SGD                   | 127.075              | 151                           | 0                             | 151                                           | 0,01                 |      |
|            | 07.2025          | AED                 | 1.000              | \$                    | 272                  | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | BRL                 | 8                  |                       | 1                    | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SGD                 | 58.849             |                       | 46.167               | 0                             | (38)                          | \$(38)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | THB                 | 7.335              |                       | 225                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | \$                  | 1                  | BRL                   | 8                    | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          |                     | 46.167             | SGD                   | 58.707               | 42                            | 0                             | 42                                            | 0,00                 |      |
|            | IND              | 07.2025             |                    | 1.440                 | SEK                  | 13.619                        | 0                             | (11)                                          | \$(11)               | 0,00 |
|            |                  | 08.2025             | SEK                | 13.589                | \$                   | 1.440                         | 11                            | 0                                             | 11                   | 0,00 |
|            | JPM              | 07.2025             | DKK                | 7.795                 |                      | 1.180                         | 0                             | (46)                                          | \$(46)               | 0,00 |
| 07.2025    |                  | NZD                 | 160                |                       | 95                   | 0                             | (2)                           | \$(2)                                         | 0,00                 |      |
| 07.2025    |                  | SGD                 | 57.777             |                       | 45.124               | 0                             | (240)                         | \$(240)                                       | (0,01)               |      |
| 07.2025    |                  | \$                  | 112.656            | SGD                   | 144.709              | 962                           | 0                             | 962                                           | 0,04                 |      |
| MBC        | 07.2025          |                     | 1                  | TWD                   | 23                   | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          |                     | 45.124             | SGD                   | 57.644               | 249                           | 0                             | 249                                           | 0,01                 |      |
|            | 07.2025          | CAD                 | 7.993              | \$                    | 5.820                | 0                             | (38)                          | \$(38)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | €                   | 607                |                       | 703                  | 0                             | (10)                          | \$(10)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | £                   | 271                |                       | 372                  | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |      |
| MYI        | 07.2025          | HKD                 | 5.426              |                       | 695                  | 3                             | 0                             | 3                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | ILS                 | 715                |                       | 203                  | 0                             | (9)                           | \$(9)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | ¥                   | 131.175            |                       | 913                  | 5                             | 0                             | 5                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | KRW                 | 2.841.032          |                       | 2.070                | 0                             | (31)                          | \$(31)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | NOK                 | 2.343              |                       | 237                  | 5                             | 0                             | 5                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SGD                 | 139.992            |                       | 108.258              | 0                             | (1.657)                       | \$(1.657)                                     | (0,07)               |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 6.301              | CAD                   | 8.662                | 47                            | 0                             | 47                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 190                | PLN                   | 685                  | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 95.906             | SGD                   | 123.031              | 692                           | 0                             | 692                                           | 0,03                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 225                | THB                   | 7.335                | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |      |
| RBC        | 07.2025          |                     | 735                | ZAR                   | 13.083               | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | CAD                 | 8.647              | \$                    | 6.301                | 0                             | (47)                          | \$(47)                                        | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | PLN                 | 685                |                       | 190                  | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | THB                 | 7.324              |                       | 225                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | \$                  | 106.583            | SGD                   | 137.516              | 1.659                         | 0                             | 1.659                                         | 0,06                 |      |
|            | 08.2025          | ZAR                 | 13.115             | \$                    | 735                  | 0                             | (1)                           | \$(1)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CHF                 | 163                |                       | 200                  | 0                             | (5)                           | \$(5)                                         | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | INR                 | 216.492            |                       | 2.500                | 0                             | (24)                          | \$(24)                                        | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | ¥                   | 45.887             |                       | 318                  | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | MXN                 | 7.040              |                       | 362                  | 0                             | (11)                          | \$(11)                                        | 0,00                 |      |

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

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |    |         |        |           |         |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|----|---------|--------|-----------|---------|
|                                  | 07.2025          | \$                  | 4                     | KRW                           | 4.824                           | \$                                             | 0                    | \$ | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          |                     | 139                   | MYR                           | 591                             |                                                | 1                    |    | 1       | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | HKD                 | 20.748                | \$                            | 2.653                           |                                                | 1                    |    | 1       | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | MYR                 | 591                   |                               | 140                             |                                                | (1)                  |    | (1)     | 0,00   |           |         |
| RYL                              | 07.2025          | \$                  | 0                     | NOK                           | 0                               |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | ZAR                 | 4.131                 | \$                            | 229                             |                                                | (4)                  |    | (4)     | 0,00   |           |         |
| SCX                              | 07.2025          | HKD                 | 9.806                 |                               | 1.255                           |                                                | 6                    |    | 6       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | SGD                 | 23.837                |                               | 18.481                          |                                                | (235)                |    | (235)   | (0,01) |           |         |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 695                   | CNY                           | 4.974                           |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          |                     | 22                    | ¥                             | 3.164                           |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          |                     | 366                   | MXN                           | 7.040                           |                                                | 6                    |    | 6       | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | CNY                 | 4.961                 | \$                            | 695                             |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | ¥                   | 3.152                 |                               | 22                              |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | MXN                 | 7.040                 |                               | 365                             |                                                | (7)                  |    | (7)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 18.481                | SGD                           | 23.783                          |                                                | 240                  |    | 240     | 0,01   |           |         |
| SOG                              | 07.2025          | HKD                 | 29.843                | \$                            | 3.821                           |                                                | 19                   |    | 19      | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | ¥                   | 29.463                |                               | 203                             |                                                | (1)                  |    | (1)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 3.247                 | ¥                             | 468.715                         |                                                | (2)                  |    | (2)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          |                     | 46                    | NOK                           | 463                             |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | ZAR                 | 9.001                 | \$                            | 501                             |                                                | (5)                  |    | (5)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | ¥                   | 466.995               |                               | 3.247                           |                                                | 2                    |    | 2       | 0,00   |           |         |
| SSB                              | 08.2025          | NOK                 | 463                   |                               | 46                              |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | £                   | 5.170                 |                               | 7.001                           |                                                | (85)                 |    | (85)    | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | INR                 | 17.354                |                               | 200                             |                                                | (2)                  |    | (2)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 1.749                 | SGD                           | 2.231                           |                                                | 3                    |    | 3       | 0,00   |           |         |
| UAG                              | 07.2025          | HKD                 | 4.699                 | \$                            | 600                             |                                                | 2                    |    | 2       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | ¥                   | 29.941                |                               | 207                             |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | NOK                 | 2.320                 |                               | 228                             |                                                | (1)                  |    | (1)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | SGD                 | 199                   |                               | 155                             |                                                | (1)                  |    | (1)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 235                   | IDR                           | 3.832.915                       |                                                | 1                    |    | 1       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          |                     | 4.243                 | INR                           | 363.955                         |                                                | (1)                  |    | (1)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          |                     | 2.081                 | KRW                           | 2.836.207                       |                                                | 17                   |    | 17      | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          |                     | 94                    | PHP                           | 5.292                           |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 07.2025          | ZAR                 | 5                     | \$                            | 0                               |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | IDR                 | 3.832.915             |                               | 235                             |                                                | (1)                  |    | (1)     | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | INR                 | 364.457               |                               | 4.243                           |                                                | 1                    |    | 1       | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | KRW                 | 2.836.207             |                               | 2.084                           |                                                | (15)                 |    | (15)    | 0,00   |           |         |
|                                  | 08.2025          | PHP                 | 5.296                 |                               | 94                              |                                                | 0                    |    | 0       | 0,00   |           |         |
|                                  |                  |                     |                       |                               |                                 | \$                                             | 6.580                | \$ | (4.218) | \$     | 2.362     | 0,09    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |    |         | \$     | 20.535    | 0,81    |
| Summe Anlagen                    |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |    |         | \$     | 2.882.816 | 113,21  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |    |         | \$     | (336.326) | (13,21) |
| Nettovermögen                    |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |    |         | \$     | 2.546.490 | 100,00  |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(i) Mit dem Fonds verbunden.

(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: null):

| Emittentenbeschreibung                                              | Kaufdatum  | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------------------------------|------------|----------|-----------|----------------------|
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,520 % fällig am 20.03.2028 | 20.02.2025 | \$ 1.000 | \$ 1.007  | 0,04                 |
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,740 % fällig am 20.03.2030 | 20.02.2025 | 1.000    | 1.011     | 0,04                 |
| Whitecap Resources, Inc.                                            | 15.05.2025 | 575      | 633       | 0,02                 |
|                                                                     |            | \$ 2.575 | \$ 2.651  | 0,10                 |

(l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 9.067 (31. Dezember 2024: USD null) und Barmittel in Höhe von USD null (31. Dezember 2024: USD 10.800) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 21.998 (31. Dezember 2024: USD 11.968) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von USD 1.210 (31. Dezember 2024: USD null) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 952.961                                                                  | \$ 1.708.779                                                    | \$ 8.506                                                     | \$ 2.670.246        |
| Investmentfonds               | 161.103                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 161.103             |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 26.500                                                          | 0                                                            | 26.500              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 1.347                                                                       | 23.620                                                          | 0                                                            | 24.967              |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 1.115.411</b>                                                         | <b>\$ 1.758.899</b>                                             | <b>\$ 8.506</b>                                              | <b>\$ 2.882.816</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 515.162                                                                  | \$ 872.726                                                      | \$ 2.589                                                     | \$ 1.390.477        |
| Investmentfonds               | 101.087                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 101.087             |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 15.200                                                          | 0                                                            | 15.200              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 106                                                                         | (13.071)                                                        | 0                                                            | (12.965)            |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 616.355</b>                                                           | <b>\$ 874.855</b>                                               | <b>\$ 2.589</b>                                              | <b>\$ 1.493.799</b> |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|--------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                       | 4,250 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (2.443)   | \$ (2.445)                                       | (0,10)                  |
|                                           | 4,280      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (94)         | (94)                                             | 0,00                    |
|                                           | 4,300      | 18.06.2025       | 01.08.2025         | (1.956)      | (1.959)                                          | (0,08)                  |
|                                           | 4,300      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (1.788)      | (1.790)                                          | (0,07)                  |
| MEI                                       | 4,290      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (369)        | (370)                                            | (0,01)                  |
| MYI                                       | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (1.357)    | (1.594)                                          | (0,06)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                    |              | <b>\$ (8.252)</b>                                | <b>(0,32)</b>           |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                           |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                           |                                     |
|------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 5.210                            | \$ (4.470)                                | \$ 740                              | \$ (531)                            | \$ 430                                    | \$ (101)                            |
| BOA        | 904                                 | (650)                                     | 254                                 | (334)                               | 280                                       | (54)                                |
| BPS        | 140                                 | (260)                                     | (120)                               | (568)                               | 330                                       | (238)                               |
| BRC        | 6.828                               | (6.280)                                   | 548                                 | (144)                               | 140                                       | (4)                                 |
| BSH        | (43)                                | 0                                         | (43)                                | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               |
| CBK        | (76)                                | 160                                       | 84                                  | 239                                 | (110)                                     | 129                                 |
| CIB        | 3                                   | (310)                                     | (307)                               | (3)                                 | 0                                         | (3)                                 |
| DUB        | 721                                 | (690)                                     | 31                                  | (3.787)                             | 3.410                                     | (377)                               |
| FAR        | 329                                 | (330)                                     | (1)                                 | 623                                 | (460)                                     | 163                                 |
| GLM        | (393)                               | (110)                                     | (503)                               | (181)                               | (70)                                      | (251)                               |
| GST        | 75                                  | (70)                                      | 5                                   | 3                                   | 0                                         | 3                                   |
| IND        | 12                                  | 0                                         | 12                                  | 124                                 | 0                                         | 124                                 |
| JPM        | 900                                 | (670)                                     | 230                                 | (454)                               | 280                                       | (174)                               |
| MBC        | 754                                 | (590)                                     | 164                                 | (2.093)                             | 1.680                                     | (413)                               |
| MEI        | 1.512                               | (1.160)                                   | 352                                 | (404)                               | 440                                       | 36                                  |
| MYC        | 53                                  | 0                                         | 53                                  | 13                                  | 0                                         | 13                                  |
| MYI        | 4.298                               | (3.800)                                   | 498                                 | (235)                               | 260                                       | 25                                  |
| RBC        | 1                                   | 0                                         | 1                                   | 16                                  | 0                                         | 16                                  |
| RYL        | (5)                                 | 0                                         | (5)                                 | 65                                  | 0                                         | 65                                  |
| SAL        | 12                                  | 0                                         | 12                                  | 1                                   | 0                                         | 1                                   |
| SCX        | 17                                  | 0                                         | 17                                  | (4.206)                             | 3.550                                     | (656)                               |
| SOG        | 51                                  | 0                                         | 51                                  | (1)                                 | 0                                         | (1)                                 |

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                           |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                           |                                     |
|------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| SSB        | \$ (880)                            | \$ 1.020                                  | \$ 140                              | \$ (17)                             | \$ 0                                      | \$ (17)                             |
| TOR        | 112                                 | 0                                         | 112                                 | (36)                                | 0                                         | (36)                                |
| UAG        | 0                                   | 30                                        | 30                                  | 51                                  | 0                                         | 51                                  |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 52,07             | 53,46             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 23,79             | 23,10             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,71              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 4,62              | 5,57              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 0,76              | 0,84              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,13              | 0,01              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,22              | 0,12              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,18              | 0,29              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 16,52             | 16,61             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,36              | 0,47              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 8,15              | 6,60              |
| Wandelanleihen & Wechsel                                                               | k. A.             | 0,07              |
| Kommunalanleihen und Wechsel                                                           | 0,18              | k. A.             |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 22,82             | 21,24             |
| US-Staatsanleihen                                                                      | 5,01              | 6,70              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 2,42              | 3,11              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 5,95              | 4,86              |
| Staatsemissionen                                                                       | 2,71              | 2,00              |
| Stammaktien                                                                            | 55,29             | 53,20             |
| Optionsscheine                                                                         | 0,00              | k. A.             |
| Vorzugswertpapiere                                                                     | 0,06              | 0,22              |
| Real Estate Investment Trusts                                                          | 0,75              | 1,04              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 1,16              | 1,25              |
| Investmentfonds                                                                        | 6,33              | 7,33              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 1,04              | 1,10              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,17              | (0,04)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,04              | 0,02              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,04)            | (0,06)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Inflation-Capped Options                                                               | (0,01)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,01              | 0,00              |
| Total Return Swaps auf Indizes                                                         | 0,28              | (0,05)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,26)            | 0,13              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,79              | (0,93)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (13,21)           | (8,25)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                   | PARI   | MARKT-  | % DES  | BESCHREIBUNG                                   | PARI   | MARKT- | % DES  | BESCHREIBUNG                                   | PARI   | MARKT-  | % DES  |
|------------------------------------------------|--------|---------|--------|------------------------------------------------|--------|--------|--------|------------------------------------------------|--------|---------|--------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                       | (000S) | WERT    | NETTO- | ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                       | (000S) | WERT   | NETTO- | ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                       | (000S) | WERT    | NETTO- |
| ÖSTERREICH                                     |        | (000S)  | VERMÖ- | ÖSTERREICH                                     |        | (000S) | GENS   | ÖSTERREICH                                     |        | (000S)  | GENS   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| Erste Group Bank AG                            |        |         |        | Erste Group Bank AG                            |        |        |        | Erste Group Bank AG                            |        |         |        |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f)            | €      | 37.600  | \$     | 43.489                                         | 0,86   |        |        | 4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f)            | €      | 37.600  | \$     |
| 7,000 % fällig am 15.04.2031 (d)(f)            |        | 14.000  |        | 17.410                                         | 0,35   |        |        | 7,000 % fällig am 15.04.2031 (d)(f)            |        | 14.000  |        |
| 8,500 % fällig am 15.10.2028 (d)(f)(g)         |        | 30.000  |        | 39.543                                         | 0,79   |        |        | 8,500 % fällig am 15.10.2028 (d)(f)(g)         |        | 30.000  |        |
| Summe Österreich                               |        |         |        | 100.442                                        | 2,00   |        |        | Summe Österreich                               |        |         |        |
| BELGIEN                                        |        |         |        | BELGIEN                                        |        |        |        | BELGIEN                                        |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| KBC Group NV                                   |        |         |        | KBC Group NV                                   |        |        |        | KBC Group NV                                   |        |         |        |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f)            |        | 14.400  |        | 16.935                                         | 0,34   |        |        | 4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f)            |        | 14.400  |        |
| 6,250 % fällig am 17.09.2031 (d)(f)            |        | 27.200  |        | 32.843                                         | 0,65   |        |        | 6,250 % fällig am 17.09.2031 (d)(f)            |        | 27.200  |        |
| 8,000 % fällig am 05.09.2028 (d)(f)            |        | 52.800  |        | 68.771                                         | 1,37   |        |        | 8,000 % fällig am 05.09.2028 (d)(f)            |        | 52.800  |        |
| Summe Belgien                                  |        |         |        | 118.549                                        | 2,36   |        |        | Summe Belgien                                  |        |         |        |
| KANADA                                         |        |         |        | KANADA                                         |        |        |        | KANADA                                         |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| Bank of Nova Scotia                            |        |         |        | Bank of Nova Scotia                            |        |        |        | Bank of Nova Scotia                            |        |         |        |
| 3,625 % fällig am 27.10.2081 (f)               | \$     | 9.400   |        | 8.818                                          | 0,17   |        |        | 3,625 % fällig am 27.10.2081 (f)               | \$     | 9.400   |        |
| 7,350 % fällig am 27.04.2085 (f)               |        | 24.000  |        | 24.237                                         | 0,48   |        |        | 7,350 % fällig am 27.04.2085 (f)               |        | 24.000  |        |
| 8,000 % fällig am 27.01.2084 (f)               |        | 21.300  |        | 22.641                                         | 0,45   |        |        | 8,000 % fällig am 27.01.2084 (f)               |        | 21.300  |        |
| Canadian Imperial Bank of Commerce             |        |         |        | Canadian Imperial Bank of Commerce             |        |        |        | Canadian Imperial Bank of Commerce             |        |         |        |
| 6,950 % fällig am 28.01.2085 (f)               |        | 12.300  |        | 12.366                                         | 0,25   |        |        | 6,950 % fällig am 28.01.2085 (f)               |        | 12.300  |        |
| Royal Bank of Canada                           |        |         |        | Royal Bank of Canada                           |        |        |        | Royal Bank of Canada                           |        |         |        |
| 4,715 % fällig am 27.03.2028                   |        | 24.500  |        | 24.658                                         | 0,49   |        |        | 4,715 % fällig am 27.03.2028                   |        | 24.500  |        |
| 6,750 % fällig am 24.08.2085 (f)               |        | 24.500  |        | 24.579                                         | 0,49   |        |        | 6,750 % fällig am 24.08.2085 (f)               |        | 24.500  |        |
| 7,500 % fällig am 02.05.2084 (f)               |        | 60.100  |        | 62.254                                         | 1,24   |        |        | 7,500 % fällig am 02.05.2084 (f)               |        | 60.100  |        |
| Scotiabank Capital Trust                       |        |         |        | Scotiabank Capital Trust                       |        |        |        | Scotiabank Capital Trust                       |        |         |        |
| 5,650 % fällig am 31.12.2056                   | CAD    | 16.616  |        | 12.966                                         | 0,26   |        |        | 5,650 % fällig am 31.12.2056                   | CAD    | 16.616  |        |
| Toronto-Dominion Bank                          |        |         |        | Toronto-Dominion Bank                          |        |        |        | Toronto-Dominion Bank                          |        |         |        |
| 7,250 % fällig am 31.07.2084 (f)(g)            | \$     | 21.600  |        | 22.221                                         | 0,44   |        |        | 7,250 % fällig am 31.07.2084 (f)(g)            | \$     | 21.600  |        |
| 8,125 % fällig am 31.10.2082 (f)               |        | 11.100  |        | 11.621                                         | 0,23   |        |        | 8,125 % fällig am 31.10.2082 (f)               |        | 11.100  |        |
| Summe Kanada                                   |        |         |        | 226.361                                        | 4,50   |        |        | Summe Kanada                                   |        |         |        |
| DÄNEMARK                                       |        |         |        | DÄNEMARK                                       |        |        |        | DÄNEMARK                                       |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| Danske Bank A/S                                |        |         |        | Danske Bank A/S                                |        |        |        | Danske Bank A/S                                |        |         |        |
| 6,259 % fällig am 22.09.2026 (g)               |        | 2.900   |        | 2.909                                          | 0,06   |        |        | 6,259 % fällig am 22.09.2026 (g)               |        | 2.900   |        |
| TDC Net A/S                                    |        |         |        | TDC Net A/S                                    |        |        |        | TDC Net A/S                                    |        |         |        |
| 5,000 % fällig am 09.08.2032                   | €      | 1.000   |        | 1.202                                          | 0,02   |        |        | 5,000 % fällig am 09.08.2032                   | €      | 1.000   |        |
| Summe Dänemark                                 |        |         |        | 4.111                                          | 0,08   |        |        | Summe Dänemark                                 |        |         |        |
| FINNLAND                                       |        |         |        | FINNLAND                                       |        |        |        | FINNLAND                                       |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| Nordea Bank Abp                                |        |         |        | Nordea Bank Abp                                |        |        |        | Nordea Bank Abp                                |        |         |        |
| 3,750 % fällig am 01.03.2029 (d)(f)            | \$     | 16.200  |        | 14.589                                         | 0,29   |        |        | 3,750 % fällig am 01.03.2029 (d)(f)            | \$     | 16.200  |        |
| 6,300 % fällig am 25.09.2031 (d)(f)(g)         |        | 10.100  |        | 9.863                                          | 0,20   |        |        | 6,300 % fällig am 25.09.2031 (d)(f)(g)         |        | 10.100  |        |
| Summe Finnland                                 |        |         |        | 24.452                                         | 0,49   |        |        | Summe Finnland                                 |        |         |        |
| FRANKREICH                                     |        |         |        | FRANKREICH                                     |        |        |        | FRANKREICH                                     |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| Altice France S.A.                             |        |         |        | Altice France S.A.                             |        |        |        | Altice France S.A.                             |        |         |        |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029                   | €      | 8.000   |        | 7.903                                          | 0,16   |        |        | 4,250 % fällig am 15.10.2029                   | €      | 8.000   |        |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029                   | \$     | 16.300  |        | 13.529                                         | 0,27   |        |        | 5,500 % fällig am 15.10.2029                   | \$     | 16.300  |        |
| Arkema S.A.                                    |        |         |        | Arkema S.A.                                    |        |        |        | Arkema S.A.                                    |        |         |        |
| 1,500 % fällig am 21.10.2025 (d)               | €      | 6.000   |        | 6.964                                          | 0,14   |        |        | 1,500 % fällig am 21.10.2025 (d)               | €      | 6.000   |        |
| AXA S.A.                                       |        |         |        | AXA S.A.                                       |        |        |        | AXA S.A.                                       |        |         |        |
| 5,500 % fällig am 11.07.2043                   |        | 4.900   |        | 6.326                                          | 0,12   |        |        | 5,500 % fällig am 11.07.2043                   |        | 4.900   |        |
| 5,750 % fällig am 02.06.2030 (d)(f)            |        | 7.800   |        | 9.398                                          | 0,19   |        |        | 5,750 % fällig am 02.06.2030 (d)(f)            |        | 7.800   |        |
| BNP Paribas S.A.                               |        |         |        | BNP Paribas S.A.                               |        |        |        | BNP Paribas S.A.                               |        |         |        |
| 4,625 % fällig am 12.01.2027 (d)(f)            | \$     | 16.200  |        | 15.775                                         | 0,31   |        |        | 4,625 % fällig am 12.01.2027 (d)(f)            | \$     | 16.200  |        |
| BRITANNISCHES KÖNIGREICH                       |        |         |        | BRITANNISCHES KÖNIGREICH                       |        |        |        | BRITANNISCHES KÖNIGREICH                       |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| BPCE S.A.                                      |        |         |        | BPCE S.A.                                      |        |        |        | BPCE S.A.                                      |        |         |        |
| 2,125 % fällig am 13.10.2046 (f)               | €      | 36.000  |        | 37.167                                         | 0,74   |        |        | 2,125 % fällig am 13.10.2046 (f)               | €      | 36.000  |        |
| 6,508 % fällig am 18.01.2035 (g)               | \$     | 4.150   |        | 4.310                                          | 0,08   |        |        | 6,508 % fällig am 18.01.2035 (g)               | \$     | 4.150   |        |
| CCF Holding S.A.S.                             |        |         |        | CCF Holding S.A.S.                             |        |        |        | CCF Holding S.A.S.                             |        |         |        |
| 5,000 % fällig am 27.05.2035                   | €      | 8.900   |        | 10.484                                         | 0,21   |        |        | 5,000 % fällig am 27.05.2035                   | €      | 8.900   |        |
| Credit Agricole S.A.                           |        |         |        | Credit Agricole S.A.                           |        |        |        | Credit Agricole S.A.                           |        |         |        |
| 5,875 % fällig am 23.03.2035 (d)(f)            |        | 51.400  |        | 59.922                                         | 1,19   |        |        | 5,875 % fällig am 23.03.2035 (d)(f)            |        | 51.400  |        |
| 7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f)            |        | 109.600 |        | 138.866                                        | 2,76   |        |        | 7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f)            |        | 109.600 |        |
| ELO SACA                                       |        |         |        | ELO SACA                                       |        |        |        | ELO SACA                                       |        |         |        |
| 3,250 % fällig am 23.07.2027                   |        | 11.900  |        | 13.492                                         | 0,27   |        |        | 3,250 % fällig am 23.07.2027                   |        | 11.900  |        |
| Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR   |        |         |        | Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR   |        |        |        | Groupe des Assurances du Credit Mutuel SADIR   |        |         |        |
| 5,000 % fällig am 30.10.2044                   |        | 8.700   |        | 10.663                                         | 0,21   |        |        | 5,000 % fällig am 30.10.2044                   |        | 8.700   |        |
| La Mondiale SAM                                |        |         |        | La Mondiale SAM                                |        |        |        | La Mondiale SAM                                |        |         |        |
| 6,750 % fällig am 17.01.2034 (d)(f)            |        | 5.900   |        | 7.328                                          | 0,14   |        |        | 6,750 % fällig am 17.01.2034 (d)(f)            |        | 5.900   |        |
| Mutuelle Assurance Travailleuse Mutualiste SAM |        |         |        | Mutuelle Assurance Travailleuse Mutualiste SAM |        |        |        | Mutuelle Assurance Travailleuse Mutualiste SAM |        |         |        |
| 4,625 % fällig am 23.02.2036                   |        | 10.900  |        | 12.877                                         | 0,26   |        |        | 4,625 % fällig am 23.02.2036                   |        | 10.900  |        |
| Societe Generale S.A.                          |        |         |        | Societe Generale S.A.                          |        |        |        | Societe Generale S.A.                          |        |         |        |
| 7,875 % fällig am 18.01.2029 (d)(f)            |        | 10.700  |        | 13.687                                         | 0,27   |        |        | 7,875 % fällig am 18.01.2029 (d)(f)            |        | 10.700  |        |
| 10,000 % fällig am 14.11.2028 (d)(f)           | \$     | 33.900  |        | 37.081                                         | 0,74   |        |        | 10,000 % fällig am 14.11.2028 (d)(f)           | \$     | 33.900  |        |
| Summe Frankreich                               |        |         |        | 500.920                                        | 9,95   |        |        | Summe Frankreich                               |        |         |        |
| STAATSEMISSIONEN                               |        |         |        | STAATSEMISSIONEN                               |        |        |        | STAATSEMISSIONEN                               |        |         |        |
| Agence France Locale                           |        |         |        | Agence France Locale                           |        |        |        | Agence France Locale                           |        |         |        |
| 7,000 % fällig am 17.06.2031 (d)(f)            | €      | 10.400  |        | 13.957                                         | 0,28   |        |        | 7,000 % fällig am 17.06.2031 (d)(f)            | €      | 10.400  |        |
| Summe Frankreich                               |        |         |        | 514.877                                        | 10,23  |        |        | Summe Frankreich                               |        |         |        |
| DEUTSCHLAND                                    |        |         |        | DEUTSCHLAND                                    |        |        |        | DEUTSCHLAND                                    |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| Commerzbank AG                                 |        |         |        | Commerzbank AG                                 |        |        |        | Commerzbank AG                                 |        |         |        |
| 6,500 % fällig am 09.10.2029 (d)(f)            |        | 51.600  |        | 63.941                                         | 1,27   |        |        | 6,500 % fällig am 09.10.2029 (d)(f)            |        | 51.600  |        |
| 6,625 % fällig am 09.10.2032 (d)(f)            |        | 6.000   |        | 7.184                                          | 0,14   |        |        | 6,625 % fällig am 09.10.2032 (d)(f)            |        | 6.000   |        |
| 7,875 % fällig am 09.10.2031 (d)(f)            |        | 26.000  |        | 33.945                                         | 0,68   |        |        | 7,875 % fällig am 09.10.2031 (d)(f)            |        | 26.000  |        |
| Deutsche Bank AG                               |        |         |        | Deutsche Bank AG                               |        |        |        | Deutsche Bank AG                               |        |         |        |
| 4,625 % fällig am 30.10.2027 (d)(f)            |        | 8.600   |        | 9.717                                          | 0,19   |        |        | 4,625 % fällig am 30.10.2027 (d)(f)            |        | 8.600   |        |
| 7,125 % fällig am 30.10.2030 (d)(f)            |        | 12.600  |        | 15.081                                         | 0,30   |        |        | 7,125 % fällig am 30.10.2030 (d)(f)            |        | 12.600  |        |
| 7,375 % fällig am 30.10.2031 (d)(f)            |        | 19.000  |        | 23.247                                         | 0,46   |        |        | 7,375 % fällig am 30.10.2031 (d)(f)            |        | 19.000  |        |
| 8,125 % fällig am 30.10.2029 (d)(f)            |        | 24.200  |        | 30.380                                         | 0,60   |        |        | 8,125 % fällig am 30.10.2029 (d)(f)            |        | 24.200  |        |
| 10,000 % fällig am 01.12.2027 (d)(f)           |        | 46.400  |        | 60.833                                         | 1,21   |        |        | 10,000 % fällig am 01.12.2027 (d)(f)           |        | 46.400  |        |
| Summe Deutschland                              |        |         |        | 244.328                                        | 4,85   |        |        | Summe Deutschland                              |        |         |        |
| IRLAND                                         |        |         |        | IRLAND                                         |        |        |        | IRLAND                                         |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| AIB Group PLC                                  |        |         |        | AIB Group PLC                                  |        |        |        | AIB Group PLC                                  |        |         |        |
| 6,000 % fällig am 14.07.2031 (d)(f)            |        | 17.600  |        | 20.568                                         | 0,41   |        |        | 6,000 % fällig am 14.07.2031 (d)(f)            |        | 17.600  |        |
| 7,125 % fällig am 30.10.2029 (d)(f)            |        | 2.700   |        | 3.357                                          | 0,06   |        |        | 7,125 % fällig am 30.10.2029 (d)(f)            |        | 2.700   |        |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC        |        |         |        | Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC        |        |        |        | Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC        |        |         |        |
| 5,950 % fällig am 15.04.2030 *(f)              | \$     | 16.800  |        | 1.008                                          | 0,02   |        |        | 5,950 % fällig am 15.04.2030 *(f)              | \$     | 16.800  |        |
| Bank of Ireland Group PLC                      |        |         |        | Bank of Ireland Group PLC                      |        |        |        | Bank of Ireland Group PLC                      |        |         |        |
| 6,375 % fällig am 10.03.2030 (d)(f)            | €      | 7.000   |        | 8.417                                          | 0,17   |        |        | 6,375 % fällig am 10.03.2030 (d)(f)            | €      | 7.000   |        |
| Summe Irland                                   |        |         |        | 33.350                                         | 0,66   |        |        | Summe Irland                                   |        |         |        |
| ITALIEN                                        |        |         |        | ITALIEN                                        |        |        |        | ITALIEN                                        |        |         |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |        |         |        |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA            |        |         |        | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA            |        |        |        | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA            |        |         |        |
| 4,375 % fällig am 02.10.2035 (a)               |        | 6.000   |        | 7.047                                          | 0,14   |        |        | 4,375 % fällig am 02.10.2035 (a)               |        | 6.000   |        |
| 7,708 % fällig am 18.01.2028                   |        | 7.208   |        | 9.281                                          | 0,18   |        |        | 7,708 % fällig am 18.01.2028                   |        | 7.208   |        |
| 8,500 % fällig am 10.09.2030                   |        | 7.350   |        | 8.726                                          | 0,17   |        |        | 8,500 % fällig am 10.09.2030                   |        | 7.350   |        |
| 10,500 % fällig am 23.07.2029                  |        | 12.250  |        | 18.015                                         | 0,36   |        |        | 10,500 % fällig am 23.07.2029                  |        | 12.250  |        |
| Eni SpA                                        |        |         |        | Eni SpA                                        |        |        |        | Eni SpA                                        |        |         |        |
| 4,875 % fällig am 21.01.2034 (d)               |        | 10.000  |        | 11.813                                         | 0,23   |        |        | 4,875 % fällig am 21.01.2034 (d)               |        | 10.000  |        |
| Intesa Sanpaolo SpA                            |        |         |        | Intesa Sanpaolo SpA                            |        |        |        | Intesa Sanpaolo SpA                            |        |         |        |
| 4,198 % fällig am 01.06.2032                   | \$     | 3.930   |        | 3.617                                          | 0,07   |        |        | 4,198 % fällig am 01.06.2032                   | \$     | 3.930   |        |
| 4,950 % fällig am 01.06.2042                   |        | 5.700   |        | 4.613                                          | 0,09   |        |        | 4,950 % fällig am 01.06.2042                   |        | 5.700   |        |
| 5,500 % fällig am 01.03.2028 (d)(f)            | €      | 7.700   |        | 9.247                                          | 0,18   |        |        | 5,500 % fällig am 01.03.2028 (d)(f)            | €      | 7.700   |        |
| 5,875 % fällig am 01.09.2031 (d)(f)            |        | 13.550  |        | 16.463                                         | 0,33   |        |        | 5,875 % fällig am 01.09.2031 (d)(f)            |        | 13.550  |        |
| 7,000 % fällig am 20.05.2032 (d)(f)            |        | 225     |        | 283                                            | 0,01   |        |        | 7,000 % fällig am 20.05.2032 (d)(f)            |        | 225     |        |
|                                                |        |         |        |                                                |        |        |        |                                                |        |         |        |



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

|  |  |  |  |  |  |  |  | </ |  |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|--|--|----|--|--|--|--|--|--|--|

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                     | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte, zum<br>Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|------------|------------------|------------------|---------------|-----------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| DEU                     | 4,470 %    | 30.06.2025       | 01.07.2025       | \$ 39.100     | U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig<br>am 15.05.2040 | \$ (40.294)                | \$ 39.100                           | \$ 39.105                                                           | 0,78                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |               |                                                     | \$ (40.294)                | \$ 39.100                           | \$ 39.105                                                           | 0,78                    |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

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

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Canada Government 10-Year Bond September Futures               | Long  | 09.2025     | 211                     | \$ 163                                          | 0,00                    |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Short | 09.2025     | 127                     | 65                                              | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09.2025     | 330                     | 343                                             | 0,01                    |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Short | 09.2025     | 461                     | 887                                             | 0,02                    |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 6                       | (1)                                             | 0,00                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 2.255                   | 1.735                                           | 0,03                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 1.257                   | 1.544                                           | 0,03                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 7.374                   | 13.977                                          | 0,28                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025     | 661                     | (1.331)                                         | (0,03)                  |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures                 | Short | 09.2025     | 11                      | (54)                                            | 0,00                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 350                     | 1.460                                           | 0,03                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025     | 206                     | 559                                             | 0,01                    |
|                                                                |       |             |                         | \$ 19.347                                       | 0,38                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                         | \$ 19.347                                       | 0,38                    |

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

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

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

| Referenzeinheit  | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Deutsche Bank AG | 1,000 %                        | 20.12.2031       | € 61.400                  | \$ 843                                          | 0,02                    |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen                       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|--------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index     | 5,000 %                        | 20.06.2030       | € 4.800                   | \$ 80                                           | 0,00                    |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index   | 1,000                          | 20.06.2030       | 64.900                    | 800                                             | 0,01                    |
| iTraxx Europe Senior 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 100.000                   | 1.379                                           | 0,03                    |
|                                      |                                |                  |                           | \$ 2.259                                        | 0,04                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex         | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 0,750 %         | 15.09.2051       | £ 3.800    | \$ 1.998                                        | 0,04                    |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500           | 19.03.2030       | 33.600     | (278)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500           | 19.03.2035       | 56.600     | (371)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2027       | 67.500     | (154)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2055       | 31.100     | 987                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 19.03.2035       | \$ 137.800 | (4.346)                                         | (0,08)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 18.12.2029       | 102.400    | 2.456                                           | 0,05                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 20.06.2034       | 17.300     | (400)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,250           | 20.12.2025       | 59.300     | (176)                                           | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2035       | € 55.070   | 12                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2055       | 21.900     | 1.057                                           | 0,02                    |
|                                                |                                |                 |                  |            | \$ 785                                          | 0,02                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                |                 |                  |            | \$ 3.887                                        | 0,08                    |

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



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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

#### DEVISETERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |          |        |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|----------|--------|
| AZD        | 07.2025          | £                      | 4.717                    | \$                               | 6.473                              | \$                                                   | 9                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 657                      | AUD                              | 1.012                              |                                                      | 6                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 314.869                  | €                                | 268.926                            |                                                      | 810                     | 0,02   |          |        |
|            | 08.2025          | AUD                    | 1.012                    | \$                               | 658                                |                                                      | (6)                     | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | €                      | 268.609                  |                                  | 315.198                            |                                                      | (796)                   | (0,02) |          |        |
| BOA        | 08.2025          | \$                     | 6.474                    | £                                | 4.717                              |                                                      | (9)                     | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 19                       | SGD                              | 25                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 25                       | \$                               | 19                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
| BPS        | 07.2025          | €                      | 11.645                   |                                  | 13.214                             |                                                      | (455)                   | (0,01) |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.091                    | €                                | 1.803                              |                                                      | 25                      | 0,00   |          |        |
| BRC        | 07.2025          | €                      | 1.483.365                | \$                               | 1.684.759                          |                                                      | (56.488)                | (1,12) |          |        |
|            | 07.2025          | £                      | 34.390                   |                                  | 46.472                             |                                                      | (654)                   | (0,01) |          |        |
| CBK        | 07.2025          | \$                     | 90.864                   | £                                | 67.605                             |                                                      | 1.778                   | 0,03   |          |        |
|            | 07.2025          | €                      | 639                      | \$                               | 738                                |                                                      | (12)                    | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | £                      | 54.411                   |                                  | 73.878                             |                                                      | (684)                   | (0,01) |          |        |
|            | 07.2025          | SEK                    | 4.495                    |                                  | 473                                |                                                      | 2                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 10                       |                                  | 8                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
| DUB        | 07.2025          | \$                     | 137                      | CNY                              | 980                                |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 26.517                   | €                                | 23.202                             |                                                      | 719                     | 0,01   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 4.941                    | SGD                              | 6.342                              |                                                      | 38                      | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 13                       | \$                               | 10                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | AUD                    | 1.012                    |                                  | 653                                |                                                      | (10)                    | 0,00   |          |        |
| FAR        | 07.2025          | CHF                    | 51                       |                                  | 63                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 6.486                    |                                  | 5.036                              |                                                      | (56)                    | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 61                       | CHF                              | 51                                 |                                                      | 2                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 15                       | SGD                              | 20                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 20                       | \$                               | 15                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
| GLM        | 08.2025          | \$                     | 63                       | CHF                              | 50                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 6                        | SGD                              | 8                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 8                        | \$                               | 6                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 476                      | SEK                              | 4.501                              |                                                      | (3)                     | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | SEK                    | 4.491                    | \$                               | 476                                |                                                      | 4                       | 0,00   |          |        |
| JPM        | 07.2025          | £                      | 364.570                  |                                  | 491.142                            |                                                      | (8.447)                 | (0,17) |          |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 108                      |                                  | 84                                 |                                                      | (1)                     | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 13                       | SGD                              | 16                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 16                       | \$                               | 13                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | CAD                    | 18.811                   |                                  | 13.696                             |                                                      | (90)                    | 0,00   |          |        |
| MBC        | 07.2025          | €                      | 2.919                    |                                  | 3.383                              |                                                      | (44)                    | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | £                      | 6.975                    |                                  | 9.451                              |                                                      | (107)                   | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 313                      |                                  | 244                                |                                                      | (2)                     | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 13.690                   | CAD                              | 18.818                             |                                                      | 101                     | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 33.114                   | €                                | 28.328                             |                                                      | 138                     | 0,00   |          |        |
| MYI        | 07.2025          |                        | 40.624                   | £                                | 29.959                             |                                                      | 430                     | 0,01   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 333                      | SGD                              | 431                                |                                                      | 5                       | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | CAD                    | 18.787                   | \$                               | 13.690                             |                                                      | (102)                   | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 430                      |                                  | 333                                |                                                      | (5)                     | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | €                      | 901                      |                                  | 1.046                              |                                                      | (11)                    | 0,00   |          |        |
| SCX        | 07.2025          | £                      | 100                      |                                  | 137                                |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | SGD                    | 1.123                    |                                  | 880                                |                                                      | (2)                     | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 251                      | €                                | 214                                |                                                      | 1                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 225                      | £                                | 164                                |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 2.856                    | SGD                              | 3.638                              |                                                      | 1                       | 0,00   |          |        |
| SSB        | 07.2025          | CNY                    | 983                      | \$                               | 137                                |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 66                       | SGD                              | 86                                 |                                                      | 1                       | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 86                       | \$                               | 66                                 |                                                      | (1)                     | 0,00   |          |        |
|            | 08.2025          | \$                     | 137                      | CNY                              | 980                                |                                                      | 0                       | 0,00   |          |        |
|            | 07.2025          | £                      | 190.824                  | \$                               | 258.379                            |                                                      | (3.116)                 | (0,06) |          |        |
| UAG        | 07.2025          | \$                     | 766.066                  | £                                | 558.684                            |                                                      | (474)                   | (0,01) |          |        |
|            | 08.2025          | £                      | 558.684                  | \$                               | 766.165                            |                                                      | 461                     | 0,01   |          |        |
|            | 07.2025          |                        | 361                      |                                  | 489                                |                                                      | (6)                     | 0,00   |          |        |
| WST        | 07.2025          | €                      | 263.598                  |                                  | 297.792                            |                                                      | (11.633)                | (0,23) |          |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.689.564                | €                                | 1.440.808                          |                                                      | 1.729                   | 0,03   |          |        |
|            | 08.2025          | €                      | 1.440.808                | \$                               | 1.693.253                          |                                                      | (1.730)                 | (0,03) |          |        |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 6.280                              | \$                                                   | (84.964)                | \$     | (78.684) | (1,56) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Institutional AUD (Hedged) ausschüttend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD 12.691             | \$ 8.244                 | \$ 0                                | \$ (73)                            | \$ (73)                                              | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 8.249               | AUD 12.691               | 73                                  | 0                                  | 73                                                   | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | AUD 21                 | \$ 14                    | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 111                 | AUD 172                  | 1                                   | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | 18                     | 27                       | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | AUD 3                  | \$ 2                     | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 8.196               | AUD 12.717               | 139                                 | 0                                  | 139                                                  | 0,01                    |
| CBK        | 07.2025          | AUD 525                | \$ 341                   | 0                                   | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | \$ 7.715               | AUD 11.981               | 137                                 | 0                                  | 137                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | AUD 12.616             | \$ 8.248                 | 0                                   | (20)                               | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 8.209               | AUD 12.724               | 129                                 | 0                                  | 129                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 08.2025          | 8.253                  | 12.616                   | 20                                  | 0                                  | 20                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD 11.497             | \$ 7.535                 | 1                                   | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 08.2025          | \$ 7.540               | AUD 11.497               | 0                                   | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD 391                | \$ 251                   | 0                                   | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 276                 | AUD 423                  | 1                                   | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 501                              | \$ (101)                           | \$ 400                                               | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 07.2025          | BRL 1.655              | \$ 298                   | \$ 0                                | \$ (6)                             | \$ (6)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 5.880               | BRL 33.540               | 265                                 | 0                                  | 265                                                  | 0,01                    |
| BRC        | 07.2025          | 29                     | 163                      | 1                                   | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | BRL 35.139             | \$ 6.376                 | 0                                   | (62)                               | (62)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 6.300               | BRL 36.001               | 296                                 | 0                                  | 296                                                  | 0,01                    |
| FAR        | 08.2025          | 6.376                  | 35.404                   | 61                                  | 0                                  | 61                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL 35.315             | \$ 6.408                 | 0                                   | (62)                               | (62)                                                 | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | \$ 6.150               | BRL 35.161               | 292                                 | 0                                  | 292                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          | 6.408                  | 35.581                   | 61                                  | 0                                  | 61                                                   | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | BRL 36.795             | \$ 6.669                 | 0                                   | (72)                               | (72)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 616                 | BRL 3.456                | 17                                  | 0                                  | 17                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 6.499                  | 36.069                   | 59                                  | 0                                  | 59                                                   | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | BRL 763                | \$ 138                   | 0                                   | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 241                 | BRL 1.345                | 6                                   | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 1.058                            | \$ (203)                           | \$ 855                                               | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD 571                | \$ 418                   | \$ 0                                | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 418                 | CAD 570                  | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | 665                    | 915                      | 6                                   | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | CAD 11                 | \$ 8                     | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 730                 | CAD 1.009                | 10                                  | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | 16                     | 22                       | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CAD 1.017              | \$ 740                   | 0                                   | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 729                 | CAD 1.001                | 5                                   | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 740                    | 1.015                    | 5                                   | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | CAD 8                  | \$ 6                     | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | \$ 27                  | CAD 38                   | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | CAD 1.016              | \$ 745                   | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 745                 | CAD 1.015                | 0                                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 26                               | \$ (6)                             | \$ 20                                                | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF 12.718             | \$ 15.923                | \$ 0                                | \$ (54)                            | \$ (54)                                              | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 15.923              | CHF 12.665               | 54                                  | 0                                  | 54                                                   | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | 2.876                  | 2.356                    | 84                                  | 0                                  | 84                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | 38                     | 31                       | 1                                   | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | 501                    | 408                      | 11                                  | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | CHF 12.673             | \$ 15.830                | 0                                   | (91)                               | (91)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 14.699              | CHF 12.105               | 507                                 | 0                                  | 507                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          | 15.830                 | 12.621                   | 91                                  | 0                                  | 91                                                   | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CHF 31                 | \$ 38                    | 0                                   | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 14.804              | CHF 12.165               | 479                                 | 0                                  | 479                                                  | 0,01                    |

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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| MYI        | 07.2025          | CHF 1.257           | \$ 1.539              | \$ 0                          | \$ (39)                         | \$ (39)                                       | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 74               | CHF 60                | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          | 13.577              | 11.135                | 412                           | 0                               | 412                                           | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 1.641                      | \$ (185)                        | \$ 1.456                                      | 0,03                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 513.959           | \$ 601.784            | \$ 0                          | \$ (1.526)                      | \$ (1.526)                                    | (0,03)               |
|            | 08.2025          | \$ 603.103          | € 513.959             | 1.524                         | 0                               | 1.524                                         | 0,03                 |
| BOA        | 07.2025          | 638.160             | 561.242               | 20.654                        | 0                               | 20.654                                        | 0,41                 |
| BPS        | 07.2025          | € 2.812             | \$ 3.197              | 0                             | (104)                           | (104)                                         | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 616                 | 708                   | 0                             | (15)                            | (15)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 657.414          | € 578.754             | 21.956                        | 0                               | 21.956                                        | 0,44                 |
| CBK        | 07.2025          | € 2.455             | \$ 2.822              | 0                             | (60)                            | (60)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 442              | € 385                 | 10                            | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 561.814           | \$ 651.760            | 0                             | (7.725)                         | (7.725)                                       | (0,15)               |
|            | 08.2025          | \$ 651.760          | € 560.583             | 7.715                         | 0                               | 7.715                                         | 0,15                 |
| MBC        | 07.2025          | € 17.826            | \$ 20.562             | 0                             | (363)                           | (363)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 265              | € 229                 | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | € 557.125           | \$ 653.312            | 0                             | (668)                           | (668)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 582.955          | € 516.017             | 22.771                        | 0                               | 22.771                                        | 0,45                 |
|            | 08.2025          | 654.739             | 557.125               | 669                           | 0                               | 669                                           | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 75.302                     | \$ (10.461)                     | \$ 64.841                                     | 1,29                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, M Retail GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 31.021            | \$ 42.568             | \$ 57                         | \$ 0                            | \$ 57                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 42.574           | £ 31.021              | 0                             | (57)                            | (57)                                          | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | £ 41                | \$ 55                 | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 33.435              | 45.489                | 0                             | (328)                           | (328)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 42.293           | £ 31.325              | 633                           | 0                               | 633                                           | 0,01                 |
|            | 08.2025          | 45.142              | 33.173                | 324                           | 0                               | 324                                           | 0,01                 |
| CBK        | 07.2025          | £ 248               | \$ 337                | 0                             | (3)                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 9                | £ 6                   | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | 44.043              | 32.693                | 757                           | 0                               | 757                                           | 0,02                 |
| MBC        | 07.2025          | £ 2                 | \$ 2                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 1.455            | £ 1.066               | 8                             | (2)                             | 6                                             | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £ 32.880            | \$ 45.084             | 28                            | 0                               | 28                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 44.032           | £ 32.520              | 531                           | 0                               | 531                                           | 0,01                 |
|            | 08.2025          | 45.090              | 32.880                | 0                             | (27)                            | (27)                                          | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | 23                  | 17                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 2.338                      | \$ (418)                        | \$ 1.920                                      | 0,04                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD 48.314          | \$ 37.731             | \$ 0                          | \$ (203)                        | \$ (203)                                      | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 37.731           | SGD 48.202            | 209                           | 0                               | 209                                           | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 513                 | 660                   | 5                             | 0                               | 5                                             | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | 6.669               | 8.545                 | 40                            | 0                               | 40                                            | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | 43.253              | 55.720                | 495                           | 0                               | 495                                           | 0,01                 |
| FAR        | 07.2025          | SGD 108.563         | \$ 85.120             | 0                             | (117)                           | (117)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 87.132           | SGD 112.101           | 884                           | 0                               | 884                                           | 0,02                 |
|            | 08.2025          | 85.120              | 108.304               | 127                           | 0                               | 127                                           | 0,00                 |
| GLM        | 07.2025          | SGD 48.539          | \$ 38.079             | 0                             | (31)                            | (31)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 38.079           | SGD 48.422            | 35                            | 0                               | 35                                            | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | SGD 49.050          | \$ 38.308             | 0                             | (203)                           | (203)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 94.372           | SGD 121.222           | 805                           | 0                               | 805                                           | 0,02                 |
|            | 08.2025          | 38.308              | 48.937                | 210                           | 0                               | 210                                           | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | SGD 120.269         | \$ 93.003             | 0                             | (1.426)                         | (1.426)                                       | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$ 79.610           | SGD 102.159           | 600                           | 0                               | 600                                           | 0,01                 |
|            | 08.2025          | 92.816              | 119.755               | 1.443                         | 0                               | 1.443                                         | 0,03                 |
| MYI        | 07.2025          | 9.666               | 12.400                | 70                            | 0                               | 70                                            | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | SGD 20.416          | \$ 15.829             | 0                             | (201)                           | (201)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 15.829           | SGD 20.370            | 204                           | 0                               | 204                                           | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | SGD 892             | \$ 699                | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | \$ 1.231            | SGD 1.581             | 10                            | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 5.137                      | \$ (2.182)                      | \$ 2.955                                      | 0,06                 |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (6.237) (0,12)

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKTWERT<br>(000S) | % DES<br>NETTOVERMÖGENS |
|--------------------------------------------|----------------|---------------------|-------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                     |                         |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 254.548     | \$ 30.546           | 0,61                    |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | \$ 30.546           | 0,61                    |
| Summe Anlagen                              |                | \$ 5.219.118        | 103,68                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |                | \$ (185.136)        | (3,68)                  |
| Nettovermögen                              |                | \$ 5.033.982        | 100,00                  |

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

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 281.011 (31. Dezember 2024: USD 217.455) und Barmittel in Höhe von USD null (31. Dezember 2024: USD 802) als Sicherheiten verpfändet.
- (i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 32.744 (31. Dezember 2024: EUR 21.783) und Barmittel in Höhe von EUR 7.190 (31. Dezember 2024: EUR 2.340) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.963 (31. Dezember 2024: USD null) und Barmittel in Höhe von USD 688 (31. Dezember 2024: USD 211) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 112.845 (31. Dezember 2024: USD 100.762) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 5.131.414                                                    | \$ 1.008                                                     | \$ 5.132.422 |
| Investmentfonds                     | 53                                                                          | 0                                                               | 0                                                            | 53           |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 39.100                                                          | 0                                                            | 39.100       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 2.016                                                                       | 14.981                                                          | 0                                                            | 16.997       |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 30.546                                                          | 0                                                            | 30.546       |
| Summen                              | \$ 2.069                                                                    | \$ 5.216.041                                                    | \$ 1.008                                                     | \$ 5.219.118 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 4.807.542                                                    | \$ 1.008                                                     | \$ 4.808.550 |
| Investmentfonds                     | 52                                                                          | 0                                                               | 0                                                            | 52           |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 1.762                                                                       | 6.573                                                           | 0                                                            | 8.335        |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 31.818                                                          | 0                                                            | 31.818       |
| Summen                              | \$ 1.814                                                                    | \$ 4.845.933                                                    | \$ 1.008                                                     | \$ 4.848.755 |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS        | 4,000 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025       | \$ (3.799)   | \$ (3.802)                                     | (0,08)                  |
|            | 4,800      | 18.06.2025       | 16.10.2025       | (37.399)     | (37.463)                                       | (0,74)                  |
| BPS        | 4,720      | 07.04.2025       | 07.07.2025       | (6.342)      | (6.412)                                        | (0,13)                  |
|            | 4,870      | 07.04.2025       | 07.07.2025       | (40.528)     | (40.994)                                       | (0,81)                  |

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

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften |        | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------|--------|----------------------|
| BRC                                | 1,500 %    | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (11.303)   | \$ (13.279)                              | (0,26) |                      |
|                                    | 1,650      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (4.710)      | (5.534)                                  | (0,11) |                      |
|                                    | 1,650      | 24.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (8.015)      | (9.411)                                  | (0,19) |                      |
|                                    | 3,000      | 24.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (3.683)   | (3.704)                                  | (0,07) |                      |
|                                    | 3,950      | 08.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (10.387)     | (10.448)                                 | (0,21) |                      |
| BYR                                | 4,100      | 11.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (19.713)     | (19.895)                                 | (0,39) |                      |
|                                    | 4,750      | 03.06.2025       | 03.12.2025         | (58.887)     | (59.101)                                 | (1,17) |                      |
|                                    | 4,570      | 10.04.2025       | 10.07.2025         | (32.038)     | (32.372)                                 | (0,64) |                      |
| JML                                | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (8.138)    | (9.561)                                  | (0,19) |                      |
|                                    | 2,000      | 12.03.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1.632)   | (1.642)                                  | (0,03) |                      |
|                                    | 3,600      | 16.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.276)      | (1.282)                                  | (0,03) |                      |
| MYI                                | 3,750      | 09.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | £ (926)      | (1.276)                                  | (0,03) |                      |
|                                    | 3,950      | 16.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1.436)   | (1.443)                                  | (0,03) |                      |
|                                    | 3,500      | 11.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (2.828)      | (2.851)                                  | (0,06) |                      |
| SCX                                | 3,500      | 16.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.498)      | (1.510)                                  | (0,03) |                      |
|                                    | 3,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.342)      | (1.345)                                  | (0,03) |                      |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (263.325)                             | (5,23) |                      |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 12                            | \$ 0                               | \$ 12                           | \$ (628)                         | \$ 514                             | \$ (114)                        |
| BOA        | 20.744                           | (19.780)                           | 964                             | (317)                            | 0                                  | (317)                           |
| BPS        | (269)                            | 70                                 | (199)                           | (1.051)                          | 830                                | (221)                           |
| BRC        | (32.648)                         | 30.007                             | (2.641)                         | 7.161                            | (4.900)                            | 02.261                          |
| CBK        | 364                              | (80)                               | 284                             | (333)                            | 276                                | (57)                            |
| DUB        | 622                              | (570)                              | 52                              | 22.050                           | (19.560)                           | 2.490                           |
| FAR        | 1.757                            | (1.390)                            | 367                             | (426)                            | 370                                | (56)                            |
| GLM        | 8                                | 0                                  | 8                               | (383)                            | 281                                | (102)                           |
| IND        | 1                                | 0                                  | 1                               | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| JPM        | (6.874)                          | 7.120                              | 246                             | (921)                            | 850                                | (71)                            |
| MBC        | 1.065                            | (1.041)                            | 24                              | (12.522)                         | 10.039                             | (2.483)                         |
| MYI        | 22                               | 0                                  | 22                              | (10)                             | 0                                  | (10)                            |
| RBC        | 412                              | (270)                              | 142                             | 1                                | 0                                  | 1                               |
| SCX        | 3                                | 0                                  | 3                               | (12.272)                         | 10.673                             | (1.599)                         |
| SSB        | (2.598)                          | 2.737                              | 139                             | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| TOR        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (445)                            | 290                                | (155)                           |
| UAG        | 4                                | 0                                  | 4                               | 91                               | 0                                  | 91                              |
| WST        | 11.138                           | (10.620)                           | 518                             | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |

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

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 81,95             | 85,20             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 10,44             | 8,98              |
| Investmentfonds                                                        | 0,00              | 0,00              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 0,70              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,37              | 0,21              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,17              | 0,30              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,66              | 0,88              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,55              | 0,61              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 4,16              | 3,82              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------|-------------------|-------------------|
| Österreich            | 2,00              | 1,85              |
| Belgien               | 2,36              | 2,54              |
| Kanada                | 4,50              | 3,27              |
| Dänemark              | 0,08              | 0,06              |
| Finnland              | 0,49              | 0,79              |
| Frankreich            | 10,23             | 10,43             |
| Deutschland           | 4,85              | 3,54              |
| Irland                | 0,66              | 2,92              |
| Italien               | 6,93              | 6,76              |
| Japan                 | 3,30              | 1,38              |
| Mexiko                | 0,45              | 0,27              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Niederlande                                                                            | 11,19             | 10,55             |
| Norwegen                                                                               | 0,59              | 0,62              |
| Polen                                                                                  | 0,23              | k. A.             |
| Portugal                                                                               | 0,31              | 0,36              |
| Slowenien                                                                              | 0,64              | 0,60              |
| Spanien                                                                                | 8,05              | 9,42              |
| Schweden                                                                               | 1,09              | 0,77              |
| Schweiz                                                                                | 4,79              | 4,35              |
| Großbritannien                                                                         | 18,27             | 19,45             |
| USA                                                                                    | 7,89              | 7,28              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 13,05             | 13,95             |
| Investmentfonds                                                                        | 0,00              | 0,00              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 0,78              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,38              | (0,07)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,02              | 0,01              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,04              | (0,03)            |
| Zinsswaps                                                                              | 0,02              | 0,27              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (1,56)            | 0,91              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,44              | (0,91)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,61              | 0,67              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (3,68)            | (2,01)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund

|  |  |  |  | MARKT- |  | % DES  |  |  |  |  |  | MARKT- |  | % DES  |  |
|--|--|--|--|--------|--|--------|--|--|--|--|--|--------|--|--------|--|
|  |  |  |  | WERT   |  | NETTO- |  |  |  |  |  | WERT   |  | NETTO- |  |
|  |  |  |  | (000S) |  | VERMÖ- |  |  |  |  |  | (000S) |  | GENS   |  |
|  |  |  |  | GENS   |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |
|  |  |  |  |        |  |        |  |  |  |  |  |        |  |        |  |



|                                              |          | % DES  |        |                                                      |          | % DES    |        |                                        |          | % DES  |        |
|----------------------------------------------|----------|--------|--------|------------------------------------------------------|----------|----------|--------|----------------------------------------|----------|--------|--------|
| BESCHREIBUNG                                 | PARI     | MARKT- | NETTO- | BESCHREIBUNG                                         | PARI     | MARKT-   | NETTO- | BESCHREIBUNG                           | PARI     | MARKT- | NETTO- |
|                                              | (000S)   | WERT-  | VERMÖ- |                                                      | (000S)   | WERT     | VERMÖ- |                                        | (000S)   | WERT   | VERMÖ- |
|                                              |          | (000S) | GENS   |                                                      |          | (000S)   | GENS   |                                        |          | (000S) | GENS   |
| INDIEN                                       |          |        |        | LUXEMBURG                                            |          |          |        | NE Property BV                         |          |        |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |          |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |          |          |        | 2,000 % fällig am 20.01.2030           |          |        |        |
| ReNew Wind Energy AP2                        |          |        |        | Acef Holding S.C.A.                                  |          |          |        | € 1.400                                | \$ 1.551 |        | 0,44   |
| 4,500 % fällig am 14.07.2028                 | \$ 1.000 | \$ 950 | 0,27   | 0,750 % fällig am 14.06.2028                         | € 1.600  | \$ 1.769 | 0,51   |                                        |          |        |        |
| SAEL Ltd.                                    |          |        |        | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV- |          |          |        | 800                                    | 934      |        | 0,27   |
| 7,800 % fällig am 31.07.2031                 | 583      | 568    | 0,16   | SIF-Pan European Core Fund                           |          |          |        | 800                                    | 960      |        | 0,28   |
| Summe Indien                                 |          | 1.518  | 0,43   | 0,500 % fällig am 27.01.2028                         | 1.200    | 1.323    | 0,38   |                                        |          |        |        |
| IRLAND                                       |          |        |        | 0,900 % fällig am 12.10.2029                         | 1.000    | 1.071    | 0,31   |                                        |          |        |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |          |        |        | Nestle Finance International Ltd.                    |          |          |        | 700                                    | 887      |        | 0,25   |
| AIB Group PLC                                |          |        |        | 3,000 % fällig am 23.01.2031                         | 1.800    | 2.145    | 0,61   |                                        |          |        |        |
| 2,875 % fällig am 30.05.2031                 | € 600    | 703    | 0,20   | Prologis International Funding S.A.                  |          |          |        | 1.400                                  | 1.685    |        | 0,48   |
| 7,125 % fällig am 30.10.2029                 |          |        |        | 0,750 % fällig am 23.03.2033                         | 475      | 451      | 0,13   |                                        |          |        |        |
| (b)(c)                                       | 500      | 622    | 0,18   | 1,625 % fällig am 17.06.2032                         | 1.425    | 1.479    | 0,42   |                                        |          |        |        |
| Bank of Ireland Group PLC                    |          |        |        | 3,625 % fällig am 07.03.2030                         | 200      | 240      | 0,07   |                                        |          |        |        |
| 5,000 % fällig am 04.07.2031                 | 400      | 508    | 0,14   | Segro Capital SARL                                   |          |          |        |                                        |          |        |        |
| 6,375 % fällig am 10.03.2030                 | 200      | 240    | 0,07   | 0,500 % fällig am 22.09.2031                         | 1.000    | 984      | 0,28   |                                        |          |        |        |
| (b)(c)                                       |          |        |        | Stoneweg Ereit Lux Finco SARL                        |          |          |        | 1.900                                  | 2.160    |        | 0,62   |
| 7,594 % fällig am 06.12.2032                 | £ 600    | 863    | 0,25   | 4,250 % fällig am 30.01.2031                         | 300      | 356      | 0,10   |                                        | 31.745   |        | 9,09   |
| Kerry Group Financial Services Unlimited Co. |          |        |        | Summe Luxemburg                                      |          | 9.818    | 2,81   | STAATSEMISSIONEN                       |          |        |        |
| 3,375 % fällig am 05.03.2033                 | € 2.100  | 2.456  | 0,70   | MAURITIUS                                            |          |          |        | Niederlande Waterschapsbank NV         |          |        |        |
| Sumfit Kappa Treasury ULC                    |          |        |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |          |          |        | 3,000 % fällig am 20.04.2033           | 900      | 1.066  | 0,30   |
| 0,500 % fällig am 22.09.2029                 | 1.000    | 1.070  | 0,31   | Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.            |          |          |        | Summe Niederlande                      |          | 32.811 | 9,39   |
| 5,438 % fällig am 03.04.2034                 | \$ 1.400 | 1.420  | 0,41   | 4,250 % fällig am 25.03.2027                         | \$ 564   | 547      | 0,16   | NORWEGEN                               |          |        |        |
| Trane Technologies Financing Ltd.            |          |        |        | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.                 |          |          |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL       |          |        |        |
| 5,100 % fällig am 13.06.2034                 | 1.100    | 1.117  | 0,32   | 7,250 % fällig am 27.09.2028                         | 400      | 404      | 0,11   | DNB Bank ASA                           |          |        |        |
| Summe Irland                                 |          | 8.999  | 2,58   | India Green Power Holdings                           |          |          |        | 3,000 % fällig am 15.01.2031           | 400      | 474    | 0,14   |
| ITALIEN                                      |          |        |        | 4,000 % fällig am 22.02.2027                         | 347      | 337      | 0,10   | 3,125 % fällig am 20.05.2031           | 800      | 939    | 0,27   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |          |        |        | Summe Mauritius                                      |          | 1.288    | 0,37   | 4,625 % fällig am 01.11.2029           | 400      | 496    | 0,14   |
| Intesa Sanpaolo SpA                          |          |        |        | NIEDERLANDE                                          |          |          |        | Norsk Hydro ASA                        |          |        |        |
| 3,625 % fällig am 16.10.2030                 | € 700    | 846    | 0,24   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |          |          |        | 3,625 % fällig am 23.01.2032           | 600      | 708    | 0,20   |
| STAATSEMISSIONEN                             |          |        |        | ABN AMRO Bank NV                                     |          |          |        | 3,750 % fällig am 17.06.2033           | 300      | 351    | 0,10   |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA                |          |        |        | 2,750 % fällig am 04.06.2029                         | € 1.400  | 1.649    | 0,47   | Statnett SF                            |          |        |        |
| 3,250 % fällig am 17.06.2033                 | 800      | 931    | 0,27   | 3,000 % fällig am 25.02.2031                         | 300      | 354      | 0,10   | 3,500 % fällig am 10.06.2037           | 1.100    | 1.279  | 0,37   |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro            |          |        |        | Alliander NV                                         |          |          |        |                                        | 4.247    |        | 1,22   |
| 1,500 % fällig am 30.04.2045                 | 1.050    | 821    | 0,23   | 3,500 % fällig am 06.05.2037                         | 1.200    | 1.404    | 0,40   | STAATSEMISSIONEN                       |          |        |        |
| 4,000 % fällig am 30.10.2031                 | 400      | 501    | 0,14   | 4,500 % fällig am 27.03.2032                         |          |          |        | Kommunalbanken A/S                     |          |        |        |
| 4,050 % fällig am 30.10.2037                 | 500      | 613    | 0,18   | (b)                                                  | 200      | 241      | 0,07   | 2,625 % fällig am 05.11.2031           | 600      | 700    | 0,20   |
| 4,100 % fällig am 30.04.2046                 | 800      | 951    | 0,27   | Amvest RCF Custodian BV                              |          |          |        | 2,875 % fällig am 25.04.2029           | 1.300    | 1.551  | 0,44   |
|                                              |          | 3.817  | 1,09   | 3,750 % fällig am 11.06.2031                         | 300      | 351      | 0,10   |                                        |          | 2.251  | 0,64   |
| Summe Italien                                |          | 4.663  | 1,33   | Arcadis NV                                           |          |          |        | Summe Norwegen                         |          | 6.498  | 1,86   |
| JAPAN                                        |          |        |        | 4,875 % fällig am 28.02.2028                         | 400      | 491      | 0,14   | SLOWENIEN                              |          |        |        |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |          |        |        | ASR Nederland NV                                     |          |          |        | STAATSEMISSIONEN                       |          |        |        |
| East Japan Railway Co.                       |          |        |        | 3,625 % fällig am 12.12.2028                         | 400      | 481      | 0,14   | Slovenia Government International Bond |          |        |        |
| 3,533 % fällig am 04.09.2036                 | 850      | 994    | 0,29   | Ayvens Bank NV                                       |          |          |        | 3,125 % fällig am 02.07.2035           |          |        |        |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.         |          |        |        | 0,250 % fällig am 07.09.2026                         | 1.400    | 1.602    | 0,46   | (a)                                    | 800      | 939    | 0,27   |
| 3,556 % fällig am 05.09.2032                 | 2.000    | 2.384  | 0,68   | Cooperatieve Rabobank UA                             | £ 1.600  | 2.210    | 0,63   | SÜDKOREA                               |          |        |        |
| Mizuho Financial Group, Inc.                 |          |        |        | 4,875 % fällig am 01.11.2030                         |          |          |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL       |          |        |        |
| 3,460 % fällig am 27.08.2030                 | 2.100    | 2.514  | 0,72   | CTP NV                                               |          |          |        | LG Energy Solution Ltd.                |          |        |        |
| Norinchukin Bank                             |          |        |        | 1,250 % fällig am 21.06.2029                         | € 2.000  | 2.178    | 0,62   | 5,750 % fällig am 25.09.2028           | \$ 300   | 307    | 0,09   |
| 2,080 % fällig am 22.09.2031                 | \$ 1.000 | 852    | 0,25   | 4,750 % fällig am 05.02.2030                         | 400      | 493      | 0,14   | STAATSEMISSIONEN                       |          |        |        |
| 4,867 % fällig am 14.09.2027                 | 600      | 604    | 0,17   | DSV Finance BV                                       |          |          |        | Korea Water Resources Corp.            |          |        |        |
| 5,094 % fällig am 16.10.2029                 | 700      | 710    | 0,20   | 0,500 % fällig am 03.03.2031                         | 500      | 509      | 0,15   | 4,375 % fällig am 21.05.2027           | 1.100    | 1.105  | 0,31   |
| NTT Finance Corp.                            |          |        |        | Enel Finance International NV                        |          |          |        | Summe Südkorea                         |          | 1.412  | 0,40   |
| 0,399 % fällig am 13.12.2028                 | € 1.300  | 1.409  | 0,40   | 1,625 % fällig am 12.07.2026                         | \$ 500   | 485      | 0,14   | SPANIEN                                |          |        |        |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.        |          |        |        | 2,500 % fällig am 12.07.2031                         | 600      | 527      | 0,15   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL       |          |        |        |
| 3,318 % fällig am 07.10.2031                 | 600      | 710    | 0,20   | Flora Food Management BV                             |          |          |        | Banco Santander S.A.                   |          |        |        |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.              |          |        |        | 6,875 % fällig am 02.07.2029                         | € 400    | 477      | 0,14   | 0,625 % fällig am 24.06.2029           | € 900    | 996    | 0,29   |
| 2,800 % fällig am 10.03.2027                 | \$ 800   | 781    | 0,23   | ING Groep NV                                         |          |          |        | CaixaBank S.A.                         |          |        |        |
|                                              |          | 10.958 | 3,14   | 4,000 % fällig am 12.02.2035                         | 900      | 1.093    | 0,31   | 1,500 % fällig am 03.12.2026           | £ 600    | 811    | 0,23   |
| STAATSEMISSIONEN                             |          |        |        | 7,250 % fällig am 16.11.2034                         | \$ 900   | 916      | 0,26   | Caja Rural de Navarra SCC              |          |        |        |
| Japan Government International Bond          |          |        |        | (b)(c)                                               |          |          |        | 3,000 % fällig am 26.04.2027           | € 2.100  | 2.497  | 0,72   |
| 2,100 % fällig am 20.09.2054                 | ¥ 60.000 | 357    | 0,10   | (b)(c)                                               | 1.000    | 1.064    | 0,31   | EDP Servicios Financieros Espana S.A.  |          |        |        |
| Summe Japan                                  |          | 11.315 | 3,24   | JAB Holdings BV                                      |          |          |        | 3,500 % fällig am 21.07.2031           | 400      | 477    | 0,14   |
| JERSEY, KANALINSELN                          |          |        |        | 4,375 % fällig am 25.04.2034                         | € 1.100  | 1.316    | 0,38   | 4,375 % fällig am 04.04.2032           | 1.300    | 1.622  | 0,46   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |          |        |        | JDE Peet's NV                                        |          |          |        | Telefonica Emisiones S.A.              |          |        |        |
| Aptiv Swiss Holdings Ltd.                    |          |        |        | 2,250 % fällig am 24.09.2031                         | \$ 1.000 | 853      | 0,24   | 4,183 % fällig am 21.11.2033           | 500      | 603    | 0,17   |
| 4,250 % fällig am 11.06.2036                 | € 800    | 933    | 0,27   | Koninklijke Philips NV                               |          |          |        |                                        |          | 7.006  | 2,01   |
|                                              |          |        |        | 4,000 % fällig am 23.05.2035                         | € 200    | 239      | 0,07   | STAATSEMISSIONEN                       |          |        |        |
|                                              |          |        |        | Lseg Netherlands BV                                  |          |          |        | Adif Alta Velocidad                    |          |        |        |
|                                              |          |        |        | 4,231 % fällig am 29.09.2030                         | 500      | 620      | 0,18   | 3,500 % fällig am 30.04.2032           | 1.300    | 1.556  | 0,44   |
|                                              |          |        |        | Nationale-Nederlanden Bank NV                        |          |          |        |                                        |          |        |        |
|                                              |          |        |        | 0,500 % fällig am 21.09.2028                         | 1.100    | 1.208    | 0,35   |                                        |          |        |        |
|                                              |          |        |        | 1,875 % fällig am 17.05.2032                         | 200      | 220      | 0,06   |                                        |          |        |        |
|                                              |          |        |        | 3,000 % fällig am 21.03.2031                         | 400      | 477      | 0,14   |                                        |          |        |        |





| BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Public Service Co. of Colorado<br>2,700 % fällig am 15.01.2051    | \$ 75          | \$ 45                    | 0,01                              | 3,750 % fällig am 15.06.2049                                                          | \$ 400         | \$ 290                   | 0,08                              | State Board of Administration Finance Corp., Florida<br>Revenue Notes, Series 2020 | 170            | \$ 152                   | 0,04                              |
| Public Service Co. of Oklahoma<br>3,200 % fällig am 01.03.2050    | 425            | 283                      | 0,08                              | Synopsis, Inc.<br>5,000 % fällig am 01.04.2032                                        | 600            | 608                      | 0,17                              |                                                                                    |                | 434                      | 0,12                              |
| Public Service Co. of Oklahoma<br>2,200 % fällig am 15.08.2031    | 2.083          | 1.806                    | 0,52                              | Topaz Solar Farms LLC<br>5,750 % fällig am 30.09.2039                                 | 701            | 688                      | 0,20                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                                       |                |                          |                                   |
| Public Service Electric & Gas Co.<br>3,100 % fällig am 15.03.2032 | 600            | 549                      | 0,16                              | VF Corp.<br>2,950 % fällig am 23.04.2030                                              | 100            | 84                       | 0,02                              | Uniform Mortgage-Backed Security                                                   |                |                          |                                   |
| 4,650 % fällig am 15.03.2033                                      | 1.100          | 1.094                    | 0,31                              | 4,250 % fällig am 07.03.2029                                                          | € 400          | 451                      | 0,13                              | 5,000 % fällig am 01.10.2053<br>- 01.07.2054                                       | 19.037         | 18.721                   | 5,36                              |
| Puget Sound Energy, Inc.<br>5,685 % fällig am 15.06.2054          | 400            | 393                      | 0,11                              | Wisconsin Power & Light Co.<br>5,375 % fällig am 30.03.2034                           | \$ 1.300       | 1.333                    | 0,38                              | <b>US-Staatsanleihen</b>                                                           |                |                          |                                   |
| PVH Corp.<br>4,125 % fällig am 16.07.2029                         | € 700          | 839                      | 0,24                              | Wisconsin Public Service Corp.<br>2,850 % fällig am 01.12.2051                        | 450            | 276                      | 0,08                              | U.S. Treasury Bonds                                                                |                |                          |                                   |
| Salesforce, Inc.<br>1,950 % fällig am 15.07.2031                  | \$ 600         | 526                      | 0,15                              |                                                                                       |                | 59.049                   | 16,90                             | 4,625 % fällig am 15.02.2055                                                       | 1.100          | 1.071                    | 0,31                              |
| Solar Star Funding LLC<br>5,375 % fällig am 30.06.2035            | 823            | 848                      | 0,24                              | <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                   |                |                          |                                   | Summe USA                                                                          |                | 83.111                   | 23,79                             |
| Southern California Edison Co.<br>2,500 % fällig am 01.06.2031    | 1.000          | 869                      | 0,25                              | New York City Municipal Water Finance Authority Revenue<br>Bonds, (BABs), Series 2010 | 170            | 170                      | 0,05                              | <b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>                                                   |                |                          |                                   |
| 3,450 % fällig am 01.02.2052                                      | 1.200          | 755                      | 0,22                              | 5,724 % fällig am 15.06.2042                                                          | 110            | 112                      | 0,03                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                            |                |                          |                                   |
| Southwestern Public Service Co.<br>3,150 % fällig am 01.05.2050   | 450            | 292                      | 0,08                              | New York City Municipal Water Finance Authority Revenue<br>Bonds, Series 2010         |                |                          |                                   | Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.<br>6,750 % fällig am 24.04.2033           | 685            | 698                      | 0,20                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | 5,882 % fällig am 15.06.2044                                                          |                |                          |                                   | Summe Übertragbare Wertpapiere                                                     | \$ 340.580     | 97,50                    |                                   |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                  | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|--------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                     | 4,440 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 3.000      | U.S. Treasury Bonds 4,500 % fällig am 15.02.2044 | \$ (3.073)                 | \$ 3.000                            | \$ 3.000                                                            | 0,86                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                  | \$ (3.073)                 | \$ 3.000                            | \$ 3.000                                                            | 0,86                    |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month SOFR June Futures                                      | Long  | 09.2027     | 130                     | \$ 210                                          | 0,06                    |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures            | Short | 09.2025     | 8                       | (5)                                             | 0,00                    |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 79                      | (35)                                            | (0,01)                  |
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09.2025     | 390                     | 404                                             | 0,11                    |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Short | 09.2025     | 30                      | 79                                              | 0,02                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 821                     | 1.035                                           | 0,30                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 158                     | 359                                             | 0,10                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 181                     | 432                                             | 0,12                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025     | 79                      | (243)                                           | (0,07)                  |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Short | 09.2025     | 38                      | (85)                                            | (0,02)                  |
|                                                                |       |             |                         | \$ 2.151                                        | 0,61                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                         | \$ 2.151                                        | 0,61                    |

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

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

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 5.100    | \$ 76                                           | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 19.03.2055       | 600        | 25                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 1,750           | 15.06.2027       | \$ 6.400   | 155                                             | 0,05                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2030       | 3.900      | (24)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,000           | 16.06.2026       | CAD 900    | 35                                              | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2030       | € 7.900    | 100                                             | 0,03                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2055       | 2.850      | 112                                             | 0,03                    |
|                                                |                                     |                 |                  |            | \$ 479                                          | 0,14                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                     |                 |                  |            | \$ 479                                          | 0,14                    |

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

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

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

### DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 362               | \$ 496                | \$ 1                          | \$ 0                            | \$ 1                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 11.415           | AUD 17.572            | 101                           | 0                               | 101                                            | 0,03                 |
|            | 07.2025          | £ 17                | € 15                  | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD 17.572          | \$ 11.421             | 0                             | (102)                           | (102)                                          | (0,03)               |
| BOA        | 08.2025          | \$ 496              | £ 362                 | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | € 97.258            | \$ 110.587            | 0                             | (3.578)                         | (3.578)                                        | (1,02)               |
|            | 07.2025          | \$ 350              | AUD 540               | 4                             | 0                               | 4                                              | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | € 5.270             | \$ 6.097              | 0                             | (90)                            | (90)                                           | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$ 38               | € 33                  | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | € 64.986            | \$ 73.801             | 0                             | (2.483)                         | (2.483)                                        | (0,71)               |
|            | 07.2025          | \$ 27.787           | £ 20.422              | 199                           | 0                               | 199                                            | 0,06                 |
|            | 08.2025          | £ 20.422            | \$ 27.790             | 0                             | (199)                           | (199)                                          | (0,06)               |
| CBK        | 07.2025          | € 2.289             | \$ 2.619              | 0                             | (68)                            | (68)                                           | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$ 814              | INR 70.035            | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 116.573           | € 100.485             | 1.381                         | 0                               | 1.381                                          | 0,40                 |
|            | 08.2025          | € 100.265           | \$ 116.573            | 0                             | (1.380)                         | (1.380)                                        | (0,40)               |
| FAR        | 09.2025          | MXN 1               | \$ 0                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD 18.112          | 11.686                | 0                             | (184)                           | (184)                                          | (0,05)               |
|            | 07.2025          | BRL 119             | 22                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥ 210.075           | 1.448                 | 2                             | (8)                             | (6)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD 13              | 10                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 21               | BRL 119               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 1.093               | ¥ 158.487             | 8                             | 0                               | 8                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          | 22                  | BRL 121               | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| JPM        | 09.2025          | 29                  | MXN 570               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 2.000               | € 1.737               | 39                            | 0                               | 39                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | CAD 1.111           | \$ 814                | 0                             | (2)                             | (2)                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | 9.750               | 7.099                 | 0                             | (47)                            | (47)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | € 5.559             | 6.372                 | 0                             | (153)                           | (153)                                          | (0,04)               |
|            | 07.2025          | £ 71                | 96                    | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥ 3.083             | 21                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 7.095            | CAD 9.753             | 53                            | 0                               | 53                                             | 0,02                 |
|            | 07.2025          | 2.598               | € 2.277               | 75                            | 0                               | 75                                             | 0,02                 |
|            | 07.2025          | 499                 | £ 363                 | 0                             | (2)                             | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 7                   | SGD 10                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD 9.737           | \$ 7.095              | 0                             | (53)                            | (53)                                           | (0,02)               |
|            | 08.2025          | SGD 10              | 7                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £ 10                | 14                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥ 51.499            | 353                   | 0                             | (3)                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD 9               | 7                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 19               | € 16                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 513                 | £ 374                 | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 4                   | SGD 6                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SCX        | 08.2025          | 345                 | ¥ 50.162              | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 2.484               | 356.900               | 0                             | (13)                            | (13)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 1                   | SGD 2                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SOG        | 08.2025          | SGD 2               | \$ 1                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥ 7.352             | 51                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 101              | € 88                  | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
| SSB        | 08.2025          | 51                  | ¥ 7.325               | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £ 20.351            | \$ 27.556             | 0                             | (332)                           | (332)                                          | (0,10)               |
| WST        | 07.2025          | ¥ 84.474            | 587                   | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 83.080           | € 70.848              | 85                            | 0                               | 85                                             | 0,02                 |
|            | 08.2025          | € 70.848            | \$ 83.261             | 0                             | (85)                            | (85)                                           | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$ 587              | ¥ 84.163              | 0                             | (2)                             | (2)                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 1.960                      | \$ (8.787)                      | \$ (6.827)                                     | (1,95)               |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD 2.052           | \$ 1.333              | \$ 0                          | \$ (12)                         | \$ (12)                                        | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$ 1.334            | AUD 2.052             | 12                            | 0                               | 12                                             | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | 1                   | 1                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | 1.235               | 1.925                 | 26                            | 0                               | 26                                             | 0,01                 |
| BRC        | 07.2025          | 1.328               | 2.061                 | 22                            | 0                               | 22                                             | 0,01                 |
| CBK        | 07.2025          | AUD 78              | \$ 50                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | 2.040               | 1.334                 | 0                             | (3)                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 1.328            | AUD 2.058             | 21                            | 0                               | 21                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | 1.335               | 2.040                 | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | 31                  | 48                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 84                         | \$ (15)                         | \$ 69                                          | 0,02                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                 | \$                    | 196                           | \$ (1)                          | \$ (1)                                        | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | CHF                   | 156                           | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          |                     |                       | 61                            | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | CHF                 | \$                    | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          |                     |                       | 157                           | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CHF                   | 139                           | 0                               | 6                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 196                           | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          |                     |                       | 168                           | 0                               | 5                                             | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          |                     |                       | 161                           | 0                               | 5                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 20                         | \$ (2)                          | \$ 18                                         | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                   | \$                    | 50.970                        | \$ (129)                        | \$ (129)                                      | (0,04)               |
|            | 07.2025          | \$                  | €                     | 41.061                        | 0                               | 1.545                                         | 0,44                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 51.082                        | 0                               | 129                                           | 0,04                 |
| BOA        | 07.2025          | €                   | \$                    | 591                           | (15)                            | (15)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | €                     | 42.818                        | 0                               | 1.576                                         | 0,45                 |
| BPS        | 07.2025          | €                   | \$                    | 17                            | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | €                     | 1.521                         | 0                               | 26                                            | 0,01                 |
| BRC        | 07.2025          | €                   | \$                    | 37                            | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | €                     | 43.037                        | 0                               | 1.644                                         | 0,47                 |
| CBK        | 07.2025          | €                   | \$                    | 48                            | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | €                     | 921                           | 0                               | 20                                            | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025          | €                   | \$                    | 1.255                         | (27)                            | (27)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | €                     | 159                           | 0                               | 4                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 4.944                      | \$ (174)                        | \$ 4.770                                      | 1,36                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £                   | \$                    | 31.304                        | \$ 0                            | \$ 42                                         | 0,01                 |
|            | 08.2025          | \$                  | £                     | 22.813                        | (42)                            | (42)                                          | (0,01)               |
| BOA        | 07.2025          | £                   | \$                    | 113                           | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     |                       | 25.188                        | (247)                           | (247)                                         | (0,07)               |
|            | 07.2025          | \$                  | £                     | 24.946                        | 0                               | 529                                           | 0,15                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 33.856                        | 0                               | 243                                           | 0,07                 |
| CBK        | 07.2025          | £                   | \$                    | 274                           | (5)                             | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | £                     | 84                            | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          |                     |                       | 30.566                        | 0                               | 526                                           | 0,15                 |
| MBC        | 07.2025          | £                   | \$                    | 402                           | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | £                     | 157                           | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £                   | \$                    | 33.761                        | 0                               | 21                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          | \$                  | £                     | 22.606                        | 0                               | 369                                           | 0,11                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 33.765                        | (20)                            | (20)                                          | (0,01)               |
| UAG        | 07.2025          |                     |                       | 3.687                         | 0                               | 43                                            | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 1.776                      | \$ (317)                        | \$ 1.459                                      | 0,42                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | SEK                 | \$                    | 4                             | \$ 0                            | \$ 0                                          | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | \$                  | SEK                   | 300                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     |                       | 1.682                         | 0                               | 18                                            | 0,01                 |
| CBK        | 07.2025          | SEK                 | \$                    | 1.877                         | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | SEK                   | 66                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     |                       | 1.864                         | (10)                            | (10)                                          | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          |                     |                       | 1.804                         | 0                               | 9                                             | 0,00                 |
| IND        | 07.2025          | SEK                 | \$                    | 1.840                         | 0                               | 14                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | SEK                   | 17.374                        | (14)                            | (14)                                          | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | SEK                 | \$                    | 5                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | SEK                   | 17                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| RYL        | 07.2025          | SEK                 | \$                    | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | SEK                   | 513                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | SEK                 | \$                    | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | \$                  | SEK                   | 17.338                        | 0                               | 15                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 66                         | \$ (24)                         | \$ 42                                         | 0,01                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Climate Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA                              | 07.2025          | SGD                 | 626 \$                | 489                           | \$ 0                            | \$ (3)                                        | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 1.403                 | SGD 1.808                     | 17                              | 0                                             | 0,01                 |
|                                  | 08.2025          |                     | 489                   | 625                           | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
| BRC                              | 07.2025          |                     | 6                     | 7                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| CBK                              | 07.2025          | SGD                 | 26 \$                 | 20                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 28                    | SGD 35                        | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| FAR                              | 07.2025          | SGD                 | 1.586 \$              | 1.243                         | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 1.403                 | SGD 1.806                     | 14                              | 0                                             | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          |                     | 1.243                 | 1.582                         | 2                               | 0                                             | 0,00                 |
| GLM                              | 07.2025          | SGD                 | 668 \$                | 524                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 524                   | SGD 667                       | 1                               | 0                                             | 0,00                 |
| MBC                              | 07.2025          | SGD                 | 1.568 \$              | 1.213                         | 0                               | (19)                                          | (0,01)               |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 982                   | SGD 1.260                     | 7                               | 0                                             | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          |                     | 1.208                 | 1.559                         | 19                              | 0                                             | 0,01                 |
| MYI                              | 07.2025          | SGD                 | 24 \$                 | 19                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| SCX                              | 07.2025          |                     | 266                   | 206                           | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 206                   | SGD 265                       | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
| SOG                              | 07.2025          |                     | 360                   | 464                           | 4                               | 0                                             | 0,00                 |
| SSB                              | 07.2025          | SGD                 | 6 \$                  | 4                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| UAG                              | 07.2025          | \$                  | 4                     | SGD 5                         | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|                                  |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 43                                         | 0,01                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ (426)                                      | (0,12)               |
| Summe Anlagen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 345.784                                    | 98,99                |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 3.519                                      | 1,01                 |
| Nettovermögen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 349.303                                    | 100,00               |

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

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

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

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

(c) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von USD 550 (31. Dezember 2024: USD null) als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 3.555 (31. Dezember 2024: USD 3.738) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von USD 2.230 (31. Dezember 2024: USD 520) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 340.580                                                      | \$ 0                                                         | \$ 340.580 |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 3.000                                                           | 0                                                            | 3.000      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 359                                                                         | 1.845                                                           | 0                                                            | 2.204      |
| Summen                        | \$ 359                                                                      | \$ 345.425                                                      | \$ 0                                                         | \$ 345.784 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 301.818                                                      | \$ 0                                                         | \$ 301.818 |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 8.000                                                           | 0                                                            | 8.000      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 1.188                                                                       | (779)                                                           | 0                                                            | 409        |
| Summen                        | \$ 1.188                                                                    | \$ 309.039                                                      | \$ 0                                                         | \$ 310.227 |

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

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

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BOS                                | 4,280 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025       | \$ (483)     | \$ (484)                                 | (0,14)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |              | \$ (484)                                 | (0,14)               |

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.545                         | \$ (1.330)                         | \$ 215                          | \$ (12)                          | \$ 0                               | \$ (12)                         |
| BOA        | (1.995)                          | 1.910                              | (85)                            | (44)                             | 0                                  | (44)                            |
| BPS        | (38)                             | 0                                  | (38)                            | 272                              | (260)                              | 12                              |
| BRC        | (275)                            | 200                                | (75)                            | (823)                            | 520                                | (303)                           |
| CBK        | (52)                             | 0                                  | (52)                            | (64)                             | 0                                  | (64)                            |
| DUB        | 1                                | 0                                  | 1                               | (11)                             | 0                                  | (11)                            |
| FAR        | (130)                            | 120                                | (10)                            | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| GLM        | 1                                | 0                                  | 1                               | (57)                             | 0                                  | (57)                            |
| JPM        | 563                              | (660)                              | (97)                            | (1)                              | 0                                  | (1)                             |
| MBC        | (139)                            | 0                                  | (139)                           | 641                              | (260)                              | 381                             |
| MYI        | (1)                              | 0                                  | (1)                             | 0                                | (100)                              | (100)                           |
| RBC        | 5                                | 0                                  | 5                               | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| RYL        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (26)                             | 0                                  | (26)                            |
| SCX        | (13)                             | 0                                  | (13)                            | (83)                             | 0                                  | (83)                            |
| SOG        | 6                                | 0                                  | 6                               | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| SSB        | 38                               | 0                                  | 38                              | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| UAG        | 58                               | 0                                  | 58                              | 1                                | 0                                  | 1                               |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 79,48             | 79,79             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 12,31             | 12,71             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,74              | k. A.             |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 0,82              | 2,45              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,68              | 0,47              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,14              | 0,04              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,42              | 1,12              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 3,41              | 3,42              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------|-------------------|-------------------|
| Australien            | 3,40              | 2,31              |
| Österreich            | 1,38              | 0,86              |
| Belgien               | 0,72              | 0,90              |
| Brasilien             | 0,06              | 0,18              |
| Kanada                | 2,53              | 1,53              |
| Chile                 | 0,69              | 0,67              |
| Tschechische Republik | 0,21              | 0,20              |
| Dänemark              | 2,75              | 2,26              |
| Finnland              | 0,76              | 1,22              |
| Frankreich            | 5,62              | 7,29              |
| Deutschland           | 13,25             | 12,34             |
| Ungarn                | 0,33              | k. A.             |
| Island                | 0,31              | 0,31              |
| Indien                | 0,43              | 0,48              |
| Irland                | 2,58              | 2,58              |
| Italien               | 1,33              | 0,60              |
| Japan                 | 3,24              | 3,39              |
| Jersey, Kanalinseln   | 0,27              | k. A.             |
| Luxemburg             | 2,81              | 3,36              |
| Mauritius             | 0,37              | 0,29              |
| Niederlande           | 9,39              | 7,40              |
| Norwegen              | 1,86              | 0,76              |
| Slowenien             | 0,27              | k. A.             |
| Südkorea              | 0,40              | 0,52              |
| Spanien               | 2,83              | 2,73              |
| Supranational         | 3,14              | 6,93              |

| Anlagen zum Marktwert                               | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Schweden                                            | 2,66              | 1,91              |
| Schweiz                                             | k. A.             | 0,46              |
| Großbritannien                                      | 9,92              | 10,03             |
| USA                                                 | 23,79             | 23,11             |
| Jungferninseln (Britisch)                           | 0,20              | 0,24              |
| Pensionsgeschäfte                                   | 0,86              | 2,51              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate |                   |                   |
| Futures                                             | 0,61              | 0,22              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                 |                   |                   |
| Zinsswaps                                           | 0,14              | (0,03)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                          |                   |                   |
| Devisenterminkontrakte                              | (1,95)            | 1,13              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                 | 1,83              | (1,20)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                         | 1,01              | 2,51              |
| Nettovermögen                                       | 100,00            | 100,00            |



|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | </ |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|----|
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|----|



## PENSIONSGESCHÄFTE

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month EURIBOR September Futures                              | Short | 09.2025     | 607                  | \$ (279)                                 | (0,04)               |
| 3-Month EURIBOR September Futures                              | Long  | 09.2026     | 607                  | 386                                      | 0,05                 |
| Australia Government 3-Year Note September Futures             | Short | 09.2025     | 69                   | (17)                                     | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures            | Long  | 09.2025     | 124                  | 75                                       | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 117                  | (74)                                     | (0,01)               |
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 189                  | 87                                       | 0,01                 |
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09.2025     | 196                  | 217                                      | 0,03                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Long  | 09.2025     | 16                   | (42)                                     | (0,01)               |
| Euro-OAT September Futures                                     | Short | 09.2025     | 158                  | 167                                      | 0,02                 |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 236                  | (52)                                     | (0,01)               |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures                | Long  | 09.2025     | 3                    | 8                                        | 0,00                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025     | 942                  | (743)                                    | (0,10)               |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025     | 131                  | (132)                                    | (0,02)               |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 73                   | 140                                      | 0,02                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 175                  | 417                                      | 0,06                 |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures                 | Short | 09.2025     | 606                  | (2.428)                                  | (0,33)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 437                  | 1.779                                    | 0,25                 |
|                                                                |       |             |                      | <b>\$ (491)</b>                          | <b>(0,07)</b>        |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                      | <b>\$ (491)</b>                          | <b>(0,07)</b>        |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex                      | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|------------------|------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS              | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 27.500   | \$ 161                                   | 0,02                 |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS           | 0,300           | 20.09.2027       | ¥ 74.880   | 4                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS           | 0,500           | 15.12.2031       | 986.000    | 102                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS           | 0,550           | 14.09.2028       | 2.370.000  | 199                                      | 0,03                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,000           | 15.12.2047       | \$ 1.750   | 59                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,428           | 20.12.2047       | 400        | 14                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,478           | 20.12.2047       | 1.115      | 38                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,499           | 20.12.2047       | 570        | 19                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS               | 2,237           | 21.11.2053       | 3.030      | 107                                      | 0,01                 |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS               | 2,340           | 21.11.2028       | 37.090     | 1.128                                    | 0,16                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS               | 2,865           | 13.02.2054       | 18.600     | 893                                      | 0,12                 |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS               | 3,085           | 13.02.2034       | 3.200      | 33                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS               | 3,500           | 20.06.2054       | 4.600      | 222                                      | 0,03                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS               | 4,100           | 15.11.2052       | 19.770     | (410)                                    | (0,06)               |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS               | 4,758           | 18.01.2026       | 690        | 4                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 3-Month NZD-BBR                             | 3,250           | 21.03.2028       | NZD 900    | (27)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 0,000           | 17.03.2053       | € 1.200    | 108                                      | 0,02                 |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 0,190           | 04.11.2052       | 900        | 72                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 0,195           | 04.11.2052       | 950        | 76                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 0,197           | 08.11.2052       | 1.600      | 128                                      | 0,02                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 1,830           | 17.09.2027       | 10.600     | 39                                       | 0,01                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 1,895           | 08.10.2027       | 13.100     | 30                                       | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 2,120           | 03.09.2027       | 6.100      | (18)                                     | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 2,250           | 17.09.2035       | 59.680     | (319)                                    | (0,04)               |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 2,250           | 17.09.2055       | 24.960     | 1.301                                    | 0,18                 |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 2,879           | 15.08.2032       | 13.400     | 512                                      | 0,07                 |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                         | 3,000           | 18.09.2026       | 36.300     | 696                                      | 0,10                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                                     | 1,636           | 15.06.2027       | 14.300     | 30                                       | 0,00                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 1,946           | 15.03.2048       | 60         | 3                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                                     | 2,000           | 15.02.2027       | 30.100     | (108)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                                     | 2,034           | 15.09.2034       | 2.600      | 12                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                                     | 2,049           | 15.08.2034       | 20.800     | (168)                                    | (0,02)               |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,400           | 15.02.2044       | 3.400      | 178                                      | 0,02                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,421           | 15.05.2052       | 700        | 49                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                                     | 2,470           | 15.07.2032       | 11.900     | (213)                                    | (0,03)               |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,488           | 15.05.2037       | 4.790      | 133                                      | 0,02                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                                     | 2,570           | 15.06.2032       | 1.450      | (21)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,580           | 15.03.2052       | 500        | 37                                       | 0,01                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,590           | 15.03.2052       | 4.270      | 316                                      | 0,04                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                                     | 2,600           | 15.05.2032       | 6.300      | (104)                                    | (0,01)               |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,680           | 15.04.2053       | 2.100      | 156                                      | 0,02                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,682           | 15.10.2053       | 600        | 45                                       | 0,01                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,700           | 15.04.2053       | 1.100      | 82                                       | 0,01                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,736           | 15.10.2053       | 900        | 68                                       | 0,01                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                                     | 2,763           | 15.09.2053       | 1.800      | 139                                      | 0,02                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 1,798 %         | 25.08.2027       | \$ 1.000   | \$ 26                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 1,890           | 27.08.2027       | 3.000      | 77                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 1,954           | 03.06.2029       | 700        | (13)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 1,980           | 19.09.2025       | 300        | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 1,998           | 25.07.2029       | 3.600      | (65)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,033           | 23.09.2025       | 1.800      | (13)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,155           | 17.10.2027       | 1.900      | (46)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 2,311           | 24.02.2031       | 5.100      | 56                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,335           | 05.02.2028       | 2.680      | (57)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,353           | 09.05.2028       | 1.790      | (35)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,360           | 09.05.2028       | 2.690      | (53)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,364           | 10.05.2028       | 2.750      | (54)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 2,573           | 26.08.2028       | 1.100      | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 2,645           | 10.09.2028       | 1.500      | 23                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 2,690           | 01.06.2026       | 2.100      | 47                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,700           | 14.01.2026       | 6.200      | (26)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 2,703           | 25.05.2026       | 1.270      | 28                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 2,768           | 13.05.2026       | 3.100      | 69                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                | 2,813           | 14.05.2026       | 1.400      | 31                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,820           | 05.02.2026       | 3.600      | (11)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 2,842           | 13.02.2026       | 3.900      | (11)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 3,043           | 21.02.2026       | 3.900      | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                | 3,300           | 04.06.2026       | 3.500      | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | FRCPXTOB               | 1,910           | 15.01.2038       | € 390      | 23                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 3,100           | 15.06.2031       | £ 2.300    | (40)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 3,400           | 15.06.2030       | 1.610      | (21)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 3,466           | 15.09.2034       | 770        | 16                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 3,500           | 15.08.2034       | 3.500      | 69                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 3,530           | 15.10.2031       | 540        | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,066           | 15.09.2031       | 300        | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | UKRPI                  | 4,615           | 15.02.2027       | 1.600      | 0                                               | 0,00                    |
|                                                |                        |                 |                  |            | <b>\$ 5.847</b>                                 | <b>0,81</b>             |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                 |                  |            | <b>\$ 5.847</b>                                 | <b>0,81</b>             |

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

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

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung      | Anfänglicher<br>Index | Variabler Zinssatz                                         | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| GLM        | Cap - OTC CPALEMU | \$ 100,151            | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035    | 1.200                     | \$ (54) | \$ (33)   | 0,00                         |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld         | Marktwert       | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------------|-----------------|------------------------------|
| BRC        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,440 %       | 25.01.2027    | 2.800                     | \$ (25)         | \$ (28)         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,440         | 25.01.2027    | 2.800                     | (25)            | (17)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,740         | 08.09.2025    | 2.800                     | (65)            | (54)            | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,740         | 08.09.2025    | 2.800                     | (65)            | (19)            | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,350         | 07.01.2027    | 15.200                    | (138)           | (136)           | (0,02)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,350         | 07.01.2027    | 15.200                    | (138)           | (107)           | (0,02)                       |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,500         | 14.01.2027    | 20.600                    | (189)           | (226)           | (0,03)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,500         | 14.01.2027    | 20.600                    | (189)           | (119)           | (0,02)                       |
|            |                                       |                         |                                      |               |               |                           | <b>\$ (834)</b> | <b>\$ (706)</b> | <b>(0,10)</b>                |

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

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

| Kontrahent | Index/Tranchen      | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert   | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|-------------|-------------------------|
| DUB        | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 %                        | 17.10.2057       | \$ 27                     | \$ (2)                                   | \$ 2                                            | \$ 0        | 0,00                    |
| GST        | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500                          | 17.10.2057       | 33                        | (2)                                      | 2                                               | 0           | 0,00                    |
|            |                     |                                |                  |                           | <b>\$ (4)</b>                            | <b>\$ 4</b>                                     | <b>\$ 0</b> | <b>0,00</b>             |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier      | Anzahl der<br>Anteile<br>oder Einheiten | Variabler Zinssatz                                                 | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert   | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------|-----------------|-----------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|------------|------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|-------------|------------------------------|
| BPS        | Erhalt             | BCOMTR Index    | 1.368.505                               | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | \$ 135.359 | 16.03.2026       | \$ 0                                     | \$ (4.723)                                      | \$ (4.723)  | (0,65)                       |
|            | Zahlung            | BCOMTR Index    | 5.425                                   | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.413      | 16.03.2026       | 0                                        | 49                                              | 49          | 0,01                         |
| CBK        | Erhalt             | BCOMF1NTC Index | 348.889                                 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 44.804     | 15.05.2026       | 0                                        | (1.559)                                         | (1.559)     | (0,21)                       |
|            | Erhalt             | BCOMTR Index    | 45.446                                  | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 11.836     | 15.05.2026       | (79)                                     | (334)                                           | (413)       | (0,06)                       |
|            | Erhalt             | CIXBSTR3 Index  | 693.551                                 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 198.434    | 15.05.2026       | 0                                        | (7.011)                                         | (7.011)     | (0,97)                       |
| GST        | Erhalt             | BCOMF1NTC Index | 197.838                                 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 82.387     | 15.04.2026       | 0                                        | (2.866)                                         | (2.866)     | (0,39)                       |
|            | Erhalt             | BCOMTR Index    | 43.044                                  | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 11.211     | 15.04.2026       | 0                                        | (391)                                           | (391)       | (0,05)                       |
| JPM        | Erhalt             | BCOMF1NTC Index | 315.223                                 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 68.657     | 15.07.2026       | 0                                        | (2.389)                                         | (2.389)     | (0,33)                       |
|            | Erhalt             | BCOMTR Index    | 53.265                                  | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 13.873     | 15.07.2026       | 0                                        | (484)                                           | (484)       | (0,07)                       |
|            | Erhalt             | JMABDEWU Index  | 494.170                                 | 0,053 %                                                            | 78.202     | 15.07.2026       | 0                                        | (97)                                            | (97)        | (0,01)                       |
|            | Erhalt             | JMABNIU5 Index  | 164.986                                 | 0,000                                                              | 30.505     | 15.07.2026       | 0                                        | (979)                                           | (979)       | (0,14)                       |
| MAC        | Erhalt             | PIMCODBU Index  | 356.644                                 | 0,150                                                              | 61.684     | 15.09.2025       | 0                                        | (1.972)                                         | (1.972)     | (0,27)                       |
|            | Erhalt             | PIMCODBV Index  | 249.337                                 | 0,600                                                              | 19.651     | 15.09.2025       | 0                                        | 1.102                                           | 1.102       | 0,15                         |
| MEI        | Erhalt             | BCOMTR Index    | 86.512                                  | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 22.532     | 15.09.2026       | 40                                       | (824)                                           | (784)       | (0,11)                       |
| SOG        | Erhalt             | BCOMTR Index    | 214.180                                 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 55.784     | 15.12.2026       | 0                                        | (1.946)                                         | (1.946)     | (0,27)                       |
|            |                    |                 |                                         |                                                                    |            |                  | \$ (39)                                  | \$ (24.424)                                     | \$ (24.463) | (3,37)                       |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | 4.051                    | \$ 562                           | \$ (4)                             | \$ (4)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 18                       | 21                               | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 10.713                   | AUD 16.492                       | 95                                 | 95                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.143                    | NZD 3.561                        | 19                                 | 19                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 16.492                   | \$ 10.720                        | 0                                  | (95)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CNH                    | 10.071                   | 1.405                            | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 3.561                    | 2.145                            | 0                                  | (19)                                                 | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | AUD                    | 397                      | 259                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 107.841                  | 122.620                          | 0                                  | (3.968)                                              | (0,55)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 741.358                  | 544                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PEN                    | 500                      | 138                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 406                      | IDR 6.628.027                    | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 189                      | SGD 243                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 242                      | \$ 189                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 166                      | 5                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | BRL                    | 73                       | 13                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 64                       | 74                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 1.110                    | 110                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 1.055                    | 110                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 534                      | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 33.592                   | 1.034                            | 0                                  | (123)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 460                      | BRL 2.561                        | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 889                      | IDR 14.512.100                   | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 70                       | THB 2.293                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 263                      | TWD 7.836                        | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 5.329                    | \$ 746                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 28.104                   | 862                              | 0                                  | (115)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 537                      | INR 46.712                       | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.063                    | TWD 30.800                       | 7                                  | 7                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | AUD                    | 839                      | \$ 546                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 590                      | 676                              | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 5.031                    | 1.445                            | 0                                  | (49)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 70.019                   | 51                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 597                      | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 80.345                   | £ 59.051                         | 575                                | 575                                                  | 0,08                    |
|            | 07.2025          |                        | 717                      | ILS 2.419                        | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 14                       | KRW 19.831                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 122                      | PLN 456                          | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 12                       | TRY 479                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 753                      | ZAR 13.605                       | 12                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 59.051                   | \$ 80.356                        | 0                                  | (576)                                                | (0,08)                  |
|            | 09.2025          | PEN                    | 1.788                    | 490                              | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | ¥                      | 92.200                   | 648                              | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| DUB        | 07.2025          | KRW                 | 4.513.564             | \$ 3.294                      | \$ 0                          | \$ (43)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | SEK                 | 3.360                 | 354                           | 1                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 27.954                | 841                           | 0                             | (20)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 57.964                | 1.782                         | 0                             | (214)                                         | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 379                   | € 324                         | 1                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 784                   | IDR 12.765.354                | 2                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 12.610                | SEK 120.689                   | 67                            | (13)                                          | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 395                   | TWD 11.704                    | 8                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 1.290                 | \$ 179                        | 0                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SEK                 | 22.061                | 2.333                         | 13                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 64.350                | 1.980                         | 0                             | (257)                                         | (0,04)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 4.024                 | INR 346.840                   | 14                            | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MXN                 | 1.905                 | \$ 99                         | 0                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 12.2025          | PEN                 | 348                   | 94                            | 0                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 2.443                 | 705                           | 0                             | (21)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 81.817                | 60                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 25                    | 19                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 2.087                 | DKK 13.290                    | 4                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 125.811               | € 108.448                     | 1.490                         | 0                                             | 0,21                 |
|            | 07.2025          |                     | 56                    | IDR 905.380                   | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 92                    | TWD 2.739                     | 2                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | DKK                 | 13.258                | \$ 2.087                      | 0                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | €                   | 108.211               | 125.811                       | 0                             | (1.489)                                       | (0,20)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 1.865                 | INR 160.950                   | 8                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 803                   | TWD 25.572                    | 86                            | 0                                             | 0,01                 |
|            | 09.2025          | MXN                 | 33                    | \$ 2                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | AUD                 | 15.256                | 9.843                         | 0                             | (155)                                         | (0,02)               |
|            | 07.2025          | BRL                 | 38.442                | 6.960                         | 0                             | (84)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | CHF                 | 1.252                 | 1.521                         | 0                             | (52)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | CNH                 | 2.061                 | 287                           | 0                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 5.926.509             | 41.312                        | 282                           | 0                                             | 0,04                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 63                    | 49                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 5.895                 | BRL 33.706                    | 280                           | 0                                             | 0,04                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.666                 | CHF 1.334                     | 10                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 2.838                 | DKK 18.063                    | 4                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 23.586                | ¥ 3.433.188                   | 182                           | 0                                             | 0,03                 |
|            | 07.2025          |                     | 140                   | PEN 500                       | 1                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 398                   | PLN 1.469                     | 8                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 152                   | SGD 194                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CHF                 | 1.328                 | \$ 1.666                      | 0                             | (10)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 5.625                 | 786                           | 0                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | DKK                 | 18.019                | 2.838                         | 0                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 3.420.562             | 23.586                        | 0                             | (182)                                         | (0,02)               |
|            | 08.2025          | SGD                 | 194                   | 152                           | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 891                   | INR 77.085                    | 5                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          |                     | 6.960                 | BRL 39.030                    | 84                            | 0                                             | 0,01                 |
|            | 09.2025          |                     | 1.432                 | MXN 27.882                    | 32                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 12.2025          | PEN                 | 503                   | \$ 140                        | 0                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 5.661                 | 174                           | 0                             | (21)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 186                   | IDR 3.027.986                 | 1                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 59                    | SGD 75                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 45                    | TWD 1.474                     | 5                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 75                    | \$ 59                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| JPM        | 08.2025          | \$                  | 116                   | TWD 3.805                     | 16                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 83                    | \$ 101                        | 0                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 3.904                 | 541                           | 0                             | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 31.342                | 4.747                         | 0                             | (184)                                         | (0,02)               |
|            | 07.2025          | KRW                 | 440.484               | 322                           | 0                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 3.561                 | 2.124                         | 0                             | (38)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | SGD                 | 1.672                 | 1.302                         | 0                             | (11)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 34.001                | 1.046                         | 0                             | (125)                                         | (0,02)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 367                   | BRL 2.149                     | 27                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 22                    | £ 16                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 2.020                 | PLN 7.546                     | 67                            | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 124                   | SGD 159                       | 1                             | 0                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          |                     | 216                   | ZAR 3.858                     | 1                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 9.397                 | \$ 1.310                      | 0                             | (7)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 158                   | 124                           | 0                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 31.812                | 976                           | 0                             | (130)                                         | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 601                   | INR 52.098                    | 5                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 11.598                | \$ 8.444                      | 0                             | (55)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | CNH                 | 1.872                 | 260                           | 0                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 3                     | 3                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 270.694               | 1.884                         | 10                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 31.635                | 3.337                         | 17                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 4.017                 | 3.131                         | 0                             | (23)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 14.032                | 424                           | 0                             | (8)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 16.488                | 506                           | 0                             | (62)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 8.440                 | CAD 11.602                    | 63                            | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 188                   | IDR 3.053.003                 | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 935                   | PLN 3.500                     | 34                            | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.273                 | SGD 4.233                     | 50                            | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 19                    | TWD 570                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MYI        | 08.2025          | CAD 11.583             | \$ 8.440                 | \$ 0                             | \$ (63)                            | \$ (63)                                              | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CNH 4.773              | 664                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 4.223              | 3.273                    | 0                                | (51)                               | (51)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | TWD 34.518             | 1.101                    | 0                                | (99)                               | (99)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | € 370                  | 434                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 1.478                | 2.027                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 133.878              | 927                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 12                  | £ 9                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 7.921                  | ¥ 1.154.506              | 72                               | 0                                  | 72                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 100                    | NOK 1.005                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | 2                      | PLN 8                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 5.733              | 801                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥ 1.150.262            | 7.921                    | 0                                | (72)                               | (72)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | NOK 1.005              | 100                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 6.633               | SEK 63.660               | 47                               | 0                                  | 47                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | ILS 37                 | \$ 11                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 1.776              | 61                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 864                 | IDR 14.082.245           | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 89                     | ¥ 12.861                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 654                    | SGD 843                  | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | 136                    | TWD 4.042                | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 12.782             | \$ 1.788                 | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥ 12.814               | 89                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 841                | 654                      | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 9.194              | 282                      | 0                                | (38)                               | (38)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$ 406                 | CNH 2.911                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 629                    | INR 54.003               | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 172                  | \$ 198                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 13.200              | ¥ 1.905.482              | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 10                     | NOK 105                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 08.2025          | ¥ 1.898.490            | \$ 13.200                | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK 105                | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 4                   | INR 311                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 59.051               | \$ 79.956                | 0                                | (964)                              | (964)                                                | (0,13)                  |
|            | 07.2025          | ILS 370                | 103                      | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 87.353               | 604                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 69.875             | 52                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK 148.285            | 15.432                   | 0                                | (127)                              | (127)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | THB 2.228              | 67                       | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 52                  | KRW 69.909               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 08.2025          | 409                    | CNH 2.972                | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|            |                  |                        |                          | \$ 3.786                         | \$ (9.704)                         | \$ (5.918)                                           | (0,82)                  |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 54.402               | \$ 63.698                | \$ 0                             | \$ (161)                           | \$ (161)                                             | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 57.750              | € 50.826                 | 1.913                            | 0                                  | 1.913                                                | 0,26                    |
|            | 08.2025          | 63.838                 | 54.402                   | 161                              | 0                                  | 161                                                  | 0,02                    |
| BOA        | 07.2025          | 63.717                 | 56.037                   | 2.062                            | 0                                  | 2.062                                                | 0,29                    |
|            | 07.2025          | € 18                   | \$ 21                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | \$ 2.231               | € 1.929                  | 33                               | 0                                  | 33                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | € 1.118                | \$ 1.281                 | 0                                | (32)                               | (32)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | \$ 66.135              | € 58.215                 | 2.200                            | 0                                  | 2.200                                                | 0,30                    |
|            | 07.2025          | € 6.587                | \$ 7.598                 | 0                                | (134)                              | (134)                                                | (0,02)                  |
| CBK        | 07.2025          | \$ 375                 | € 322                    | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 54.766               | \$ 63.535                | 0                                | (753)                              | (753)                                                | (0,10)                  |
| DUB        | 08.2025          | \$ 63.535              | € 54.646                 | 752                              | 0                                  | 752                                                  | 0,10                    |
|            | 07.2025          | € 2.643                | \$ 3.048                 | 0                                | (55)                               | (55)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 1.833               | € 1.584                  | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 7.151                         | \$ (1.136)                         | \$ 6.015                                             | 0,83                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 3.132                | \$ 4.298                 | \$ 6                             | \$ 0                               | \$ 6                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 4.299               | £ 3.132                  | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | 20                     | 15                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 3.398                | \$ 4.623                 | 0                                | (34)                               | (34)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | \$ 4.290               | £ 3.176                  | 63                               | 0                                  | 63                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025          | 4.506                  | 3.311                    | 32                               | 0                                  | 32                                                   | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | £ 140                  | \$ 191                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 9                   | £ 7                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | 4.455                  | 3.307                    | 77                               | 0                                  | 77                                                   | 0,01                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| MBC        | 07.2025          | £ 55                | \$ 74                 | \$ 0                          | \$ (1)                          | \$ (1)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 203              | £ 148                 | 1                             | (1)                             | 0                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £ 3.294             | \$ 4.517              | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 4.431            | £ 3.272               | 53                            | 0                               | 53                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | 4.517               | 3.294                 | 0                             | (3)                             | (3)                                            | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | 129                 | 95                    | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 237                        | \$ (46)                         | \$ 191                                         | 0,03                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD 290             | \$ 226                | \$ 0                          | \$ (1)                          | \$ (1)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 119              | SGD 153               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 226                 | 289                   | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | SGD 34              | \$ 27                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 10               | SGD 13                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | SGD 656             | \$ 514                | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 617              | SGD 794               | 6                             | 0                               | 6                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 514                 | 654                   | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| GLM        | 07.2025          | SGD 301             | \$ 236                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 236              | SGD 301               | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | SGD 285             | \$ 222                | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 629              | SGD 808               | 5                             | 0                               | 5                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 222                 | 284                   | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | SGD 785             | \$ 607                | 0                             | (9)                             | (9)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 472              | SGD 606               | 4                             | 0                               | 4                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 568                 | 733                   | 9                             | 0                               | 9                                              | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          | SGD 26              | \$ 20                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 89               | SGD 115               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | 5                   | 7                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 29                         | \$ (12)                         | \$ 17                                          | 0,00                 |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (24.897) (3,43)

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                    | PARI (000\$) | MARKTWERT (000\$) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---------------------------------|--------------|-------------------|----------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>    |              |                   |                      |
| Ginnie Mae, TBA                 |              |                   |                      |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055    | \$ 16.400    | \$ (14.912)       | (2,05)               |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere |              | \$ (14.912)       | (2,05)               |
| Summe Anlagen                   |              | \$ 951.943        | 131,12               |
| Sonstige Aktiva und Passiva     |              | \$ (225.931)      | (31,12)              |
| Nettovermögen                   |              | \$ 726.012        | 100,00               |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 224.191 (31. Dezember 2024: USD 273.214) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2024: USD 24.810) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 230 (31. Dezember 2024: USD null) als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 8.692 (31. Dezember 2024: USD 8.860) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von USD 23.930 (31. Dezember 2024: USD 2.410) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                               | \$ 984.218                                                | \$ 147                                                 | \$ 984.365        |
| Investmentfonds               | 31                                                                 | 0                                                         | 0                                                      | 31                |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                  | 2.000                                                     | 0                                                      | 2.000             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 476                                                                | (20.017)                                                  | 0                                                      | (19.541)          |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                  | (14.912)                                                  | 0                                                      | (14.912)          |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 507</b>                                                      | <b>\$ 951.289</b>                                         | <b>\$ 147</b>                                          | <b>\$ 951.943</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                               | \$ 1.042.108                                              | \$ 0                                                   | \$ 1.042.108        |
| Investmentfonds               | 30                                                                 | 0                                                         | 0                                                      | 30                  |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                  | 14.600                                                    | 0                                                      | 14.600              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (158)                                                              | 7.929                                                     | 0                                                      | 7.771               |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ (128)</b>                                                    | <b>\$ 1.064.637</b>                                       | <b>\$ 0</b>                                            | <b>\$ 1.064.509</b> |

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

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:**

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BSN                                       | 4,450 %    | 09.06.2025       | 14.07.2025       | \$ (87.977)  | \$ (88.217)                              | (12,15)              |
| CIB                                       | 4,440      | 06.06.2025       | 18.07.2025       | (98.984)     | (99.289)                                 | (13,68)              |
|                                           |            | 01.07.2025       | 18.07.2025       | (25.625)     | (25.625)                                 | (3,53)               |
| DEU                                       | 4,480      | 25.06.2025       | 02.07.2025       | (19.170)     | (19.184)                                 | (2,64)               |
| JPS                                       | 4,450      | 23.06.2025       | 07.07.2025       | (4.166)      | (4.170)                                  | (0,57)               |
|                                           | 4,460      | 24.06.2025       | 01.07.2025       | (12.168)     | (12.179)                                 | (1,68)               |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                  |              | <b>\$ (248.664)</b>                      | <b>(34,25)</b>       |

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.902                         | \$ (1.630)                         | \$ 272                          | \$ 80                            | \$ 0                               | \$ 80                           |
| BOA        | (1.913)                          | 1.830                              | (83)                            | 325                              | (310)                              | 15                              |
| BPS        | (4.851)                          | 3.770                              | (1.081)                         | 788                              | (990)                              | (202)                           |
| BRC        | 2.045                            | (2.040)                            | 5                               | 356                              | (340)                              | 16                              |
| CBK        | (9.556)                          | 7.430                              | (2.126)                         | 1.291                            | (1.780)                            | (489)                           |
| DUB        | 74                               | 0                                  | 74                              | (1.216)                          | 830                                | (386)                           |
| FAR        | 403                              | (460)                              | (57)                            | 431                              | (360)                              | 71                              |
| GLM        | (620)                            | 0                                  | (620)                           | (133)                            | 280                                | 147                             |
| GST        | (3.257)                          | 2.500                              | (757)                           | 309                              | (410)                              | (101)                           |
| JPM        | (4.274)                          | 3.930                              | (344)                           | 907                              | (420)                              | 487                             |
| MAC        | (870)                            | 980                                | 110                             | (113)                            | 540                                | 427                             |
| MBC        | (219)                            | 30                                 | (189)                           | 2.018                            | (1.390)                            | 628                             |
| MEI        | (784)                            | 690                                | (94)                            | 76                               | 0                                  | 76                              |
| MYI        | (1)                              | (10)                               | (11)                            | 63                               | (60)                               | 3                               |
| RYL        | 47                               | 0                                  | 47                              | (52)                             | 0                                  | (52)                            |
| SCX        | (34)                             | 0                                  | (34)                            | (1.109)                          | 760                                | (349)                           |
| SOG        | (1.950)                          | 1.710                              | (240)                           | 289                              | (350)                              | (61)                            |
| SSB        | (911)                            | 1.060                              | 149                             | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| TOR        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | 782                              | (780)                              | 2                               |
| UAG        | (128)                            | 0                                  | (128)                           | 498                              | (580)                              | (82)                            |

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



**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| <b>Analyse des Gesamtvermögens</b>                                     | <b>30. Jun. 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|------------------------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 69,30                    | 60,21                    |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 15,53                    | 12,84                    |
| Investmentfonds                                                        | 0,00                     | 0,00                     |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 0,17                     | 1,03                     |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,28                     | 0,18                     |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,66                     | 0,33                     |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,06                     | 0,75                     |
| Sonstige Aktiva                                                        | 13,00                    | 24,66                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>            | <b>100,00</b>            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| <b>Anlagen zum Marktwert</b>                           | <b>30. Jun. 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|--------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Australien                                             | 0,95                     | 0,86                     |
| Kanada                                                 | 0,33                     | 0,31                     |
| Kaimaninseln                                           | 0,78                     | 1,74                     |
| Dänemark                                               | 0,67                     | 0,60                     |
| Frankreich                                             | 4,33                     | 5,25                     |
| Irland                                                 | 4,25                     | 4,43                     |
| Italien                                                | 3,83                     | 7,96                     |
| Japan                                                  | 6,52                     | 6,71                     |
| Mexiko                                                 | 0,07                     | 0,07                     |
| Neuseeland                                             | 0,28                     | 0,25                     |
| Peru                                                   | 0,04                     | 0,01                     |
| Spanien                                                | 5,14                     | 4,38                     |
| Schweden                                               | 0,28                     | 1,82                     |
| Schweiz                                                | k. A.                    | 0,06                     |
| Großbritannien                                         | 10,34                    | 10,15                    |
| USA                                                    | 97,02                    | 96,40                    |
| Kurzfristige Instrumente                               | 0,75                     | k. A.                    |
| Investmentfonds                                        | 0,00                     | 0,00                     |
| Pensionsgeschäfte                                      | 0,28                     | 1,98                     |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate    |                          |                          |
| Futures                                                | (0,07)                   | 0,06                     |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                    |                          |                          |
| Zinsswaps                                              | 0,81                     | 0,24                     |
| Freiverkehrsfinanzderivate                             |                          |                          |
| Verkaufsoptionen                                       |                          |                          |
| Inflation-Capped Options                               | 0,00                     | (0,01)                   |
| Zinsswapoptionen                                       | (0,10)                   | (0,12)                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf | 0,00                     | 0,00                     |
| Total Return Swaps auf Indizes                         | (3,37)                   | 0,49                     |
| Devisenterminkontrakte                                 | (0,82)                   | 0,88                     |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                    | 0,86                     | (0,48)                   |
| Leerverkaufte Wertpapiere                              | (2,05)                   | k. A.                    |
| Sonstige Aktiva und Passiva                            | (31,12)                  | (44,04)                  |
| <b>Nettovermögen</b>                                   | <b>100,00</b>            | <b>100,00</b>            |

| BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                          |                |                          |                                   | <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>ARGENTINIEN</b>                                       |                |                          |                                   | <b>EP Infrastructure A/S</b>                                      |                |                          |                                   | <b>Japan Government International Bond</b>         |                |                          |                                   |
| <b>STAAITSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | 1,698 % fällig am 30.07.2026 € 200 \$ 232 0,09                    |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 20.12.2044 ¥ 100.000 \$ 655 0,26 |                |                          |                                   |
| Argentina Government International Bond                  |                |                          |                                   | 2,045 % fällig am 09.10.2028 100 113 0,04                         |                |                          |                                   | 2,200 % fällig am 20.03.2064 43.000 239 0,09       |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 09.07.2041 \$ 600 \$ 374 0,15          |                |                          |                                   | <b>EPH Financing International A/S</b>                            |                |                          |                                   | 2,400 % fällig am 20.03.2045 46.300 323 0,13       |                |                          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>                                        |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 30.11.2029 1.200 1.507 0,60                     |                |                          |                                   | 2,400 % fällig am 20.03.2055 10.000 64 0,03        |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | Summe Tschechische Republik 1.852 0,73                            |                |                          |                                   | Summe Japan 1.488 0,59                             |                |                          |                                   |
| Virgin Australia Holdings Pty. Ltd.                      |                |                          |                                   | <b>DÄNEMARK</b>                                                   |                |                          |                                   | <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                         |                |                          |                                   |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 ^ 373 3 0,00                |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                           |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   |
| Woodside Finance Ltd.                                    |                |                          |                                   | <b>TDC Net A/S</b>                                                |                |                          |                                   | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.             |                |                          |                                   |
| 5,400 % fällig am 19.05.2030 200 203 0,08                |                |                          |                                   | 5,186 % fällig am 02.08.2029 100 123 0,05                         |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 12.11.2025 € 379 442 0,18        |                |                          |                                   |
| Summe Australien 206 0,08                                |                |                          |                                   | 5,618 % fällig am 06.02.2030 1.200 1.501 0,59                     |                |                          |                                   | <b>LIBERIA</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>ÖSTERREICH</b>                                        |                |                          |                                   | Summe Dänemark 1.624 0,64                                         |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>                      |                |                          |                                   | <b>FRANKREICH</b>                                                 |                |                          |                                   | Royal Caribbean Cruises Ltd.                       |                |                          |                                   |
| ams-OSRAM AG                                             |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                           |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.04.2028 \$ 500 506 0,20       |                |                          |                                   |
| 2,125 % fällig am 03.11.2027 € 1.100 1.219 0,48          |                |                          |                                   | <b>Altice France S.A.</b>                                         |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 30.09.2031 1.900 1.913 0,76      |                |                          |                                   |
| <b>BELGIEN</b>                                           |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 15.07.2029 \$ 365 302 0,12                      |                |                          |                                   | Summe Liberia 2.419 0,96                           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | <b>BNP Paribas S.A.</b>                                           |                |                          |                                   | <b>AKTIEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| Manuchar Group SARL                                      |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 11.06.2030 (e)(g) € 200 259 0,10                |                |                          |                                   | <b>LUXEMBURG</b>                                   |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 30.06.2027 200 239 0,09                |                |                          |                                   | <b>BPCE S.A.</b>                                                  |                |                          |                                   | <b>STAMMAKTIEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>BERMUDA</b>                                           |                |                          |                                   | 7,003 % fällig am 19.10.2034 \$ 900 989 0,39                      |                |                          |                                   | Intelsat Emergence S.A. (h) 7.496 259 0,10         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | <b>CAB SELAS</b>                                                  |                |                          |                                   | <b>PARI (000S)</b>                                 |                |                          |                                   |
| Aircastle Ltd.                                           |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 01.02.2028 (i) € 375 420 0,17                   |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 15.03.2030 \$ 300 303 0,12             |                |                          |                                   | <b>ELO SACA</b>                                                   |                |                          |                                   | <b>CPI Property Group S.A.</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>BRASILIEN</b>                                         |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 17.04.2028 1.100 1.237 0,49                     |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 22.01.2028 £ 200 261 0,11        |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | <b>Opal Bidco S.A.S.</b>                                          |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 27.01.2032 € 800 957 0,38        |                |                          |                                   |
| Itau Unibanco Holding S.A.                               |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 31.03.2032 1.000 1.200 0,47                     |                |                          |                                   | Summe Luxemburg 1.477 0,59                         |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 27.02.2030 400 411 0,16                |                |                          |                                   | <b>Ubisoft Entertainment S.A.</b>                                 |                |                          |                                   | <b>MEXIKO</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>KANADA</b>                                            |                |                          |                                   | 0,878 % fällig am 24.11.2027 400 424 0,17                         |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | Summe Frankreich 4.831 1,91                                       |                |                          |                                   | <b>Petroleos Mexicanos</b>                         |                |                          |                                   |
| Air Canada Pass-Through Trust                            |                |                          |                                   | <b>DEUTSCHLAND</b>                                                |                |                          |                                   | 10,000 % fällig am 07.02.2033 \$ 100 107 0,04      |                |                          |                                   |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031 33 31 0,01                  |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                           |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   |
| Canadian Pacific Railway Co.                             |                |                          |                                   | <b>Cheplapharm Arzneimittel GmbH</b>                              |                |                          |                                   | <b>Mexico Government International Bond</b>        |                |                          |                                   |
| 2,450 % fällig am 02.12.2031 1.200 1.054 0,42            |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 15.06.2031 (a) 675 799 0,32                     |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 03.12.2026 (d) MXN 425 22 0,01   |                |                          |                                   |
| Fairfax Financial Holdings Ltd.                          |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 15.05.2030 900 1.080 0,43                       |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 30.11.2028 (d) 850 44 0,02       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 07.12.2033 100 104 0,04                |                |                          |                                   | <b>DVI Deutsche Vermoögens- &amp; Immobilienverwaltungs GmbH</b>  |                |                          |                                   | Summe Mexiko 173 0,07                              |                |                          |                                   |
| goeasy Ltd.                                              |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 21.08.2030 1.400 1.671 0,66                     |                |                          |                                   | <b>MULTINATIONAL</b>                               |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 01.12.2028 900 953 0,38                |                |                          |                                   | <b>IHO Verwaltungs GmbH (7,750 % bar oder 8,500 % PIK)</b>        |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   |
| Summe Kanada 2.744 1,09                                  |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am 15.11.2030 (b) \$ 700 719 0,28                  |                |                          |                                   | <b>Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC</b>      |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                |                |                          |                                   | <b>Mahle GmbH</b>                                                 |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.09.2028 € 1.100 1.227 0,49    |                |                          |                                   |
| Baush&Lomb Corp.                                         |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 14.05.2028 € 200 223 0,09                       |                |                          |                                   | Delta Air Lines, Inc.                              |                |                          |                                   |
| TBD % fällig am 18.12.2030 600 602 0,24                  |                |                          |                                   | Summe Deutschland 4.492 1,78                                      |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 20.10.2028 \$ 400 401 0,16       |                |                          |                                   |
| Summe Kanada 2.744 1,09                                  |                |                          |                                   | <b>INTERNATIONAL</b>                                              |                |                          |                                   | JetBlue Airways Corp.                              |                |                          |                                   |
| <b>KAIMANINSELN</b>                                      |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                           |                |                          |                                   | 9,875 % fällig am 20.09.2031 600 584 0,23          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | <b>Thames Water Super Senior Issuer PLC</b>                       |                |                          |                                   | Summe multinational 2.212 0,88                     |                |                          |                                   |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                             |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 10.10.2025 £ 13 17 0,01                         |                |                          |                                   | <b>NIEDERLANDE</b>                                 |                |                          |                                   |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027 1.025 975 0,39              |                |                          |                                   | <b>ITALIEN</b>                                                    |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % bar oder 6,000 % PIK) |                |                          |                                   | <b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>                        |                |                          |                                   | EnBW International Finance BV                      |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 30.09.2026 ^ (b) 34 4 0,00             |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 05.09.2027 € 500 613 0,24                       |                |                          |                                   | 6,048 % fällig am 30.10.2034 AUD 200 137 0,05      |                |                          |                                   |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK) |                |                          |                                   | <b>Cerved Group SpA</b>                                           |                |                          |                                   | Sagax Euro MTN NL BV                               |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 30.09.2027 ^ (b) 34 4 0,00             |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 15.02.2029 200 228 0,09                         |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 17.05.2029 € 300 323 0,13        |                |                          |                                   |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK) |                |                          |                                   | <b>Intesa Sanpaolo SpA</b>                                        |                |                          |                                   | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV         |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 30.09.2027 ^ (b) 68 9 0,00             |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 01.06.2042 \$ 200 162 0,07                      |                |                          |                                   | 3,150 % fällig am 01.10.2026 \$ 236 232 0,09       |                |                          |                                   |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK) |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 20.06.2033 1.100 1.195 0,47                     |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 01.12.2030 400 407 0,16          |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 30.09.2028 ^ (b) 103 13 0,01           |                |                          |                                   | 7,200 % fällig am 28.11.2033 600 674 0,27                         |                |                          |                                   | 8,125 % fällig am 15.09.2031 500 567 0,23          |                |                          |                                   |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) |                |                          |                                   | 7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g) 300 301 0,12                  |                |                          |                                   | Universal Music Group NV                           |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 30.09.2029 ^ (b) 103 13 0,01           |                |                          |                                   | <b>Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA</b>           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 13.06.2031 € 600 735 0,29        |                |                          |                                   |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK) |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 09.10.2025 € 200 235 0,09                       |                |                          |                                   | ZF Europe Finance BV                               |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 30.09.2030 ^ (b) 49 6 0,00             |                |                          |                                   | <b>UniCredit SpA</b>                                              |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 13.03.2029 (i) 400 462 0,18      |                |                          |                                   |
| Summe Kaimaninseln 1.024 0,41                            |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 03.06.2026 (e)(g) 300 366 0,15                  |                |                          |                                   | Summe Niederlande 2.863 1,13                       |                |                          |                                   |
| <b>CHINA</b>                                             |                |                          |                                   | Summe Italien 3.774 1,50                                          |                |                          |                                   | <b>JAPAN</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                           |                |                          |                                   | <b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>       |                |                          |                                   |
| Yango Justice International Ltd.                         |                |                          |                                   | 5,632 % fällig am 15.01.2035 \$ 200 207 0,08                      |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^ 200 0 0,00                |                |                          |                                   |                                                                   |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 15.04.2023 ^ 200 1 0,00                |                |                          |                                   |                                                                   |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Summe China 1 0,00                                       |                |                          |                                   |                                                                   |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>NORWEGEN</b>                            |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                     |                |                          |                                   | <b>AMERICAN BUILDERS &amp; CONTRACTORS SUPPLY CO., INC.</b> |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | <b>United Kingdom Gilt</b>                                  |                |                          |                                   | <b>6,150 % fällig am 02.04.2030</b>                         |                |                          |                                   |
| Var Energi ASA                             |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 31.07.2054                                | 258            | 306                      | 0,12                              | 8,000 % fällig am 25.05.2028                                | 50             | 54                       | 0,02                              |
| 8,000 % fällig am 15.11.2032               | \$ 300         | \$ 340                   | 0,13                              | Summe Großbritannien                                        |                | 16.066                   | 6,37                              | Block, Inc.                                                 |                |                          |                                   |
| <b>PANAMA</b>                              |                |                          |                                   | <b>USA</b>                                                  |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.06.2031                                | 1.400          | 1.285                    | 0,51                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                     |                |                          |                                   | Blue Owl Finance LLC                                        |                |                          |                                   |
| Carnival Corp.                             |                |                          |                                   | <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>          |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 10.06.2031                                | 700            | 622                      | 0,25                              |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028               | 3.100          | 3.036                    | 1,20                              | 5,259 % fällig am 25.12.2045                                | \$ 231         | 177                      | 0,07                              | Boeing Co.                                                  |                |                          |                                   |
| <b>PERU</b>                                |                |                          |                                   | <b>Argent Securities Trust</b>                              |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 01.08.2059                                | 500            | 342                      | 0,14                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | 4,584 % fällig am 25.09.2036                                | 718            | 231                      | 0,09                              | 5,705 % fällig am 01.05.2040                                | 300            | 297                      | 0,12                              |
| Peru Government International Bond         |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.04.2036                                | 253            | 79                       | 0,03                              | 5,805 % fällig am 01.05.2050                                | 100            | 96                       | 0,04                              |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034               | PEN 500        | 133                      | 0,05                              | 4,994 % fällig am 25.04.2036                                | 620            | 194                      | 0,08                              | Booz Allen Hamilton, Inc.                                   |                |                          |                                   |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032               | 543            | 158                      | 0,06                              | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                         |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 01.09.2028                                | 1.900          | 1.844                    | 0,73                              |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031               | 526            | 161                      | 0,07                              | 4,754 % fällig am 25.12.2036                                | 1.475          | 808                      | 0,32                              | Cameron LNG LLC                                             |                |                          |                                   |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033               | 4.600          | 1.415                    | 0,56                              | First Franklin Mortgage Loan Trust                          |                |                          |                                   | 2,902 % fällig am 15.07.2031                                | 600            | 545                      | 0,22                              |
| Summe Peru                                 |                | 1.867                    | 0,74                              | 5,859 % fällig am 25.10.2034                                | 200            | 201                      | 0,08                              | Centene Corp.                                               |                |                          |                                   |
| <b>POLEN</b>                               |                |                          |                                   | <b>GSAMP Trust</b>                                          |                |                          |                                   | 2,450 % fällig am 15.07.2028                                | 725            | 674                      | 0,27                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | 4,524 % fällig am 25.01.2037                                | 335            | 202                      | 0,08                              | Cheniere Energy Partners LP                                 |                |                          |                                   |
| Synthos S.A.                               |                |                          |                                   | 4,554 % fällig am 25.12.2036                                | 481            | 238                      | 0,09                              | 3,250 % fällig am 31.01.2032 (i)                            | 1.000          | 897                      | 0,36                              |
| 2,500 % fällig am                          |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.12.2046                                | 588            | 291                      | 0,12                              | 5,750 % fällig am 15.08.2034 (i)                            | 600            | 616                      | 0,24                              |
| 07.06.2028 (i)                             | € 500          | 555                      | 0,22                              | <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>                  |                |                          |                                   | Cheniere Energy, Inc.                                       |                |                          |                                   |
| <b>RUMÄNIEN</b>                            |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.08.2036                                | 437            | 160                      | 0,06                              | 5,650 % fällig am 15.04.2034                                | 2.300          | 2.356                    | 0,93                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>               |                |                          |                                   | Choice Hotels International, Inc.                           |                |                          |                                   |
| Romania Government International Bond      |                |                          |                                   | 4,400 % fällig am 25.11.2037                                | 64             | 20                       | 0,01                              | 3,700 % fällig am 15.01.2031                                | 250            | 232                      | 0,09                              |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030               | 200            | 240                      | 0,10                              | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                      |                |                          |                                   | Constellation Brands, Inc.                                  |                |                          |                                   |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                           |                |                          |                                   | 4,564 % fällig am 25.01.2037                                | 314            | 145                      | 0,06                              | 2,250 % fällig am 01.08.2031                                | 700            | 607                      | 0,24                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | 4,574 % fällig am 25.10.2036                                | 250            | 109                      | 0,04                              | Constellation Energy Generation LLC                         |                |                          |                                   |
| South Africa Government International Bond |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.09.2036                                | 1.685          | 579                      | 0,23                              | 6,125 % fällig am 15.01.2034                                | 700            | 754                      | 0,30                              |
| 7,100 % fällig am 19.11.2036               | \$ 200         | 199                      | 0,08                              | 4,894 % fällig am 25.09.2036                                | 56             | 24                       | 0,01                              | Coterra Energy, Inc.                                        |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037               | ZAR 3.900      | 191                      | 0,07                              | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                       |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 15.02.2035                                | 200            | 198                      | 0,08                              |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035               | 27.412         | 1.440                    | 0,57                              | 4,534 % fällig am 25.04.2037                                | 55             | 28                       | 0,01                              | Crowdstrike Holdings, Inc.                                  |                |                          |                                   |
| Summe Südafrika                            |                | 1.830                    | 0,72                              | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                          |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 15.02.2029                                | 600            | 568                      | 0,23                              |
| <b>SPANIEN</b>                             |                |                          |                                   | 6,465 % fällig am 25.09.2046                                | 590            | 193                      | 0,08                              | Diamondback Energy, Inc.                                    |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | New Century Home Equity Loan Trust                          |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 18.04.2034                                | 600            | 602                      | 0,24                              |
| Grifols S.A.                               |                |                          |                                   | 7,434 % fällig am 25.01.2033                                | 42             | 36                       | 0,01                              | 5,550 % fällig am 01.04.2035                                | 600            | 607                      | 0,24                              |
| 2,250 % fällig am 15.11.2027               | € 1.000        | 1.148                    | 0,46                              | NovaStar Mortgage Funding Trust                             |                |                          |                                   | DT Midstream, Inc.                                          |                |                          |                                   |
| Lorca Telecom Bondco S.A.                  |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.06.2036                                | 478            | 350                      | 0,14                              | 5,800 % fällig am 15.12.2034                                | 100            | 102                      | 0,04                              |
| 5,750 % fällig am 30.04.2029               | 700            | 859                      | 0,34                              | 4,734 % fällig am 25.09.2036                                | 747            | 291                      | 0,12                              | Edison International                                        |                |                          |                                   |
| Summe Spanien                              |                | 2.007                    | 0,80                              | Option One Mortgage Loan Trust                              |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 15.03.2030                                | 300            | 305                      | 0,12                              |
| <b>SCHWEIZ</b>                             |                |                          |                                   | 4,684 % fällig am 25.03.2037                                | 456            | 225                      | 0,09                              | Energy Transfer LP                                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | Residential Asset Mortgage Products Trust                   |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.05.2044                                | 500            | 433                      | 0,17                              |
| UBS Group AG                               |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.12.2035                                | 999            | 832                      | 0,33                              | Entergy Corp.                                               |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am                          |                |                          |                                   | Residential Asset Securities Corp. Trust                    |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.06.2050                                | 200            | 143                      | 0,06                              |
| 10.02.2031 (e)(g)                          | \$ 300         | 266                      | 0,10                              | 5,314 % fällig am 25.08.2034                                | 239            | 239                      | 0,10                              | EPR Properties                                              |                |                          |                                   |
| 4,988 % fällig am 05.08.2033               | 500            | 499                      | 0,20                              | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust              |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.06.2027                                | 50             | 50                       | 0,02                              |
| 6,537 % fällig am 12.08.2033               | 1.050          | 1.142                    | 0,45                              | 5,394 % fällig am 25.01.2036                                | 82             | 78                       | 0,03                              | 4,950 % fällig am 15.04.2028                                | 200            | 200                      | 0,08                              |
| 7,000 % fällig am 10.02.2030               |                |                          |                                   | Soundview Home Loan Trust                                   |                |                          |                                   | FirstEnergy Corp.                                           |                |                          |                                   |
| (e)(g)                                     | 1.000          | 997                      | 0,39                              | 4,614 % fällig am 25.07.2037                                | 199            | 179                      | 0,07                              | 2,250 % fällig am 01.09.2030                                | 800            | 711                      | 0,28                              |
| 7,125 % fällig am                          |                |                          |                                   | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust          |                |                          |                                   | Fiserv, Inc.                                                |                |                          |                                   |
| 10.08.2034 (e)(g)                          | 300            | 300                      | 0,12                              | 4,734 % fällig am 25.09.2037                                | 305            | 210                      | 0,08                              | 3,500 % fällig am 01.07.2029                                | 1.200          | 1.156                    | 0,46                              |
| 9,016 % fällig am 15.11.2033               | 300            | 371                      | 0,15                              |                                                             |                |                          |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC                                   |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am                          |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |                |                          |                                   | 5,850 % fällig am 17.05.2027                                | 200            | 202                      | 0,08                              |
| 13.11.2028 (e)(g)                          | 500            | 547                      | 0,22                              | <b>Alexandria Real Estate Equities, Inc.</b>                |                |                          |                                   | Gartner, Inc.                                               |                |                          |                                   |
| Summe Schweiz                              |                | 4.122                    | 1,63                              | 5,500 % fällig am 01.10.2035                                | 600            | 607                      | 0,24                              | 3,625 % fällig am 15.06.2029                                | 700            | 666                      | 0,26                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                     |                |                          |                                   | Allstate Corp.                                              |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 01.10.2030                                | 600            | 562                      | 0,22                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | 7,526 % fällig am 15.08.2053                                | 100            | 100                      | 0,04                              | GLP Capital LP                                              |                |                          |                                   |
| Anglian Water Osprey Financing PLC         |                |                          |                                   | American Airlines Pass-Through Trust                        |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.09.2034                                | 300            | 299                      | 0,12                              |
| 4,000 % fällig am 08.03.2026               | £ 600          | 813                      | 0,32                              | 3,375 % fällig am 01.11.2028                                | 350            | 341                      | 0,14                              | 6,750 % fällig am 01.12.2033                                | 100            | 107                      | 0,04                              |
| BCP Modular Services Finance PLC           |                |                          |                                   | <b>AMERICAN BUILDERS &amp; CONTRACTORS SUPPLY CO., INC.</b> |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                                   |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028               | € 300          | 347                      | 0,14                              | <b>4,000 % fällig am 15.01.2028</b>                         |                |                          |                                   | 5,734 % fällig am 28.01.2056                                | 500            | 500                      | 0,20                              |
| Boparan Finance PLC                        |                |                          |                                   | <b>3,375 % fällig am 15.07.2051</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| 9,375 % fällig am 07.11.2029               | £ 300          | 427                      | 0,17                              | <b>Amgen, Inc.</b>                                          |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| Burberry Group PLC                         |                |                          |                                   | <b>5,250 % fällig am 02.03.2033</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 20.06.2030               | 375            | 514                      | 0,20                              | <b>Apollo Debt Solutions BDC</b>                            |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| Canary Wharf Group Investment Holdings PLC |                |                          |                                   | <b>6,700 % fällig am 29.07.2031</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 07.04.2026               | € 600          | 695                      | 0,27                              | <b>Ares Capital Corp.</b>                                   |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| Chanel Ceres PLC                           |                |                          |                                   | <b>7,000 % fällig am 15.01.2027</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 31.07.2031               | 1.000          | 1.032                    | 0,41                              | <b>Ares Strategic Income Fund</b>                           |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC           |                |                          |                                   | <b>5,600 % fällig am 15.02.2030</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029               | \$ 500         | 358                      | 0,14                              | <b>Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.</b>                 |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| Harbour Energy PLC                         |                |                          |                                   | <b>6,125 % fällig am 15.09.2028</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| 6,327 % fällig am 01.04.2035               | 100            | 100                      | 0,04                              | <b>Athene Global Funding</b>                                |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| International Distribution Services PLC    |                |                          |                                   | <b>5,322 % fällig am 13.11.2031</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |
| 7,375 % fällig am 14.09.2030               | £ 1.400        | 2.018                    | 0,80                              | <b>5,583 % fällig am 09.01.2029</b>                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc.<br>6,375 % fällig am 01.07.2034 | \$ 500         | \$ 500                   | 0,20                              | Silgan Holdings, Inc.<br>1,400 % fällig am 01.04.2026                                | \$ 400         | \$ 389                   | 0,15                              | 4,714 % fällig am 25.07.2047                                                                  | \$ 11          | \$ 10                    | 0,00                              |
| HAT Holdings LLC<br>3,375 % fällig am 15.06.2026                            | 400            | 392                      | 0,16                              | SLM Corp.<br>3,125 % fällig am 02.11.2026                                            | 825            | 809                      | 0,32                              | 4,814 % fällig am 25.10.2036                                                                  | 159            | 44                       | 0,02                              |
| 8,000 % fällig am 15.06.2027                                                | 400            | 417                      | 0,17                              | Southern California Edison Co.<br>1,200 % fällig am 01.02.2026                       | 700            | 682                      | 0,27                              | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust<br>4,706 % fällig am 25.08.2035           | 4              | 3                        | 0,00                              |
| HCA, Inc.<br>3,500 % fällig am 01.09.2030                                   | 1.050          | 993                      | 0,39                              | 4,875 % fällig am 01.03.2049                                                         | 50             | 40                       | 0,02                              | IndyMac Mortgage Loan Trust<br>3,761 % fällig am 25.12.2034                                   | 208            | 190                      | 0,08                              |
| Highwoods Realty LP<br>4,200 % fällig am 15.04.2029                         | 400            | 389                      | 0,15                              | Spirit Airlines Pass-Through Trust<br>4,100 % fällig am 01.10.2029                   | 49             | 45                       | 0,02                              | 4,380 % fällig am 25.05.2037                                                                  | 42             | 36                       | 0,01                              |
| Host Hotels & Resorts LP<br>2,900 % fällig am 15.12.2031                    | 1.100          | 965                      | 0,38                              | Stryker Corp.<br>1,000 % fällig am 03.12.2031                                        | € 400          | 412                      | 0,16                              | 4,934 % fällig am 25.02.2037                                                                  | 20             | 13                       | 0,01                              |
| 3,500 % fällig am 15.09.2030                                                | 925            | 859                      | 0,34                              | Synopsys, Inc.<br>5,000 % fällig am 01.04.2032                                       | \$ 1.900       | 1.925                    | 0,76                              | JPMorgan Mortgage Trust<br>6,500 % fällig am 25.07.2036                                       | 225            | 71                       | 0,03                              |
| HPS Corporate Lending Fund<br>5,950 % fällig am 14.04.2032                  | 200            | 199                      | 0,08                              | TopBuild Corp.<br>4,125 % fällig am 15.02.2032                                       | 500            | 464                      | 0,18                              | Lehman XS Trust<br>4,794 % fällig am 25.07.2037                                               | 239            | 219                      | 0,09                              |
| Hyatt Hotels Corp.<br>5,050 % fällig am 30.03.2028                          | 100            | 101                      | 0,04                              | Travel & Leisure Co.<br>6,625 % fällig am 31.07.2026                                 | 75             | 76                       | 0,03                              | 5,334 % fällig am 25.08.2047                                                                  | 151            | 135                      | 0,05                              |
| IHG Finance LLC<br>4,375 % fällig am 28.11.2029                             | € 100          | 123                      | 0,05                              | United Airlines Pass-Through Trust<br>5,875 % fällig am 15.04.2029                   | 40             | 41                       | 0,02                              | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust<br>3,368 % fällig am 25.11.2037                            | 181            | 126                      | 0,05                              |
| Ingevity Corp.<br>3,875 % fällig am 01.11.2028                              | \$ 675         | 644                      | 0,26                              | United Airlines, Inc.<br>4,375 % fällig am 15.04.2026                                | 900            | 895                      | 0,35                              | Residential Accredit Loans, Inc. Trust<br>4,784 % fällig am 25.08.2035                        | 16             | 13                       | 0,01                              |
| Invitation Homes Operating Partnership LP<br>2,700 % fällig am 15.01.2034   | 300            | 248                      | 0,10                              | UnitedHealth Group, Inc.<br>5,150 % fällig am 15.07.2034                             | 800            | 808                      | 0,32                              | 5,184 % fällig am 25.11.2036                                                                  | 425            | 318                      | 0,13                              |
| 5,450 % fällig am 15.08.2030                                                | 50             | 52                       | 0,02                              | Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>3,875 % fällig am 15.08.2029                    | 1.575          | 1.486                    | 0,59                              | 5,309 % fällig am 25.12.2035                                                                  | 13             | 12                       | 0,01                              |
| 5,500 % fällig am 15.08.2033                                                | 825            | 838                      | 0,33                              | 3,875 % fällig am 01.11.2033                                                         | 300            | 263                      | 0,10                              | 5,436 % fällig am 25.07.2035                                                                  | 1              | 1                        | 0,00                              |
| JPMorgan Chase & Co.<br>6,500 % fällig am 01.04.2030 (e)                    | 500            | 516                      | 0,20                              | 4,125 % fällig am 15.08.2031                                                         | 300            | 278                      | 0,11                              | Residential Asset Securitization Trust<br>5,750 % fällig am 25.03.2037                        | 228            | 66                       | 0,03                              |
| Kilroy Realty LP<br>3,050 % fällig am 15.02.2030                            | 400            | 362                      | 0,14                              | Vistra Operations Co. LLC<br>6,950 % fällig am 15.10.2033                            | 725            | 797                      | 0,32                              | 6,000 % fällig am 25.02.2036                                                                  | 322            | 123                      | 0,05                              |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>5,500 % fällig am 01.08.2030 (a)    | 300            | 302                      | 0,12                              | Volkswagen Group of America Finance LLC<br>4,950 % fällig am 25.03.2027              | 200            | 201                      | 0,08                              | 6,250 % fällig am 25.11.2036                                                                  | 484            | 176                      | 0,07                              |
| Las Vegas Sands Corp.<br>3,900 % fällig am 08.08.2029                       | 1.600          | 1.524                    | 0,60                              | Vornado Realty LP<br>2,150 % fällig am 01.06.2026                                    | 275            | 267                      | 0,11                              | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust<br>4,914 % fällig am 25.05.2037                | 66             | 58                       | 0,02                              |
| Leidos, Inc.<br>2,300 % fällig am 15.02.2031                                | 1.300          | 1.138                    | 0,45                              | Wells Fargo & Co.<br>5,198 % fällig am 23.01.2030                                    | 400            | 410                      | 0,16                              | Washington Mutual Mortgage Pass-Through<br>Certificates Trust<br>4,884 % fällig am 25.05.2035 | 1.025          | 863                      | 0,34                              |
| Mars, Inc.<br>4,800 % fällig am 01.03.2030                                  | 400            | 405                      | 0,16                              | Welltower OP LLC<br>4,500 % fällig am 01.12.2034                                     | £ 500          | 639                      | 0,25                              |                                                                                               |                | 6.192                    | 2,45                              |
| Marvell Technology, Inc.<br>5,750 % fällig am 15.02.2029                    | 120            | 125                      | 0,05                              | Weyerhaeuser Co.<br>4,000 % fällig am 15.04.2030                                     | \$ 500         | 488                      | 0,19                              | US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                                                                         |                |                          |                                   |
| Mattel, Inc.<br>3,375 % fällig am 01.04.2026                                | 900            | 889                      | 0,35                              | 7,375 % fällig am 15.03.2032                                                         | 1.625          | 1.223                    | 0,48                              | Freddie Mac<br>5,992 % fällig am 25.11.2055                                                   | 614            | 399                      | 0,16                              |
| MSCI, Inc.<br>3,625 % fällig am 01.11.2031                                  | 2.000          | 1.844                    | 0,73                              | Williams Cos., Inc.<br>5,150 % fällig am 15.03.2034                                  | 1.000          | 998                      | 0,40                              | Ginnie Mae, TBA<br>6,000 % fällig am 01.08.2055                                               | 400            | 405                      | 0,16                              |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029                                                | 100            | 97                       | 0,04                              |                                                                                      |                | 59.285                   | 23,49                             | Uniform Mortgage-Backed Security<br>3,000 % fällig am 01.05.2052                              | 89             | 77                       | 0,03                              |
| Mutual of Omaha Cos. Global Funding<br>5,800 % fällig am 27.07.2026         | 50             | 51                       | 0,02                              | NON-AGENCY-MBS                                                                       |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.08.2052                                                                  | 356            | 332                      | 0,13                              |
| Newfold Digital Holdings Group, Inc.<br>11,750 % fällig am 15.10.2028       | 100            | 76                       | 0,03                              | Banc of America Funding Trust<br>6,000 % fällig am 25.07.2037                        | 165            | 140                      | 0,06                              | 4,500 % fällig am 01.09.2052 -<br>01.12.2054                                                  | 2.585          | 2.501                    | 0,99                              |
| Newmark Group, Inc.<br>7,500 % fällig am 12.01.2029                         | 450            | 476                      | 0,19                              | BCAP LLC Trust<br>4,874 % fällig am 25.05.2047                                       | 133            | 121                      | 0,05                              | 5,000 % fällig am 01.09.2053                                                                  | 914            | 900                      | 0,36                              |
| Organon & Co.<br>2,875 % fällig am 30.04.2028                               | € 1.000        | 1.147                    | 0,45                              | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust<br>4,235 % fällig am 25.07.2036          | 34             | 29                       | 0,01                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>5,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055         | 11.400         | 11.171                   | 4,43                              |
| Pacific Gas & Electric Co.<br>2,500 % fällig am 01.02.2031                  | \$ 200         | 174                      | 0,07                              | Countryside Alternative Loan Trust<br>4,622 % fällig am 20.09.2046                   | 4              | 4                        | 0,00                              |                                                                                               |                | 15.785                   | 6,26                              |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047                                                | 425            | 300                      | 0,12                              | 4,814 % fällig am 25.09.2046                                                         | 4              | 4                        | 0,00                              | US-SCHATZobligationen                                                                         |                |                          |                                   |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030                                                | 100            | 98                       | 0,04                              | 5,500 % fällig am 25.12.2035                                                         | 264            | 133                      | 0,05                              | U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                                           | 5.098          | 4.964                    | 1,97                              |
| Pacific Life Global Funding<br>4,955 % fällig am 27.01.2028                 | 300            | 300                      | 0,12                              | 5,734 % fällig am 25.10.2035                                                         | 10             | 7                        | 0,00                              | U.S. Treasury Notes<br>3,875 % fällig am 30.04.2030                                           | 5.700          | 5.723                    | 2,26                              |
| PennyMac Financial Services, Inc.<br>7,875 % fällig am 15.12.2029           | 300            | 319                      | 0,13                              | 5,799 % fällig am 25.08.2035                                                         | 9              | 9                        | 0,00                              | 4,125 % fällig am 31.03.2031                                                                  | 7.400          | 7.495                    | 2,97                              |
| Permian Resources Operating LLC<br>5,375 % fällig am 15.01.2026             | 400            | 401                      | 0,16                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                                                         | 101            | 74                       | 0,03                              | 4,375 % fällig am 31.12.2029                                                                  | 17.600         | 18.041                   | 7,15                              |
| 6,250 % fällig am 01.02.2033                                                | 800            | 808                      | 0,32                              | 6,500 % fällig am 25.08.2037                                                         | 1.874          | 791                      | 0,31                              |                                                                                               |                | 36.223                   | 14,35                             |
| Piedmont Operating Partnership LP<br>2,750 % fällig am 01.04.2032           | 400            | 333                      | 0,13                              | 7,607 % fällig am 25.07.2035                                                         | 117            | 105                      | 0,04                              | Summe USA                                                                                     |                | 123.604                  | 48,98                             |
| PRA Health Sciences, Inc.<br>2,875 % fällig am 15.07.2026                   | 300            | 293                      | 0,12                              | 10,665 % fällig am 25.09.2037                                                        | 276            | 237                      | 0,09                              | AKTIEN                                                                                        |                |                          |                                   |
| Rocket Mortgage LLC<br>2,875 % fällig am 15.10.2026                         | 550            | 537                      | 0,21                              | Countryside Home Loan Mortgage Pass-Through Trust<br>4,157 % fällig am 25.09.2037    | 33             | 30                       | 0,01                              | INVESTMENTFONDS                                                                               |                |                          |                                   |
| San Diego Gas & Electric Co.<br>5,400 % fällig am 15.04.2035                | 300            | 306                      | 0,12                              | 5,750 % fällig am 25.07.2037                                                         | 7              | 3                        | 0,00                              | ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN                                                             |                |                          |                                   |
| Santander Holdings USA, Inc.<br>5,473 % fällig am 20.03.2029                | 50             | 51                       | 0,02                              | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.<br>6,000 % fällig am 25.09.2035 | 229            | 56                       | 0,02                              | PIMCO Select Funds plc -<br>PIMCO US Dollar Short-<br>Term Floating NAV                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Schlumberger Holdings Corp.<br>5,000 % fällig am 01.06.2034                 | 1.000          | 989                      | 0,39                              | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates<br>4,307 % fällig am 29.12.2037          | 587            | 305                      | 0,12                              | PIMCO Specialty Funds<br>Ireland p.l.c. - PIMCO<br>China Bond Fund (f)                        | 9.239          | 135                      | 0,05                              |
|                                                                             |                |                          |                                   | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust<br>6,000 % fällig am 25.07.2036 | 139            | 64                       | 0,03                              |                                                                                               |                | 135                      | 0,05                              |
|                                                                             |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.10.2021                                                         | 162            | 4                        | 0,00                              | BÖRSENGEHANDELTE FONDS                                                                        |                |                          |                                   |
|                                                                             |                |                          |                                   | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust<br>4,185 % fällig am 25.08.2035        | 10             | 9                        | 0,00                              | PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>US Dollar Short Maturity<br>UCITS ETF (f)                           | 4.000          | 401                      | 0,16                              |
|                                                                             |                |                          |                                   | 4,584 % fällig am 25.02.2047                                                         | 2.832          | 1.590                    | 0,63                              | Summe Investmentfonds                                                                         | \$             | 536                      | 0,21                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                     | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|-----------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                     | 4,480 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 18.200     | Ginnie Mae 4,000 % fällig am 20.01.2049             | \$ (20.064)                | \$ 18.200                      | \$ 18.202                                                      | 7,21                         |
| DEU                     | 4,470      | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 47.800        | U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig am<br>15.05.2040 | (49.259)                   | 47.800                         | 47.806                                                         | 18,94                        |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                     | \$ (69.323)                | \$ 66.000                      | \$ 66.008                                                      | 26,15                        |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                  | Long  | 03.2026     | 132                     | \$ 63                                           | 0,02                    |
| 3-Month SOFR December Futures                  | Long  | 03.2027     | 55                      | 93                                              | 0,04                    |
| 3-Month SOFR December Futures                  | Long  | 03.2028     | 63                      | 140                                             | 0,06                    |
| 3-Month SOFR June Futures                      | Long  | 09.2025     | 177                     | (114)                                           | (0,05)                  |
| 3-Month SOFR June Futures                      | Long  | 09.2026     | 166                     | 280                                             | 0,11                    |
| 3-Month SOFR June Futures                      | Long  | 09.2027     | 67                      | 123                                             | 0,05                    |
| 3-Month SOFR March Futures                     | Long  | 06.2026     | 166                     | 185                                             | 0,07                    |
| 3-Month SOFR March Futures                     | Long  | 06.2027     | 55                      | 94                                              | 0,04                    |
| 3-Month SOFR September Futures                 | Long  | 12.2026     | 17                      | (1)                                             | 0,00                    |
| 3-Month SOFR September Futures                 | Long  | 12.2027     | 109                     | 242                                             | 0,10                    |
| Euro-Bobl September Futures                    | Short | 09.2025     | 52                      | 33                                              | 0,01                    |
| Euro-Bund September Futures                    | Long  | 09.2025     | 1                       | (1)                                             | 0,00                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures    | Long  | 09.2025     | 230                     | 188                                             | 0,07                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures    | Long  | 09.2025     | 132                     | 158                                             | 0,06                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures   | Long  | 09.2025     | 100                     | 191                                             | 0,08                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures  | Short | 09.2025     | 10                      | (22)                                            | (0,01)                  |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2025     | 17                      | (84)                                            | (0,03)                  |
|                                                |       |             |                         | \$ 1.568                                        | 0,62                    |

### OPTIONSKAUF

#### FUTURE STYLED COMMODITY OPTIONS

| Beschreibung                                              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| Call - CME 3-Month SOFR Active Contract June 2026 Futures | \$ 97,500     | 12.06.2026    | 56                      | \$ 44  | \$ 24     | 0,01                    |
| Call - CME 3-Month SOFR Active Contract June 2026 Futures | 98,000        | 12.06.2026    | 58                      | 28     | 14        | 0,01                    |
|                                                           |               |               |                         | \$ 72  | \$ 38     | 0,02                    |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE STYLED COMMODITY OPTIONS

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|----------|-----------|-------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 4                       | \$ (1)   | \$ 0      | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000       | 25.07.2025    | 7                       | (3)      | 0         | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500       | 25.07.2025    | 4                       | (1)      | 0         | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250       | 25.07.2025    | 4                       | (1)      | (1)       | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000       | 25.07.2025    | 4                       | (2)      | (3)       | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500       | 25.07.2025    | 11                      | (4)      | (6)       | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750       | 25.07.2025    | 4                       | (1)      | (2)       | 0,00                    |
| Call - CME 3-Month SOFR Active Contract June 2026 Futures      | 98,500        | 12.06.2026    | 56                      | (15)     | (8)       | (0,01)                  |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250     | 25.07.2025    | 1                       | 0        | 0         | 0,00                    |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500       | 25.07.2025    | 1                       | 0        | 0         | 0,00                    |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | 129,000       | 25.07.2025    | 1                       | (1)      | 0         | 0,00                    |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500       | 25.07.2025    | 1                       | (1)      | 0         | 0,00                    |
|                                                                |               |               |                         | \$ (30)  | \$ (20)   | (0,01)                  |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                         | \$ 1.586 |           | 0,63                    |



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

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

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

| Referenzeinheit                  | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Airbus Finance BV                | (5,000) %                      | 20.12.2029       | € 500                     | \$ (20)                                         | (0,01)                  |
| Beazer Homes USA, Inc.           | (5,000)                        | 20.12.2029       | \$ 1.250                  | 27                                              | 0,01                    |
| Ford Motor Co.                   | (5,000)                        | 20.12.2029       | 3.500                     | 27                                              | 0,01                    |
| General Motors Co.               | (5,000)                        | 20.12.2029       | 2.000                     | 23                                              | 0,01                    |
| General Motors Co.               | (5,000)                        | 20.06.2030       | 3.300                     | (91)                                            | (0,03)                  |
| Jaguar Land Rover Automotive PLC | (5,000)                        | 20.12.2029       | € 800                     | (15)                                            | (0,01)                  |
| KB Home                          | (5,000)                        | 20.12.2029       | \$ 1.100                  | 7                                               | 0,00                    |
| LANXESS Deutschland GmbH         | (1,000)                        | 20.12.2029       | € 1.000                   | (3)                                             | 0,00                    |
| Lennar Corp.                     | (5,000)                        | 20.12.2029       | \$ 650                    | 11                                              | 0,01                    |
| Macy's Retail Holdings LLC       | (1,000)                        | 20.06.2030       | 1.200                     | (45)                                            | (0,02)                  |
| PulteGroup, Inc.                 | (5,000)                        | 20.12.2029       | 650                       | 8                                               | 0,00                    |
| Stellantis NV                    | (5,000)                        | 20.12.2029       | € 300                     | (2)                                             | 0,00                    |
| Target Corp.                     | (1,000)                        | 20.06.2030       | \$ 2.200                  | (8)                                             | 0,00                    |
| Toll Brothers Finance Corp.      | (1,000)                        | 20.12.2029       | 650                       | 1                                               | 0,00                    |
| Whirlpool Corp.                  | (1,000)                        | 20.12.2029       | 2.000                     | 32                                              | 0,01                    |
| Whirlpool Corp.                  | (1,000)                        | 20.06.2030       | 2.600                     | (62)                                            | (0,02)                  |
|                                  |                                |                  |                           | \$ (110)                                        | (0,04)                  |

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

| Referenzeinheit              | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| AT&T, Inc.                   | 1,000 %                        | 20.06.2027       | \$ 100                    | \$ 2                                            | 0,00                    |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                          | 20.06.2028       | 100                       | 2                                               | 0,00                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.    | 1,000                          | 20.06.2026       | 300                       | 0                                               | 0,00                    |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                          | 20.12.2025       | € 200                     | 0                                               | 0,00                    |
| T-Mobile USA, Inc.           | 5,000                          | 20.06.2028       | \$ 300                    | (11)                                            | 0,00                    |
| Telefonica Europe BV         | 1,000                          | 20.06.2030       | € 1.900                   | 0                                               | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                          | 20.12.2028       | \$ 100                    | 2                                               | 0,00                    |
| Électricité de France        | 1,000                          | 20.06.2030       | € 2.000                   | 9                                               | 0,00                    |
|                              |                                |                  |                           | \$ 4                                            | 0,00                    |

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

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 8.600                  | \$ 119                                          | 0,05                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 128.200                   | 614                                             | 0,24                    |
|                        |                                |                  |                           | \$ 733                                          | 0,29                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 4.590    | \$ 40                                           | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2055       | 100        | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 18.06.2030       | \$ 2.800   | (17)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 19.03.2035       | 16.000     | (458)                                           | (0,18)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,281           | 15.02.2040       | 9.200      | (212)                                           | (0,08)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500           | 18.12.2054       | 600        | 10                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,514           | 04.09.2034       | 40         | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,525           | 04.09.2034       | 200        | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,555           | 28.08.2034       | 200        | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,620           | 30.11.2029       | 3.365      | (31)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,642           | 15.02.2055       | 100        | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,655           | 15.02.2055       | 100        | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 15.05.2032       | 1.213      | (17)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 20.06.2034       | 3.000      | (14)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,807           | 15.02.2055       | 100        | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,842           | 04.03.2030       | 300        | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,874           | 05.03.2035       | 200        | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,884           | 25.03.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,899           | 11.03.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,900           | 15.02.2035       | 3.592      | (63)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,901           | 15.02.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,905           | 12.03.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,930           | 24.03.2035       | 400        | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,975           | 21.03.2035       | 200        | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,994           | 02.07.2034       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,080           | 05.06.2034       | 1.500      | (22)                                            | (0,01)                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI         | 12,030 %        | 04.01.2027       | BRL 7.400  | \$ (33)                                         | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI         | 13,402          | 02.01.2029       | 13.500     | 20                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI         | 13,926          | 04.01.2027       | 24.500     | (13)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW   | 4,250           | 19.03.2030       | AUD 7.100  | 85                                              | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 0,000           | 17.03.2053       | € 440      | 239                                             | 0,09                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250           | 17.09.2030       | 4.510      | 57                                              | 0,02                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250           | 17.09.2055       | 2.330      | 90                                              | 0,04                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,450           | 05.05.2035       | 100        | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIE         | 7,582           | 02.04.2030       | MXN 6.900  | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIE         | 7,768           | 12.06.2030       | 5.800      | (1)                                             | 0,00                    |
|                                                |                        |                 |                  |            | \$ (347)                                        | (0,14)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                 |                  |            | \$ 280                                          | 0,11                    |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-<br>verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                    | 0,850 %       | 20.08.2025    | 29.930                    | \$ 110 | \$ 6      | 0,00                    |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                    | 0,775         | 16.07.2025    | 32.000                    | 107    | 2         | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                    | 0,825         | 20.08.2025    | 30.200                    | 112    | 6         | 0,00                    |
|            |                                  |                         |               |               |                           | \$ 329 | \$ 14     | 0,00                    |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| BPS        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 2,500 %       | 29.04.2026    | 8.800                     | \$ 41  | \$ 26     | 0,01                    |
| FAR        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 2,000         | 29.04.2026    | 10.200                    | 28     | 16        | 0,01                    |
|            |                                      |                        |                                             |               |               |                           | \$ 69  | \$ 42     | 0,02                    |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-<br>verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %       | 16.07.2025    | 300                       | \$ (1)  | \$ 0      | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 700                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000         | 16.07.2025    | 300                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850         | 16.07.2025    | 300                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 300                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            |                                  |                         |               |               |                           | \$ (2)  | \$ 0      | 0,00                    |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,555 %       | 24.07.2025    | 200                       | \$ (1)  | \$ (1)    | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,637         | 18.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,700         | 21.07.2025    | 200                       | (1)     | (2)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,770         | 09.07.2025    | 200                       | (1)     | (2)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,905         | 24.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| BPS<br>CBK | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,037 %       | 18.07.2025    | 200\$                     | (1)     | \$ 0      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050         | 21.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120         | 09.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 1,500         | 29.04.2026    | 8.800                     | (12)    | (7)       | (0,01)                  |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564         | 24.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605         | 23.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914         | 24.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955         | 23.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380         | 03.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460         | 16.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
| FAR        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640         | 03.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720         | 16.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,750         | 03.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,790         | 09.07.2025    | 200                       | (1)     | (2)       | 0,00                    |
| GLM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,100         | 03.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,140         | 09.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525         | 28.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583         | 23.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653         | 14.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680         | 07.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695         | 17.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775         | 07.07.2025    | 200                       | (1)     | (2)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875         | 28.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933         | 23.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030         | 07.07.2025    | 100                       | 1       | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053         | 14.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095         | 17.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125         | 07.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772         | 10.07.2025    | 200                       | (1)     | (2)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122         | 10.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664         | 14.07.2025    | 300                       | (1)     | (2)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669         | 07.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697         | 16.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715         | 02.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725         | 03.07.2025    | 200                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019         | 07.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064         | 14.07.2025    | 300                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065         | 02.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075         | 03.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097         | 16.07.2025    | 200                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | \$ (40) | \$ (32)   | (0,01)                  |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           |         |           |                         |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           |         |           |                         |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           |         |           |                         |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | \$ 92,469     | 07.07.2025    | 100                       | \$ (1)  | \$ 0      | 0,00                    |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469        | 07.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            |                                                                               |               |               |                           | \$ (1)  | \$ 0      | 0,00                    |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit      | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| GST        | Petroleos Mexicanos  | 4,850 %                        | 07.05.2026       | \$ 192                    | \$ 0                                         | \$ 2                                            | \$ 2      | 0,00                    |
|            | SoftBank Group Corp. | 1,000                          | 20.06.2026       | 1.000                     | (8)                                          | 4                                               | (4)       | 0,00                    |
|            |                      |                                |                  |                           | \$ (8)                                       | \$ 6                                            | \$ (2)    | 0,00                    |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu zahlende | Zu erhaltende<br>Währung | Zu erhaltende | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|-------------|--------------------------|---------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | 1.067       | \$                       | 148           | \$ 0                             | (1)                                | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 230         |                          | 265           | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 265         | AUD                      | 408           | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.478       | £                        | 1.077         | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 408         | \$                       | 265           | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 1.506       |                          | 209           | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 1.077       |                          | 1.478         | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 130         | €                        | 111           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 20.520      | \$                       | 23.332        | 0                                | (756)                              | (756)                                                | (0,30)                  |
|            | 07.2025          | IDR                    | 2.003.711   |                          | 123           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 80          | KRW                      | 109.034       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 10          | \$                       | 0             | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 121         | CNH                      | 868           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 8           | TWD                      | 249           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 4.794       | \$                       | 118           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 1.751       |                          | 54            | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | \$                     | 11          | IDR                      | 185.936       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 27          | THB                      | 908           | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 388         | \$                       | 54            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PEN                    | 385         |                          | 104           | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 2.505       |                          | 77            | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 121         | CNH                      | 865           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 1.222       | \$                       | 1.389         | 0                                | (46)                               | (46)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 171         |                          | 231           | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | PLN                    | 19          |                          | 5             | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 1.958       |                          | 49            | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 232         | €                        | 201           | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.061       | £                        | 3.720         | 37                               | 0                                  | 37                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 4           | ¥                        | 528           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 126         | TRY                      | 5.150         | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 22.261      | \$                       | 1.232         | 0                                | (19)                               | (19)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | £                      | 3.720       |                          | 5.062         | 0                                | (37)                               | (37)                                                 | (0,01)                  |
| CBK        | 08.2025          | \$                     | 48          | TRY                      | 1.981         | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 2.339       | \$                       | 640           | 0                                | (17)                               | (17)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNY                    | 1.855       |                          | 259           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 1.020       |                          | 1.168         | 0                                | (30)                               | (30)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 277.738     |                          | 202           | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 243         |                          | 189           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 3.071       |                          | 94            | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.129       | €                        | 986           | 29                               | 0                                  | 29                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 44          | IDR                      | 711.682       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 114         | KRW                      | 156.839       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 18          | PEN                      | 64            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 14          | THB                      | 474           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 298         | TWD                      | 8.851         | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 339         | \$                       | 47            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 194         |                          | 2             | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 4.902       |                          | 150           | 0                                | (20)                               | (20)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 34          | CNH                      | 244           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 15          | INR                      | 1.260         | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 13          | PEN                      | 46            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 2.379       | \$                       | 647           | 0                                | (22)                               | (22)                                                 | (0,01)                  |
|            | 10.2025          |                        | 654         |                          | 179           | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 12.2025          |                        | 367         |                          | 99            | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 26.479      | €                        | 22.825        | 315                              | 0                                  | 315                                                  | 0,12                    |
|            | 08.2025          | €                      | 22.775      | \$                       | 26.479        | 0                                | (314)                              | (314)                                                | (0,12)                  |
| DUB        | 08.2025          | INR                    | 197         |                          | 2             | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 0           | MXN                      | 4             | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 408         | \$                       | 263           | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 633         |                          | 115           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 38          |                          | 46            | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 543         |                          | 76            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 189.104     |                          | 1.299         | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 110         | BRL                      | 631           | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          |                        | 47          | CHF                      | 38            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.030       | ¥                        | 291.239       | 0                                | (14)                               | (14)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          |                        | 36          | PLN                      | 131           | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 38          | \$                       | 47            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 410         |                          | 57            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.299       | ¥                        | 188.409       | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 3.027       | \$                       | 155           | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 115         | BRL                      | 642           | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 09.2025          |                        | 1           | PEN                      | 5             | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 354         | \$                       | 11            | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 10          | IDR                      | 168.816       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 207         | \$                       | 56            | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 1.028       |                          | 142           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 205         |                          | 54            | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 1.772       |                          | 54            | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 71          | CAD                      | 97            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          |                        | 64          | PLN                      | 237           | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| MBC        | 07.2025          | \$                     | SGD                      | 71                               | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | TWD                      | 1.185                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | ZAR                    |                          | 353                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | CNH                    |                          | 193                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 83                               | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 576                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | CAD                    | \$                       | 620                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | CNH                    |                          | 68                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | €                      |                          | 1.311                            | 0                                  | (17)                                                 | (0,01)                  |        |
|            | 07.2025          | £                      |                          | 1.480                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | PLN                    |                          | 39                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | TWD                    |                          | 27                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | \$                     | CAD                      | 755                              | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | €                        | 111                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | £                        | 300                              | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | ¥                        | 12.775                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | SGD                      | 172                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | MYI              | 07.2025                |                          | THB                              | 605                                | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                        | TWD                      | 1.006                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  | CAD                    | \$                       | 549                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  | CNH                    |                          | 79                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  | TWD                    |                          | 40                               | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | ¥                      |                          | 410                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | \$                     | €                        | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | ¥                        | 6.579                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | PLN                      | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  | CNH                    | \$                       | 58                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  | \$                     | ¥                        | 59.632                           | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  |                        | CNH                      | 403                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | CNY                      | 1.859                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | IDR                      | 785.102                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | ¥                        | 43.200                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | TWD                      | 8.891                            | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| RYL<br>SCX |                  | 08.2025                | CNH                      | \$                               | 101                                | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            |                  | 08.2025                | CNY                      |                                  | 260                                | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 24                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 1.668                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | ¥                      | \$                       | 61                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | \$                     | ¥                        | 8.708                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | £                      | \$                       | 5.212                            | 0                                  | (64)                                                 | (0,03)                  |        |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 11.2025          | PEN                    |                          | 157                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | THB                    |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | \$                     | ¥                        | 4.293                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | CNH                    | \$                       | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | ¥                      |                          | 697                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | \$                     | ¥                        | 100.052                          | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$ 455                             | \$ (1.503)                                           | \$ (1.048)              | (0,42) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat |     | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|-----|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF | 3.596                  | \$ 4.502                 | \$ 0                             | \$ (15)                            | \$ (15)                                              | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$  | 4.502                  | CHF 3.581                | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,01                    |
| BOA        | 07.2025          |     | 95                     | 78                       | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |     | 118                    | 97                       | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | CHF | 3.571                  | \$ 4.460                 | 0                                | (26)                               | (26)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$  | 4.295                  | CHF 3.537                | 148                              | 0                                  | 148                                                  | 0,06                    |
|            | 08.2025          |     | 4.460                  | 3.556                    | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,01                    |
| MBC        | 07.2025          |     | 4.305                  | 3.537                    | 139                              | 0                                  | 139                                                  | 0,06                    |
| RBC        | 07.2025          |     | 4.008                  | 3.287                    | 122                              | 0                                  | 122                                                  | 0,05                    |
|            |                  |     |                        |                          | \$ 456                           | \$ (41)                            | \$ 415                                               | 0,17                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | 21.688                   | \$ 25.394                        | \$ 0                               | \$ (65)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 23.614                   | € 20.783                         | 782                                | 782                                                  | 0,31                    |
|            | 08.2025          |                        | 25.450                   | 21.688                           | 64                                 | 64                                                   | 0,03                    |
| BOA        | 07.2025          |                        | 25.396                   | 22.335                           | 821                                | 821                                                  | 0,33                    |
| BPS        | 07.2025          | €                      | 23                       | \$ 27                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 135                      | € 119                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        | 25.721                   | 22.647                           | 863                                | 863                                                  | 0,34                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| CBK        | 07.2025          | € 121               | \$ 139                | \$ 0                          | \$ (3)                          | \$ (3)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 189              | € 165                 | 5                             | 0                               | 5                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 21.693            | \$ 25.166             | 0                             | (297)                           | (297)                                         | (0,12)               |
|            | 08.2025          | \$ 25.166           | € 21.645              | 298                           | 0                               | 298                                           | 0,12                 |
| MBC        | 07.2025          | € 2.931             | \$ 3.400              | 0                             | (41)                            | (41)                                          | (0,02)               |
|            | 07.2025          | \$ 617              | € 538                 | 15                            | 0                               | 15                                            | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 2.853                      | \$ (406)                        | \$ 2.447                                      | 0,97                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD                              | 07.2025          | £ 69                | \$ 94                 | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                          | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$ 94               | £ 69                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BRC                              | 07.2025          | £ 69                | \$ 94                 | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 92               | £ 68                  | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | 94                  | 69                    | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| JPM                              | 07.2025          | 92                  | 68                    | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
| MBC                              | 07.2025          | £ 0                 | \$ 0                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 89               | £ 66                  | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
|                                  |                  |                     |                       | \$ 5                          | \$ (1)                          | \$ 4                                          | 0,00                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 1.840                                      | 0,73                 |
| Summe Anlagen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 258.094                                    | 102,27               |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ (5.722)                                    | (2,27)               |
| Nettovermögen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 252.372                                    | 100,00               |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,20 %):

| Emittentenbeschreibung  | Kaufdatum  | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-------------------------|------------|--------|-----------|----------------------|
| Intelsat Emergence S.A. | 12.11.2019 | \$ 750 | \$ 259    | 0,10                 |

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 1.634 USD (31. Dezember 2024: 1.214 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 7.841 USD (31. Dezember 2024: 2.192 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 190 USD (31. Dezember 2024: 610 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                               | \$ 187.102                                                | \$ 750                                                 | \$ 187.852 |
| Investmentfonds               | 536                                                                | 0                                                         | 0                                                      | 536        |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                  | 66.000                                                    | 0                                                      | 66.000     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 30                                                                 | 3.676                                                     | 0                                                      | 3.706      |
| Summen                        | \$ 566                                                             | \$ 256.778                                                | \$ 750                                                 | \$ 258.094 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                     | \$ 129.031                                                      | \$ 903                                                       | \$ 129.934 |
| Investmentfonds               | 11.774                                                                   | 401                                                             | 0                                                            | 12.175     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 11                                                                       | 129                                                             | 0                                                            | 140        |
| Summen                        | \$ 11.785                                                                | \$ 129.561                                                      | \$ 903                                                       | \$ 142.249 |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                | 4,300 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (513)     | \$ (513)                                    | (0,20)                  |
| BPS                                | 4,500      | 15.01.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (281)        | (287)                                       | (0,11)                  |
| BRC                                | 1,250      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (189)      | (222)                                       | (0,09)                  |
|                                    | 1,350      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (292)        | (343)                                       | (0,14)                  |
|                                    | 1,400      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (201)        | (236)                                       | (0,09)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (1.601)                                  | (0,63)                  |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 773                              | \$ (670)                              | \$ 103                          | \$ (1)                              | \$ 0                                  | \$ (1)                          |
| BOA        | 62                                  | 0                                     | 62                              | 4                                   | 0                                     | 4                               |
| BPS        | 4                                   | 0                                     | 4                               | 59                                  | 0                                     | 59                              |
| BRC        | 785                                 | (530)                                 | 255                             | 22                                  | 0                                     | 22                              |
| CBK        | (55)                                | 0                                     | (55)                            | 8                                   | 0                                     | 8                               |
| DUB        | 2                                   | 0                                     | 2                               | (295)                               | 260                                   | (35)                            |
| FAR        | 146                                 | 0                                     | 146                             | 13                                  | 0                                     | 13                              |
| GLM        | (3)                                 | 0                                     | (3)                             | (9)                                 | 0                                     | (9)                             |
| GST        | (2)                                 | 0                                     | (2)                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| JPM        | (22)                                | 190                                   | 168                             | (28)                                | 0                                     | (28)                            |
| MBC        | 94                                  | 0                                     | 94                              | (137)                               | 0                                     | (137)                           |
| MYC        | (6)                                 | 0                                     | (6)                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| MYI        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (1)                                 | 0                                     | (1)                             |
| RBC        | 130                                 | 0                                     | 130                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| RYL        | 1                                   | 0                                     | 1                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| SCX        | 1                                   | 0                                     | 1                               | (459)                               | 350                                   | (109)                           |
| SOG        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (1)                                 | 0                                     | (1)                             |
| SSB        | (70)                                | 0                                     | (70)                            | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| UAG        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (1)                                 | 0                                     | (1)                             |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 41,41             | 33,54             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 24,37             | 41,85             |
| Investmentfonds                                                        | 0,19              | 7,07              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 23,11             | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,64              | 0,25              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,51              | 0,53              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,34              | 0,17              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 8,43              | 16,59             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Argentinien                                                                            | 0,15              | 0,41              |
| Australien                                                                             | 0,08              | 1,61              |
| Österreich                                                                             | 0,48              | 0,32              |
| Belgien                                                                                | 0,09              | 0,39              |
| Bermuda                                                                                | 0,12              | 0,60              |
| Brasilien                                                                              | 0,16              | k. A.             |
| Kanada                                                                                 | 1,09              | 0,43              |
| Kaimaninseln                                                                           | 0,41              | 1,40              |
| China                                                                                  | 0,00              | 0,00              |
| Tschechische Republik                                                                  | 0,73              | 0,24              |
| Dänemark                                                                               | 0,64              | k. A.             |
| Frankreich                                                                             | 1,91              | 2,53              |
| Deutschland                                                                            | 1,78              | 0,17              |
| Irland                                                                                 | k. A.             | 0,17              |
| International                                                                          | 0,01              | k. A.             |
| Italien                                                                                | 1,50              | 2,15              |
| Japan                                                                                  | 0,59              | k. A.             |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 0,18              | 0,15              |
| Liberia                                                                                | 0,96              | 0,87              |
| Luxemburg                                                                              | 0,59              | 0,94              |
| Mexiko                                                                                 | 0,07              | 1,34              |
| Multinational                                                                          | 0,88              | 0,91              |
| Niederlande                                                                            | 1,13              | 2,14              |
| Norwegen                                                                               | 0,13              | 0,45              |
| Panama                                                                                 | 1,20              | 0,98              |
| Peru                                                                                   | 0,74              | 0,61              |
| Polen                                                                                  | 0,22              | k. A.             |
| Rumänien                                                                               | 0,10              | k. A.             |
| Slowakei                                                                               | k. A.             | 0,48              |
| Südafrika                                                                              | 0,72              | 0,85              |
| Spanien                                                                                | 0,80              | 0,48              |
| Schweden                                                                               | k. A.             | 0,17              |
| Schweiz                                                                                | 1,63              | 0,88              |
| Großbritannien                                                                         | 6,37              | 4,41              |
| USA                                                                                    | 48,98             | 77,43             |
| Jungferninseln (Britisch)                                                              | k. A.             | 0,05              |
| Investmentfonds                                                                        | 0,21              | 9,70              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 26,15             | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,62              | 0,17              |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,02              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | (0,01)            | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | (0,04)            | 0,01              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,03              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,29              | 0,01              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,14)            | 0,55              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | 0,01              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,02              | 0,00              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | k. A.             |
| Total Return Swaps auf Indizes                                                         | k. A.             | (0,03)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,42)            | 0,27              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,14              | (0,89)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (2,27)            | (13,37)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

Halbjahresbericht | 30. Juni 2025 211

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS<br>% DES | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS<br>% DES | BESCHREIBUNG                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS<br>% DES |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,171 % fällig am 05.03.2031                         | \$ 7.200       | 7.343                    | 0,08                              | <b>TSchechische Republik</b>                            |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.10.2029                                     | \$ 500         | 415                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.10.2028                         | 13.300         | 13.850                   | 0,14                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | 8,125 % fällig am 01.02.2027                                     | 5.000          | 4.504                    | 0,05                              |
| <b>TIB Diversified Payment Rights Finance Co.</b>    |                |                          |                                   | <b>EP Infrastructure A/S</b>                            |                |                          |                                   | 11,500 % fällig am 01.02.2027 (j)                                | € 6.570        | 7.471                    | 0,08                              |
| 7,226 % fällig am 15.11.2034                         | 7.400          | 7.402                    | 0,08                              | 2,045 % fällig am 09.10.2028                            | € 5.500        | \$ 6.202                 | 0,06                              | <b>BNP Paribas S.A.</b>                                          |                |                          |                                   |
| <b>Trafford Centre Finance Ltd.</b>                  |                |                          |                                   | <b>EPH Financing International A/S</b>                  |                |                          |                                   | 5,497 % fällig am 20.05.2030                                     | \$ 5.200       | 5.341                    | 0,05                              |
| 5,126 % fällig am 28.07.2038                         | £ 3.700        | 4.715                    | 0,05                              | 5,875 % fällig am 30.11.2029                            | 4.950          | 6.216                    | 0,07                              | 5,738 % fällig am 20.02.2035                                     | 5.000          | 5.181                    | 0,05                              |
| <b>VD DPR Finance Co.</b>                            |                |                          |                                   | Summe Tschechische Republik                             |                | 12.418                   | 0,13                              | 5,786 % fällig am 13.01.2033                                     | 15.400         | 16.030                   | 0,16                              |
| 6,833 % fällig am 15.03.2035                         | \$ 13.300      | 13.039                   | 0,13                              | <b>DÄNEMARK</b>                                         |                |                          |                                   | <b>BPCE S.A.</b>                                                 |                |                          |                                   |
| <b>Wynn Macau Ltd.</b>                               |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | 5,876 % fällig am 14.01.2031                                     | 3.700          | 3.839                    | 0,04                              |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026                         | 3.900          | 3.904                    | 0,04                              | <b>H Lundbeck A/S</b>                                   |                |                          |                                   | 6,714 % fällig am 19.10.2029 (k)                                 | 7.000          | 7.416                    | 0,08                              |
| 5,625 % fällig am 26.08.2028                         | 1.700          | 1.672                    | 0,02                              | 3,375 % fällig am 02.06.2029                            | 4.700          | 5.546                    | 0,06                              | 7,003 % fällig am 19.10.2034                                     | 5.000          | 5.496                    | 0,06                              |
|                                                      |                | 172.518                  | 1,77                              | <b>TDC Net A/S</b>                                      |                |                          |                                   | <b>CMA CGM S.A.</b>                                              |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | 5,056 % fällig am 31.05.2028                            | 12.000         | 14.702                   | 0,15                              | 5,000 % fällig am 15.01.2031                                     | € 4.600        | 5.403                    | 0,06                              |
| <b>RAK Capital</b>                                   |                |                          |                                   | Summe Dänemark                                          |                | 20.248                   | 0,21                              | <b>Credit Agricole S.A.</b>                                      |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 12.03.2035                         | 6.625          | 6.719                    | 0,07                              | <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                          |                |                          |                                   | 5,862 % fällig am 09.01.2036                                     | \$ 2.400       | 2.489                    | 0,03                              |
| Summe Kaimaninseln                                   |                | 194.931                  | 2,00                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Crown European Holdings SACA</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>CHILE</b>                                         |                |                          |                                   | <b>Dominican Republic Government International Bond</b> |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.01.2030                                     | € 1.700        | 2.067                    | 0,02                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.02.2048 (k)                        | \$ 30.900      | 29.316                   | 0,30                              | <b>Electricite de France S.A.</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.</b> |                |                          |                                   | 6,950 % fällig am 15.03.2037                            | 9.700          | 9.877                    | 0,10                              | 4,500 % fällig am 21.09.2028                                     | \$ 5.700       | 5.696                    | 0,06                              |
| 3,634 % fällig am 07.05.2030 (k)                     | 3.800          | 3.613                    | 0,04                              | Summe Dominikanische Republik                           |                | 39.193                   | 0,40                              | 4,875 % fällig am 21.09.2038                                     | 3.000          | 2.776                    | 0,03                              |
| <b>Empresa Nacional del Petroleo</b>                 |                |                          |                                   | <b>ECUADOR</b>                                          |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 25.01.2053                                     | £ 1.600        | 1.865                    | 0,02                              |
| 5,950 % fällig am 30.07.2034                         | 2.500          | 2.532                    | 0,03                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 22.04.2064                                     | \$ 6.700       | 6.353                    | 0,06                              |
| <b>GNL Quintero S.A.</b>                             |                |                          |                                   | <b>Ecuador Government International Bond</b>            |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 13.01.2055                                     | 8.700          | 8.737                    | 0,09                              |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029                         | 2.224          | 2.207                    | 0,02                              | 0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)                        | 21.275         | 15.510                   | 0,16                              | 9,125 % fällig am 15.03.2033 (g)                                 | 12.600         | 14.243                   | 0,15                              |
| <b>Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.</b>       |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 31.07.2040                            | 14.324         | 9.053                    | 0,09                              | <b>ELO SACA</b>                                                  |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 10.09.2034                         | 9.100          | 8.866                    | 0,09                              | 5,500 % fällig am 31.07.2035                            | 9.612          | 7.021                    | 0,07                              | 3,250 % fällig am 23.07.2027                                     | € 1.800        | 2.041                    | 0,02                              |
|                                                      |                | 17.218                   | 0,18                              | 6,900 % fällig am 31.07.2030                            | 12.797         | 11.133                   | 0,12                              | 4,875 % fällig am 08.12.2028                                     | 7.900          | 8.426                    | 0,09                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | Summe Ecuador                                           |                | 42.717                   | 0,44                              | 6,000 % fällig am 22.03.2029                                     | 1.300          | 1.425                    | 0,01                              |
| <b>Chile Government International Bond</b>           |                |                          |                                   | <b>ÄGYPTEN</b>                                          |                |                          |                                   | <b>Eramet S.A.</b>                                               |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 14.01.2032                         | € 13.650       | 16.342                   | 0,17                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 30.11.2029 (k)                                 | 7.500          | 8.788                    | 0,09                              |
| 3,875 % fällig am 09.07.2031                         | 7.000          | 8.454                    | 0,09                              | <b>Egypt Government International Bond</b>              |                |                          |                                   | <b>New Immo Holding S.A.</b>                                     |                |                          |                                   |
| 4,850 % fällig am 22.01.2029                         | \$ 33.000      | 33.520                   | 0,34                              | 6,375 % fällig am 11.04.2031                            | € 20.150       | 21.999                   | 0,23                              | 2,750 % fällig am 26.11.2026                                     | 200            | 232                      | 0,00                              |
|                                                      |                | 58.316                   | 0,60                              | 7,500 % fällig am 16.02.2061                            | \$ 36.675      | 26.745                   | 0,27                              | <b>Opal Bidco S.A.S.</b>                                         |                |                          |                                   |
| Summe Chile                                          |                | 75.534                   | 0,78                              | 8,500 % fällig am 31.01.2047                            | 9.500          | 7.721                    | 0,08                              | 5,500 % fällig am 31.03.2032                                     | 11.100         | 13.323                   | 0,14                              |
| <b>CHINA</b>                                         |                |                          |                                   | 8,625 % fällig am 04.02.2030                            | 6.900          | 6.984                    | 0,07                              | <b>Renault S.A.</b>                                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | 9,450 % fällig am 04.02.2033 (k)                        | 5.400          | 5.471                    | 0,06                              | 2,375 % fällig am 25.05.2026                                     | 14.800         | 17.297                   | 0,18                              |
| <b>Yango Justice International Ltd.</b>              |                |                          |                                   | 21,954 % fällig am 04.03.2028                           | EGP 1.195.700  | 23.806                   | 0,24                              | <b>TDF Infrastructure SASU</b>                                   |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^                       | 28.200         | 48                       | 0,00                              | Summe Ägypten                                           |                | 92.726                   | 0,95                              | 1,750 % fällig am 01.12.2029                                     | 25.100         | 27.687                   | 0,28                              |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^                       | 19.100         | 97                       | 0,00                              | <b>EL SALVADOR</b>                                      |                |                          |                                   | <b>Ubisoft Entertainment S.A.</b>                                |                |                          |                                   |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^                       | 19.800         | 101                      | 0,00                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | 0,878 % fällig am 24.11.2027 (k)                                 | 6.000          | 6.356                    | 0,06                              |
| Summe China                                          |                | 246                      | 0,00                              | <b>EI Salvador Government International Bond</b>        |                |                          |                                   | <b>Viridien</b>                                                  |                |                          |                                   |
| <b>KOLUMBIEN</b>                                     |                |                          |                                   | 7,650 % fällig am 15.06.2035                            | \$ 494         | 479                      | 0,01                              | 10,000 % fällig am 15.10.2030                                    | \$ 9.800       | 9.651                    | 0,10                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 10.04.2032                            | 4.000          | 4.062                    | 0,04                              |                                                                  |                | 219.713                  | 2,26                              |
| <b>Ecopetrol S.A.</b>                                |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 17.04.2030                            | 5.025          | 5.333                    | 0,05                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                        |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045                         | 200            | 138                      | 0,00                              | 9,650 % fällig am 21.11.2054                            | 6.250          | 6.453                    | 0,07                              | <b>Altice France S.A.</b>                                        |                |                          |                                   |
| 7,750 % fällig am 01.02.2032                         | 11.875         | 11.678                   | 0,12                              | Summe El Salvador                                       |                | 16.327                   | 0,17                              | 9,756 % fällig am 15.08.2028                                     | 5.098          | 4.631                    | 0,05                              |
|                                                      |                | 11.816                   | 0,12                              | <b>FINNLAND</b>                                         |                |                          |                                   | Summe Frankreich                                                 |                | 225.819                  | 2,32                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | <b>GABUN</b>                                                     |                |                          |                                   |
| <b>Colombia Government International Bond</b>        |                |                          |                                   | <b>Balder Finland Oy</b>                                |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                          |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.03.2029                         | 12.100         | 11.515                   | 0,12                              | 1,000 % fällig am 18.01.2027                            | € 200          | 228                      | 0,00                              | <b>Gabon Government International Bond</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045                         | 47.120         | 31.900                   | 0,33                              | 1,000 % fällig am 20.01.2029                            | 300            | 326                      | 0,01                              | 9,500 % fällig am 18.02.2029                                     | 12.825         | 11.749                   | 0,12                              |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044                         | 3.100          | 2.299                    | 0,02                              | 1,375 % fällig am 24.05.2030                            | 4.900          | 5.174                    | 0,05                              | <b>DEUTSCHLAND</b>                                               |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 14.11.2035                         | 8.500          | 8.558                    | 0,09                              | 2,000 % fällig am 18.01.2031                            | 300            | 321                      | 0,00                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                          |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 25.04.2035                         | 6.300          | 6.552                    | 0,07                              | Summe Finnland                                          |                | 6.049                    | 0,06                              | <b>Cordia Finanz GmbH</b>                                        |                |                          |                                   |
|                                                      |                | 60.824                   | 0,63                              | <b>FRANKREICH</b>                                       |                |                          |                                   | 9,375 % fällig am 03.10.2031                                     | 5.000          | 5.195                    | 0,05                              |
| Summe Kolumbien                                      |                | 72.640                   | 0,75                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                 |                |                          |                                   | <b>Cheplapharm Arzneimittel GmbH</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>COSTA RICA</b>                                    |                |                          |                                   | <b>FCT Ponant</b>                                       |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.01.2028                                     | 1.000          | 967                      | 0,01                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | 2,564 % fällig am 27.09.2038                            | 1.255          | 1.475                    | 0,01                              | 7,125 % fällig am 15.06.2031 (a)                                 | € 2.900        | 3.431                    | 0,04                              |
| <b>Costa Rica Government International Bond</b>      |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 15.05.2030                                     | 425            | 510                      | 0,01                              |
| 7,300 % fällig am 13.11.2054                         | 5.100          | 5.295                    | 0,05                              | <b>Altice France S.A.</b>                               |                |                          |                                   | <b>Deutsche Bank AG</b>                                          |                |                          |                                   |
| <b>ZYPERN</b>                                        |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.07.2029                            | 5.175          | 5.109                    | 0,05                              | 3,742 % fällig am 07.01.2033                                     | \$ 1.725       | 1.553                    | 0,02                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.10.2029                            | 11.800         | 11.657                   | 0,12                              | 5,882 % fällig am 08.07.2031                                     | 23.775         | 24.417                   | 0,25                              |
| <b>Atrium Finance PLC</b>                            |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 15.01.2029                            | \$ 2.100       | 1.737                    | 0,02                              | <b>DVI Deutsche Vermoögens- &amp; Immobilienverwaltungs GmbH</b> |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027                         | € 9.900        | 10.699                   | 0,11                              | 5,125 % fällig am 15.07.2029                            | 800            | 662                      | 0,01                              | 4,875 % fällig am 21.08.2030                                     | € 4.500        | 5.371                    | 0,05                              |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | <b>IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % bar oder 7,500 % PIK)</b>       |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.11.2029 (b)                                 | 9.300          | 11.434                   | 0,12                              |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | <b>Nidda Healthcare Holding GmbH</b>                             |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 21.02.2030                                     | 5.055          | 6.061                    | 0,06                              |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | <b>Volkswagen Bank GmbH</b>                                      |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 31.07.2026                                     | 15.800         | 18.535                   | 0,19                              |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | <b>Volkswagen Leasing GmbH</b>                                   |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 11.10.2028                                     | 2.000          | 2.414                    | 0,02                              |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | <b>ZF Finance GmbH</b>                                           |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 25.05.2027                                     | 12.200         | 13.743                   | 0,14                              |



| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 3,750 % fällig am 21.09.2028               | € 25.200       | \$ 27.600                | 0,28                              | <b>IRLAND</b>                                  |                |                          |                                   | Indigo Credit Management DAC                     | € 3.600        | \$ 4.234                 | 0,04                              |
|                                            |                | 121.231                  | 1,24                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>        |                |                          |                                   | Invesco Euro CLO DAC                             |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>  |                |                          |                                   | Adagio CLO DAC                                 | € 1.000        | \$ 1.176                 | 0,01                              | 2,929 % fällig am 15.07.2031                     | 629            | 738                      | 0,01                              |
| SCUR-Alpha 1503 GmbH                       | \$ 2.640       | 2.500                    | 0,03                              | Anchorage Capital Europe CLO DAC               | 18.900         | 22.153                   | 0,23                              | Jubilee CLO DAC                                  | 5.689          | 6.654                    | 0,07                              |
| 9,780 % fällig am 29.03.2030               |                |                          |                                   | 3,499 % fällig am 15.10.2038                   |                |                          |                                   | 2,929 % fällig am 15.04.2031                     |                |                          |                                   |
| Summe Deutschland                          |                | 123.731                  | 1,27                              | Arbour CLO DAC                                 |                |                          |                                   | Madison Park Euro Funding DAC                    |                |                          |                                   |
| <b>GHANA</b>                               |                |                          |                                   | 3,155 % fällig am 15.12.2038                   | 2.300          | 2.701                    | 0,03                              | 3,029 % fällig am 15.01.2032                     | 35.151         | 41.138                   | 0,42                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | 3,293 % fällig am 15.11.2037                   | 2.300          | 2.701                    | 0,03                              | 3,079 % fällig am 15.07.2032                     | 5.586          | 6.539                    | 0,07                              |
| Ghana Government International Bond        |                |                          |                                   | 4,025 % fällig am 15.12.2038                   | 1.000          | 1.178                    | 0,01                              | Man GLG Euro CLO DAC                             |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am                          |                |                          |                                   | Arcano Euro CLO DAC                            |                |                          |                                   | 2,665 % fällig am 15.12.2031                     | 4.652          | 5.446                    | 0,06                              |
| 03.07.2026 (d)                             | 862            | 837                      | 0,01                              | 0,000 % fällig am 25.07.2039 (a)               | 4.400          | 5.165                    | 0,05                              | Montmartre Euro CLO DAC                          |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am                          |                |                          |                                   | Ares European CLO DAC                          |                |                          |                                   | 3,239 % fällig am 15.07.2034                     | 2.629          | 3.089                    | 0,03                              |
| 03.01.2030 (d)                             | 1.966          | 1.649                    | 0,02                              | 3,059 % fällig am 15.10.2031                   | 4.898          | 5.741                    | 0,06                              | Oak Hill European Credit Partners DAC            |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 03.07.2029               | 20.288         | 19.069                   | 0,19                              | 3,086 % fällig am 20.04.2032                   | 461            | 541                      | 0,01                              | 2,966 % fällig am 20.01.2032                     | 734            | 862                      | 0,01                              |
| 5,000 % fällig am 03.07.2035               | 12.493         | 9.751                    | 0,10                              | 3,266 % fällig am 21.10.2034                   | 1.456          | 1.708                    | 0,02                              | 2,976 % fällig am 20.10.2031                     | 7.466          | 8.755                    | 0,09                              |
| Summe Ghana                                |                | 31.306                   | 0,32                              | 3,863 % fällig am 17.04.2032                   | 1.000          | 1.176                    | 0,01                              | OCP Euro CLO DAC                                 |                |                          |                                   |
| <b>GUATEMALA</b>                           |                |                          |                                   | 4,036 % fällig am 21.10.2034                   | 1.000          | 1.178                    | 0,01                              | 3,116 % fällig am 22.09.2034                     | 9.406          | 11.040                   | 0,11                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | Aurium CLO DAC                                 |                |                          |                                   | Palmer Square European Loan Funding DAC          |                |                          |                                   |
| Guatemala Government International Bond    |                |                          |                                   | 2,944 % fällig am 22.06.2034                   | 5.000          | 5.856                    | 0,06                              | 3,170 % fällig am 15.10.2034                     | 5.300          | 6.204                    | 0,06                              |
| 3,700 % fällig am 07.10.2033               | 6.800          | 5.759                    | 0,06                              | 2,982 % fällig am 16.01.2031                   | 4.597          | 5.389                    | 0,06                              | 3,203 % fällig am 15.02.2035                     | 12.700         | 14.908                   | 0,15                              |
| 7,050 % fällig am 04.10.2032               | 14.600         | 15.545                   | 0,16                              | Avoca CLO DAC                                  |                |                          |                                   | 3,259 % fällig am 15.01.2033                     | 880            | 1.034                    | 0,01                              |
| Summe Guatemala                            |                | 21.304                   | 0,22                              | 3,099 % fällig am 15.10.2032                   | 2.581          | 3.027                    | 0,03                              | 3,870 % fällig am 15.10.2034                     | 1.000          | 1.177                    | 0,01                              |
| <b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>               |                |                          |                                   | Avoca Static CLO DAC                           |                |                          |                                   | 4,179 % fällig am 15.01.2033                     | 1.000          | 1.176                    | 0,01                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | 3,249 % fällig am 15.01.2035                   | 1.665          | 1.955                    | 0,02                              | Rockford Tower Europe CLO DAC                    |                |                          |                                   |
| Sirius Real Estate Ltd.                    | € 4.400        | 5.123                    | 0,05                              | Bain Capital Euro CLO DAC                      |                |                          |                                   | 3,561 % fällig am 24.04.2037                     | 41.000         | 48.153                   | 0,49                              |
| 4,000 % fällig am 22.01.2032               |                |                          |                                   | 2,976 % fällig am 20.01.2032                   | 3.042          | 3.563                    | 0,04                              | Sculptor European CLO DAC                        |                |                          |                                   |
| <b>HONGKONG</b>                            |                |                          |                                   | Black Diamond CLO DAC                          |                |                          |                                   | 3,055 % fällig am 14.01.2032                     | 5.401          | 6.333                    | 0,06                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | 3,096 % fällig am 20.01.2032                   | 191            | 224                      | 0,00                              | Segovia European CLO DAC                         |                |                          |                                   |
| Fortune Star BVI Ltd.                      |                |                          |                                   | 3,123 % fällig am 15.05.2032                   | 2.458          | 2.885                    | 0,03                              | 3,116 % fällig am 20.07.2032                     | 9.164          | 10.772                   | 0,11                              |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026               | 8.300          | 9.450                    | 0,10                              | Blackrock European CLO DAC                     |                |                          |                                   | St. Paul's CLO DAC                               |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 19.05.2028               | \$ 3.000       | 3.021                    | 0,03                              | 2,899 % fällig am 15.10.2031                   | 6.797          | 7.957                    | 0,08                              | 3,199 % fällig am 15.04.2033                     | 3.446          | 4.040                    | 0,04                              |
| Summe Hongkong                             |                | 12.471                   | 0,13                              | 3,156 % fällig am 20.01.2036                   | 5.000          | 5.857                    | 0,06                              | Tikehau CLO DAC                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNGARN</b>                              |                |                          |                                   | 3,243 % fällig am 17.07.2034                   | 10.400         | 12.182                   | 0,13                              | 3,456 % fällig am 20.01.2037                     | 3.400          | 3.992                    | 0,04                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | BlueMountain Fuji EUR CLO DAC                  |                |                          |                                   | Toro European CLO DAC                            |                |                          |                                   |
| Hungary Government International Bond      |                |                          |                                   | 1,050 % fällig am 15.01.2031                   | 495            | 572                      | 0,01                              | 2,953 % fällig am 15.02.2034                     | 7.545          | 8.829                    | 0,09                              |
| 4,000 % fällig am 25.07.2029               | € 17.675       | 21.325                   | 0,22                              | 2,999 % fällig am 15.01.2031                   | 3.862          | 4.536                    | 0,05                              | 3,185 % fällig am 12.01.2032                     | 2.379          | 2.791                    | 0,03                              |
| 4,500 % fällig am 16.06.2034               | 5.000          | 5.924                    | 0,06                              | BNPP AM Euro CLO DAC                           |                |                          |                                   | Voya Euro CLO DAC                                |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 22.03.2040               | 4.500          | 5.172                    | 0,05                              | 2,879 % fällig am 15.04.2031                   | 998            | 1.169                    | 0,01                              | 3,249 % fällig am 15.10.2034                     | 15.600         | 18.298                   | 0,19                              |
| 5,375 % fällig am 12.09.2033               | 20.675         | 26.166                   | 0,27                              | Bridgepoint CLO DAC                            |                |                          |                                   |                                                  |                | 505.879                  | 5,19                              |
| 5,500 % fällig am 26.03.2036               | \$ 5.000       | 4.829                    | 0,05                              | 3,489 % fällig am 15.01.2034                   | 1.286          | 1.510                    | 0,02                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| Magyar Export-Import Bank                  |                |                          |                                   | Cairn CLO DAC                                  |                |                          |                                   | ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 16.05.2029               | € 6.000        | 7.610                    | 0,08                              | 3,059 % fällig am 15.10.2031                   | 6.265          | 7.343                    | 0,08                              | 2,700 % fällig am 11.06.2023 ^                   | 26.550         | 4.675                    | 0,05                              |
| Summe Ungarn                               |                | 71.026                   | 0,73                              | 3,174 % fällig am 29.10.2034                   | 1.000          | 1.172                    | 0,01                              | AerCap Ireland Capital DAC                       |                |                          |                                   |
| <b>INDONESIEN</b>                          |                |                          |                                   | Carlyle Euro CLO DAC                           |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.10.2027                     | \$ 33.750      | 33.896                   | 0,35                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 15.08.2038 (a)               | 7.500          | 8.804                    | 0,09                              | CIMA Finance DAC                                 |                |                          |                                   |
| Pertamina Persero PT                       | \$ 33.400      | 34.298                   | 0,35                              | 2,979 % fällig am 15.01.2031                   | 6.634          | 7.789                    | 0,08                              | 2,950 % fällig am 05.09.2029                     | 6.967          | 6.408                    | 0,07                              |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan |                |                          |                                   | 3,033 % fällig am 15.08.2032                   | 4.235          | 4.951                    | 0,05                              | Fiserv Funding ULC                               |                |                          |                                   |
| Listrik Negara                             |                |                          |                                   | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC  |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 15.06.2028                     | € 1.800        | 2.121                    | 0,02                              |
| 3,000 % fällig am 30.06.2030               | 22.900         | 21.099                   | 0,22                              | 3,952 % fällig am 16.01.2033                   | 1.000          | 1.176                    | 0,01                              | 3,500 % fällig am 15.06.2032                     | 8.000          | 9.370                    | 0,10                              |
| 6,150 % fällig am 21.05.2048               | 23.600         | 23.009                   | 0,23                              | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. |                |                          |                                   | Flutter Treasury DAC                             |                |                          |                                   |
|                                            |                | 78.406                   | 0,80                              | 2,893 % fällig am 15.11.2031                   | 3.753          | 4.408                    | 0,05                              | 6,375 % fällig am 29.04.2029                     | \$ 14.000      | 14.429                   | 0,15                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | Cumulus Static CLO DAC                         |                |                          |                                   | Iridium Capital PLC                              |                |                          |                                   |
| Indonesia Government International Bond    |                |                          |                                   | 3,343 % fällig am 15.11.2033                   | 19.388         | 22.816                   | 0,23                              | 9,250 % fällig am 18.06.2029                     | € 19.525       | 24.868                   | 0,25                              |
| 3,875 % fällig am 15.01.2033               | € 10.175       | 12.189                   | 0,13                              | CVC Cordatus Loan Fund DAC                     |                |                          |                                   | Perrigo Finance Unlimited Co.                    |                |                          |                                   |
| Summe Indonesien                           |                | 90.595                   | 0,93                              | 2,929 % fällig am 15.10.2031                   | 8.427          | 9.898                    | 0,10                              | 6,125 % fällig am 30.09.2032                     | \$ 2.100       | 2.122                    | 0,02                              |
| <b>INTERNATIONAL</b>                       |                |                          |                                   | 3,699 % fällig am 26.08.2032                   | 1.000          | 1.177                    | 0,01                              | SMBC Aviation Capital Finance DAC                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | Dryden Euro CLO DAC                            |                |                          |                                   | 2,300 % fällig am 15.06.2028                     | 900            | 844                      | 0,01                              |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC       |                |                          |                                   | 2,939 % fällig am 15.04.2033                   | 9.658          | 11.333                   | 0,12                              |                                                  |                | 98.733                   | 1,02                              |
| 9,750 % fällig am 10.10.2025               | £ 469          | 601                      | 0,01                              | 3,003 % fällig am 15.05.2034                   | 10.586         | 12.412                   | 0,13                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>        |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>  |                |                          |                                   | Euro-Galaxy CLO DAC                            |                |                          |                                   | Republic of Panama                               | € 22.350       | 26.425                   | 0,27                              |
| Project Mercury                            |                |                          |                                   | 2,811 % fällig am 24.04.2034                   | 9.566          | 11.206                   | 0,11                              | 4,103 % fällig am 05.03.2027                     |                |                          |                                   |
| 0,400 % - 6,668 % fällig am                | € 8.000        | 9.698                    | 0,10                              | GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC         |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                            |                |                          |                                   |
| 11.08.2030                                 |                |                          |                                   | 3,256 % fällig am 20.07.2034                   | 5.343          | 6.272                    | 0,06                              | Dilosk RMBS DAC                                  |                |                          |                                   |
| Summe International                        |                | 10.299                   | 0,11                              | Griffith Park CLO DAC                          |                |                          |                                   | 2,786 % fällig am 24.09.2060                     | 3.345          | 3.926                    | 0,04                              |
|                                            |                |                          |                                   | 2,795 % fällig am 21.11.2031                   | 13.799         | 16.161                   | 0,17                              | 2,838 % fällig am 25.01.2063                     | 1.164          | 1.366                    | 0,02                              |
|                                            |                |                          |                                   | Grosvenor Place CLO DAC                        |                |                          |                                   | Jeronimo Funding DAC                             |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 15.01.2039                   | 3.100          | 3.637                    | 0,04                              | 3,408 % fällig am 25.10.2064                     | 5.823          | 6.847                    | 0,07                              |
|                                            |                |                          |                                   | Harvest CLO DAC                                |                |                          |                                   | Kinbane DAC                                      |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 1,040 % fällig am 15.07.2031                   | 1.190          | 1.356                    | 0,01                              | 3,188 % fällig am 24.01.2063                     | 2.735          | 3.217                    | 0,03                              |
|                                            |                |                          |                                   | 2,916 % fällig am 20.10.2031                   | 13.468         | 15.806                   | 0,16                              | Lugo Funding DAC                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 3,039 % fällig am 15.07.2031                   | 7.735          | 9.085                    | 0,09                              | 3,049 % fällig am 26.05.2066                     | 5.129          | 6.033                    | 0,06                              |
|                                            |                |                          |                                   | 3,129 % fällig am 15.01.2032                   | 16.536         | 19.402                   | 0,20                              |                                                  |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | Hayfin Emerald CLO DAC                         |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 2,899 % fällig am 27.05.2034                   | 6.522          | 7.613                    | 0,08                              |                                                  |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 3,914 % fällig am 22.01.2039                   | 3.200          | 3.760                    | 0,04                              |                                                  |                |                          |                                   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Merrion Square Residential DAC<br>2,999 % fällig am 24.03.2081 €            | 9.270          | \$ 10.895                | 0,11                              | Mizuho Financial Group, Inc.<br>5,594 % fällig am 10.07.2035 \$                 | 2.200          | \$ 2.265                 | 0,02                              | DrillCo Holding Lux S.A. (j)                                                         | 443.430        | \$ 9.090                 | 0,09                              |
|                                                                             |                | 32.284                   | 0,33                              | Nissan Motor Co. Ltd.<br>4,345 % fällig am 17.09.2027                           | 15.100         | 14.506                   | 0,15                              | Foresea Holding S.A. 'A'                                                             | 25             | 1                        | 0,00                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                     |                |                          |                                   | SoftBank Group Corp.<br>5,375 % fällig am 08.01.2029 €                          | 1.900          | 2.270                    | 0,02                              | Intelsat Emergence S.A. (j)                                                          | 184.535        | 6.366                    | 0,07                              |
| Avenir Issuer Ireland DAC<br>6,000 % fällig am 25.10.2027 \$                | 14.894         | 13.971                   | 0,14                              | Mitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>5,316 % fällig am 09.07.2029             | 3.000          | 3.091                    | 0,03                              |                                                                                      |                | \$ 15.457                | 0,16                              |
| Summe Irland                                                                |                | 677.292                  | 6,95                              | 5,558 % fällig am 09.07.2034                                                    | 3.500          | 3.616                    | 0,04                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                              |                |                          |                                   |
| <b>INSEL MAN</b>                                                            |                |                          |                                   | Summe Japan                                                                     |                | 46.867                   | 0,48                              | Altice France Holding S.A.<br>10,500 % fällig am 15.05.2027 \$                       | 3.700          | 1.289                    | 0,01                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                     |                |                          |                                   | <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                                                      |                |                          |                                   | Banco Votorantim S.A.<br>5,875 % fällig am 08.04.2028                                | 9.000          | 9.133                    | 0,09                              |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC<br>3,750 % fällig am 01.10.2030              | 2.000          | 1.867                    | 0,02                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                         |                |                          |                                   | Chile Electricity Lux MPC SARL<br>5,580 % fällig am 20.10.2035                       | 3.324          | 3.329                    | 0,03                              |
| <b>ISRAEL</b>                                                               |                |                          |                                   | Bain Capital Credit CLO Ltd.<br>7,375 % fällig am 23.04.2035                    | 3.200          | 3.190                    | 0,04                              | ContourGlobal Power Holdings S.A.<br>6,750 % fällig am 28.02.2030                    | 5.000          | 5.158                    | 0,05                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                     |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   | Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % bar oder 11,000 % PIK)                      |                |                          |                                   |
| Israel Government International Bond<br>1,750 % fällig am 31.08.2025 ILS    | 30.200         | 8.932                    | 0,09                              | AA Bond Co. Ltd.<br>5,500 % fällig am 31.07.2050 £                              | 15.490         | 21.343                   | 0,22                              | 10,000 % fällig am 31.12.2026 (b)                                                    | € 1.979        | 2.090                    | 0,02                              |
| 5,000 % fällig am 30.10.2026 €                                              | 7.800          | 9.415                    | 0,10                              | 5,375 % fällig am 31.07.2050                                                    | 1.800          | 2.593                    | 0,02                              | FORESEA Holding S.A.<br>7,500 % fällig am 15.06.2030 \$                              | 5.579          | 5.306                    | 0,06                              |
| 5,375 % fällig am 12.03.2029 \$                                             | 9.925          | 10.136                   | 0,11                              | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.<br>3,250 % fällig am 12.11.2025 €        | 568            | 663                      | 0,01                              | Greensaif Pipelines Bidco SARL<br>5,853 % fällig am 23.02.2036                       | 4.400          | 4.454                    | 0,05                              |
| 5,500 % fällig am 12.03.2034                                                | 4.000          | 4.056                    | 0,04                              |                                                                                 |                | 24.599                   | 0,25                              | 6,103 % fällig am 23.08.2042                                                         | 3.900          | 3.906                    | 0,04                              |
| 5,625 % fällig am 19.02.2035                                                | 14.500         | 14.764                   | 0,15                              | Summe Jersey, Kanalinseln                                                       |                | 27.789                   | 0,29                              | 6,129 % fällig am 23.02.2038                                                         | 5.250          | 5.417                    | 0,06                              |
| Summe Israel                                                                |                | 47.303                   | 0,49                              | <b>JORDANIEN</b>                                                                |                |                          |                                   | 6,510 % fällig am 23.02.2042 (k)                                                     | 4.700          | 4.874                    | 0,05                              |
| <b>ITALIEN</b>                                                              |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   | Guara Norte SARL<br>5,198 % fällig am 15.06.2034                                     | 3.073          | 2.915                    | 0,03                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                     |                |                          |                                   | Jordan Government International Bond<br>7,500 % fällig am 13.01.2029 \$         | 4.000          | 4.113                    | 0,04                              | Intelsat Jackson Holdings S.A.<br>6,500 % fällig am 15.03.2030                       | 13.610         | 13.912                   | 0,14                              |
| Golden Bar Securitisation SRL<br>2,747 % fällig am 20.12.2044 €             | 10.700         | 12.586                   | 0,13                              | <b>KASACHSTAN</b>                                                               |                |                          |                                   | Logicor Financing SARL<br>3,250 % fällig am 13.11.2028 €                             | 13.900         | 16.342                   | 0,17                              |
| 3,086 % fällig am 22.09.2043                                                | 11.288         | 13.337                   | 0,14                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   | Motion Finco SARL<br>8,375 % fällig am 15.02.2032 \$                                 | 3.700          | 3.392                    | 0,04                              |
| Koromo Italy Compartment<br>2,614 % fällig am 26.02.2032                    | 3.028          | 3.563                    | 0,03                              | KazMunayGas National Co. JSC<br>5,375 % fällig am 24.04.2030                    | 3.100          | 3.128                    | 0,03                              | Petrorio Luxembourg Holding SARL<br>6,125 % fällig am 09.06.2026                     | 3.900          | 3.909                    | 0,04                              |
| Marzio Finance SRL<br>2,759 % fällig am 28.09.2049                          | 2.694          | 3.175                    | 0,03                              | 5,750 % fällig am 19.04.2047                                                    | 4.350          | 3.791                    | 0,04                              | Raizen Fuels Finance S.A.<br>6,250 % fällig am 08.07.2032 (a)                        | 1.800          | 1.789                    | 0,02                              |
|                                                                             |                | 32.661                   | 0,33                              | 6,375 % fällig am 24.10.2048                                                    | 6.000          | 5.557                    | 0,06                              | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,125 % fällig am 29.10.2022 ^             | 3.900          | 234                      | 0,00                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                     |                |                          |                                   | Summe Kasachstan                                                                |                | 12.476                   | 0,13                              | Tierra Mojada Luxembourg SARL<br>5,750 % fällig am 01.12.2040                        | 12.382         | 11.708                   | 0,12                              |
| Aeroporti di Roma SpA<br>1,750 % fällig am 30.07.2031                       | 3.400          | 3.664                    | 0,04                              | <b>KENIA</b>                                                                    |                |                          |                                   | Titanium Bondco SARL (6,250 % PIK)<br>6,250 % fällig am 14.01.2031 (b)               | € 3.363        | 1.164                    | 0,01                              |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA<br>8,500 % fällig am 10.09.2030         | 20.780         | 24.669                   | 0,25                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                       |                |                          |                                   | 100.321                                                                              | 1,03           |                          |                                   |
| Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC<br>7,500 % fällig am 15.02.2032 \$         | 4.625          | 4.687                    | 0,05                              | Republik Kenia<br>9,849 % fällig am 05.04.2028                                  | 5.000          | 4.988                    | 0,05                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                            |                |                          |                                   |
| Eni SpA<br>5,500 % fällig am 15.05.2034                                     | 16.000         | 16.130                   | 0,17                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   | Albion Financing SARL<br>5,236 % fällig am 16.08.2029                                | 6.946          | 8.146                    | 0,08                              |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>4,000 % fällig am 23.09.2029                         | 10.276         | 10.029                   | 0,10                              | Republic of Kenya Government International Bond<br>9,500 % fällig am 05.03.2036 | 6.000          | 5.667                    | 0,06                              | Summe Luxemburg                                                                      |                | 123.924                  | 1,27                              |
| 5,148 % fällig am 10.06.2030 £                                              | 6.000          | 8.159                    | 0,08                              | 9,750 % fällig am 16.02.2031 (k)                                                | 9.700          | 9.862                    | 0,10                              | <b>MAZEDONIEN</b>                                                                    |                |                          |                                   |
| Mundys SpA<br>1,875 % fällig am 12.02.2028 €                                | 38.725         | 43.965                   | 0,45                              |                                                                                 |                | 15.529                   | 0,16                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                              |                |                          |                                   |
| Nexi SpA<br>2,125 % fällig am 30.04.2029                                    | 22.950         | 25.685                   | 0,26                              | Summe Kenia                                                                     |                | 20.517                   | 0,21                              | North Macedonia Government International Bond<br>3,675 % fällig am 03.06.2026        | 5.200          | 6.120                    | 0,06                              |
| 3,875 % fällig am 21.05.2031                                                | 3.675          | 4.352                    | 0,05                              | <b>LIBANON</b>                                                                  |                |                          |                                   |                                                                                      |                |                          |                                   |
| Snam SpA<br>5,000 % fällig am 28.05.2030 \$                                 | 4.100          | 4.136                    | 0,04                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   | <b>AKTIEN</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| Telecom Italia SpA<br>7,875 % fällig am 31.07.2028 €                        | 8.200          | 10.826                   | 0,11                              | Lebanon Government International Bond<br>6,000 % fällig am 27.01.2023 ^         | 12.025         | 2.261                    | 0,02                              | <b>MEXIKO</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| UniCredit SpA<br>1,982 % fällig am 03.06.2027                               | 10.500         | 10.243                   | 0,11                              | 6,100 % fällig am 04.10.2022 ^                                                  | 12.225         | 2.296                    | 0,03                              | <b>STAMMAKTIVEN</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| 7,296 % fällig am 02.04.2034                                                | 4.401          | 4.657                    | 0,05                              | 6,850 % fällig am 23.03.2027 ^                                                  | 12.025         | 2.267                    | 0,02                              | Hipotecaria Su Casita S.A.<br>de C.V. (c)                                            | 28.925         | 0                        | 0,00                              |
|                                                                             |                | 171.202                  | 1,76                              | Summe Libanon                                                                   |                | 6.824                    | 0,07                              |                                                                                      |                |                          |                                   |
| Summe Italien                                                               |                | 203.863                  | 2,09                              | <b>LIBERIA</b>                                                                  |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                              |                |                          |                                   |
| <b>ELFENBEINKÜSTE</b>                                                       |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   | Banco Actinver S.A. Institucion de Banca Multiple<br>7,250 % fällig am 31.01.2041 \$ | 3.977          | 4.040                    | 0,04                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                     |                |                          |                                   | Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>5,625 % fällig am 30.09.2031                    | 9.200          | 9.262                    | 0,10                              |                                                                                      |                |                          |                                   |
| Ivory Coast Government International Bond<br>6,625 % fällig am 22.03.2048 € | 10.400         | 9.558                    | 0,10                              | <b>AKTIEN</b>                                                                   |                |                          |                                   |                                                                                      |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 17.10.2040                                                | 3.400          | 3.402                    | 0,03                              | <b>LUXEMBURG</b>                                                                |                |                          |                                   |                                                                                      |                |                          |                                   |
| 8,075 % fällig am 01.04.2036 \$                                             | 8.200          | 7.925                    | 0,08                              | <b>STAMMAKTIVEN</b>                                                             |                |                          |                                   |                                                                                      |                |                          |                                   |
| 8,250 % fällig am 30.01.2037                                                | 4.100          | 3.960                    | 0,04                              | Adler Group S.A. (c)                                                            | 598.038        | 0                        | 0,00                              |                                                                                      |                |                          |                                   |
| Summe Elfenbeinküste                                                        |                | 24.845                   | 0,25                              | Corestate Capital Holding<br>S.A. (c)(j)                                        | 3.586.721      | 0                        | 0,00                              |                                                                                      |                |                          |                                   |
| <b>JAPAN</b>                                                                |                |                          |                                   |                                                                                 |                |                          |                                   |                                                                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                     |                |                          |                                   |                                                                                 |                |                          |                                   |                                                                                      |                |                          |                                   |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.<br>5,574 % fällig am 16.01.2036        | 16.500         | 16.961                   | 0,18                              |                                                                                 |                |                          |                                   |                                                                                      |                |                          |                                   |

|                                                   |        |         |          | % DES                            |                                               |        |        |          | % DES  |                                              |        |        |           | % DES |
|---------------------------------------------------|--------|---------|----------|----------------------------------|-----------------------------------------------|--------|--------|----------|--------|----------------------------------------------|--------|--------|-----------|-------|
|                                                   | PARI   | MARKT-  | NETTO-   |                                  |                                               | PARI   | MARKT- | NETTO-   |        |                                              | PARI   | MARKT- | NETTO-    |       |
| BESCHREIBUNG                                      | (000S) | WERT    | VERMÖ-   | GENS                             | BESCHREIBUNG                                  | (000S) | WERT   | VERMÖ-   | GENS   | BESCHREIBUNG                                 | (000S) | WERT   | VERMÖ-    | GENS  |
| Petroleos Mexicanos                               |        |         |          |                                  | 4,220 % fällig am 17.04.2030                  | €      | 1.225  | \$ 1.514 | 0,02   | 6,700 % fällig am 26.01.2036                 | \$     | 20.600 | \$ 20.536 | 0,21  |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048                      | \$     | 4.100   | \$ 2.857 | 0,03                             | 4,500 % fällig am 17.11.2033                  |        | 2.300  | 2.875    | 0,03   | 6,853 % fällig am 28.03.2054                 |        | 13.450 | 12.356    | 0,13  |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035                      |        | 72.500  | 61.150   | 0,63                             | Sunrise FinCo BV                              |        |        |          |        | 6,875 % fällig am 31.01.2036                 |        | 5.700  | 5.681     | 0,06  |
| 6,625 % fällig am 15.06.2038                      |        | 5.050   | 3.951    | 0,04                             | 4,875 % fällig am 15.07.2031                  | \$     | 2.050  | 1.940    | 0,02   | 7,875 % fällig am                            |        |        |           |       |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032                      |        | 21.387  | 19.889   | 0,20                             | Universal Music Group NV                      |        |        |          |        | 01.03.2057 (k)                               | 7.500  | 7.650  | 0,08      |       |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047                      |        | 21.300  | 15.441   | 0,16                             | 3,750 % fällig am 30.06.2032                  | €      | 3.775  | 4.546    | 0,05   | 8,000 % fällig am 01.03.2038                 | 1.000  | 1.074  | 0,01      |       |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050                      |        | 13.775  | 10.844   | 0,11                             | VZ Secured Financing BV                       |        |        |          |        |                                              |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | 5,000 % fällig am 15.01.2032                  | \$     | 2.000  | 1.781    | 0,02   | Summe Panama                                 |        |        |           |       |
|                                                   |        | 118.172 | 1,21     |                                  | Wintershall Dea Finance BV                    |        |        |          |        |                                              |        | 63.836 | 0,66      |       |
| STAATSEMISSIONEN                                  |        |         |          |                                  | 4,357 % fällig am 03.10.2032                  | €      | 3.400  | 4.003    | 0,04   | PARAGUAY<br>STAATSEMISSIONEN                 |        |        |           |       |
| Mexico Government International Bond              |        |         |          |                                  | Yinson Bergenia Production BV                 |        |        |          |        | Paraguay Government International Bond       |        |        |           |       |
| 2,750 % fällig am                                 |        |         |          |                                  | 8,498 % fällig am                             |        |        |          |        | 6,000 % fällig am 09.02.2036                 |        |        |           |       |
| 27.11.2031 (f)                                    | MXN    | 150.295 | 7.051    | 0,07                             | 31.01.2045 (a)                                | \$     | 5.600  | 5.675    | 0,06   | 20.500                                       |        |        |           |       |
| 3,771 % fällig am 24.05.2061                      | \$     | 7.360   | 4.365    | 0,04                             | Yinson Boronia Production BV                  |        |        |          |        | 20.891                                       |        |        |           |       |
| 4,000 % fällig am                                 |        |         |          |                                  | 8,947 % fällig am 31.07.2042                  |        | 16.553 | 17.637   | 0,18   | 0,21                                         |        |        |           |       |
| 24.08.2034 (f)                                    | MXN    | 64.096  | 3.157    | 0,03                             |                                               |        |        |          |        | PERU<br>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL     |        |        |           |       |
| 4,490 % fällig am 25.05.2032                      | €      | 11.200  | 13.322   | 0,14                             |                                               |        |        |          |        | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |        |        |           |       |
| 4,500 % fällig am 31.01.2050                      | \$     | 26.100  | 19.048   | 0,20                             |                                               |        |        |          |        | 10,100 % fällig am                           |        |        |           |       |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110                      |        | 10.000  | 7.915    | 0,08                             | KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG            |        |        |          |        | 15.12.2043                                   |        |        |           |       |
| 5,850 % fällig am                                 |        |         |          |                                  | Veon Amsterdam                                |        |        |          |        | PEN                                          |        |        |           |       |
| 02.07.2032 (a)                                    |        | 7.300   | 7.397    | 0,08                             | 8,531 % - 10,750 % fällig am                  |        |        |          |        | 84.725                                       |        |        |           |       |
| 6,000 % fällig am 07.05.2036                      |        | 11.750  | 11.625   | 0,12                             | 25.03.2027                                    | 6.300  | 6.302  | 0,07     |        | 25.368                                       |        |        |           |       |
| 6,350 % fällig am 09.02.2035                      |        | 15.300  | 15.692   | 0,16                             | NON-AGENCY-MBS                                |        |        |          |        | 0,26                                         |        |        |           |       |
| 6,400 % fällig am 07.05.2054                      |        | 4.000   | 3.692    | 0,04                             | Domi BV                                       |        |        |          |        | Kallpa Generacion S.A.                       |        |        |           |       |
| 6,625 % fällig am                                 |        |         |          |                                  | 2,655 % fällig am 15.06.2056                  | €      | 9.321  | 10.925   | 0,11   | 5,875 % fällig am 30.01.2032                 |        |        |           |       |
| 29.01.2038 (a)                                    |        | 28.859  | 29.335   | 0,30                             | EMF-NL Prime BV                               |        |        |          |        | \$                                           |        |        |           |       |
| 6,875 % fällig am 13.05.2037                      |        | 8.400   | 8.782    | 0,09                             | 3,063 % fällig am 17.04.2041                  |        | 6      | 7        | 0,00   | 2.000                                        |        |        |           |       |
| 7,375 % fällig am 13.05.2055                      |        | 10.000  | 10.347   | 0,11                             | Jubilee Place BV                              |        |        |          |        | 2.051                                        |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | 2,724 % fällig am 18.09.2062                  |        | 5.471  | 6.426    | 0,07   | Niagara Energy SAC                           |        |        |           |       |
|                                                   |        | 141.728 | 1,46     |                                  | 2,804 % fällig am 17.09.2060                  |        | 16.621 | 19.567   | 0,20   | 5,746 % fällig am 03.10.2034                 |        |        |           |       |
| Summe Mexiko                                      |        | 259.900 | 2,67     |                                  |                                               |        |        |          |        | 4.850                                        |        |        |           |       |
| MONGOLEI<br>STAATSEMISSIONEN                      |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 4.806                                        |        |        |           |       |
| City of Ulaanbaatar Mongolia                      |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 32.225                                       |        |        |           |       |
| 7,750 % fällig am 21.08.2027                      | 12.900 | 12.958  | 0,13     |                                  | Summe Niederlande                             |        |        |          |        | 0,33                                         |        |        |           |       |
| MAROKKO<br>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL       |        |         |          |                                  | NIGERIA<br>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG |        |        |          |        | STAATSEMISSIONEN                             |        |        |           |       |
| OCP S.A.                                          |        |         |          |                                  | Bank of Industry Ltd.                         |        |        |          |        | Peru Government International Bond           |        |        |           |       |
| 6,700 % fällig am 01.03.2036                      | 9.400  | 9.463   | 0,10     |                                  | 3,695 % fällig am 23.08.2027                  | 21.500 | 25.069 | 0,26     |        | 5,350 % fällig am 12.08.2040                 |        |        |           |       |
| MULTINATIONAL<br>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL |        |         |          |                                  | STAATSEMISSIONEN                              |        |        |          |        | PEN                                          |        |        |           |       |
| JetBlue Airways Corp.                             |        |         |          |                                  | Nigeria Government International Bond         |        |        |          |        | 2.100                                        |        |        |           |       |
| 9,875 % fällig am 20.09.2031                      | 6.500  | 6.328   | 0,06     |                                  | 7,625 % fällig am 28.11.2047                  | \$     | 12.100 | 9.635    | 0,10   | 5,375 % fällig am 08.02.2035                 |        |        |           |       |
| Toucan FinCo Ltd.                                 |        |         |          |                                  | 7,875 % fällig am 16.02.2032                  |        | 16.300 | 15.495   | 0,16   | \$                                           |        |        |           |       |
| 9,500 % fällig am 15.05.2030                      | 8.200  | 8.389   | 0,09     |                                  | 9,625 % fällig am 09.06.2031                  |        | 1.400  | 1.467    | 0,01   | 8.400                                        |        |        |           |       |
| Summe multinational                               |        | 14.717  | 0,15     |                                  |                                               |        |        |          |        | 5,400 % fällig am 12.08.2034                 |        |        |           |       |
| NIEDERLANDE<br>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | PEN                                          |        |        |           |       |
| Hill FL BV                                        |        |         |          |                                  | OMAN<br>STAATSEMISSIONEN                      |        |        |          |        | 16.500                                       |        |        |           |       |
| 2,631 % fällig am 18.10.2032                      | €      | 3.600   | 4.232    | 0,04                             | Oman Government International Bond            |        |        |          |        | \$                                           |        |        |           |       |
| Mila BV                                           |        |         |          |                                  | 6,750 % fällig am 17.01.2048                  | 21.300 | 22.038 | 0,23     |        | 17.600                                       |        |        |           |       |
| 2,778 % fällig am 16.09.2041                      | 2.400  | 2.823   | 0,03     |                                  | PAKISTAN<br>STAATSEMISSIONEN                  |        |        |          |        | 5,500 % fällig am 12.08.2031                 |        |        |           |       |
|                                                   |        | 7.055   | 0,07     |                                  | Pakistan Government International Bond        |        |        |          |        | PEN                                          |        |        |           |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |        |         |          |                                  | 6,000 % fällig am 08.04.2026                  |        | 16.900 | 16.661   | 0,17   | 13.200                                       |        |        |           |       |
| ASR Nederland NV                                  |        |         |          |                                  | 6,875 % fällig am 05.12.2027                  |        | 6.900  | 6.531    | 0,07   | 9.600                                        |        |        |           |       |
| 7,000 % fällig am 07.12.2043                      | 1.400  | 1.922   | 0,02     |                                  | 7,375 % fällig am 08.04.2031 (k)              |        | 1.200  | 1.069    | 0,01   | 13.200                                       |        |        |           |       |
| Citycon Treasury BV                               |        |         |          |                                  | Summe Pakistan                                |        |        | 24.261   | 0,25   | 9.600                                        |        |        |           |       |
| 1,625 % fällig am 12.03.2028                      | 3.400  | 3.761   | 0,04     |                                  | PANAMA<br>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL    |        |        |          |        | 3.100                                        |        |        |           |       |
| Enel Finance International NV                     |        |         |          |                                  | Carnival Corp.                                |        |        |          |        | 3.186                                        |        |        |           |       |
| 5,000 % fällig am 15.06.2032                      | \$     | 5.000   | 5.017    | 0,05                             | 4,000 % fällig am 01.08.2028                  | 11.200 | 10.969 | 0,11     |        | 0,03                                         |        |        |           |       |
| Flora Food Management BV                          |        |         |          |                                  | STAATSEMISSIONEN                              |        |        |          |        | 5,000                                        |        |        |           |       |
| 6,875 % fällig am 02.07.2029                      | €      | 9.775   | 11.666   | 0,12                             | Panama Government International Bond          |        |        |          |        | \$                                           |        |        |           |       |
| IGT Lottery Holdings BV                           |        |         |          |                                  | 3,875 % fällig am 17.03.2028                  | 15.250 | 14.776 | 0,15     |        | 6.500                                        |        |        |           |       |
| 4,250 % fällig am 15.03.2030                      | 7.350  | 8.806   | 0,09     |                                  | 4,500 % fällig am 16.04.2050                  | 2.600  | 1.763  | 0,02     |        | 6.698                                        |        |        |           |       |
| ING Groep NV                                      |        |         |          |                                  | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL              |        |        |          |        | 0,07                                         |        |        |           |       |
| 5,750 % fällig am                                 |        |         |          |                                  | Carnival Corp.                                |        |        |          |        | 0,03                                         |        |        |           |       |
| 16.11.2026 (g)(i)                                 | \$     | 9.000   | 8.958    | 0,09                             | STAATSEMISSIONEN                              |        |        |          |        | Poland Government International Bond         |        |        |           |       |
| JDE Peet's NV                                     |        |         |          |                                  | Panama Government International Bond          |        |        |          |        | 4,875 % fällig am 12.02.2030                 |        |        |           |       |
| 4,500 % fällig am 23.01.2034                      | €      | 10.625  | 13.062   | 0,13                             | 3,875 % fällig am 17.03.2028                  |        |        |          |        | 22.725                                       |        |        |           |       |
| Sandoz Finance BV                                 |        |         |          |                                  | 4,500 % fällig am 16.04.2050                  |        |        |          |        | 10.950                                       |        |        |           |       |
| 3,250 % fällig am 12.09.2029                      | 4.500  | 5.359   | 0,05     | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL |                                               |        |        |          | 51.342 |                                              |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | Banco Espirito Santo S.A.                     |        |        |          |        | 0,53                                         |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | 4,750 % fällig am                             |        |        |          |        | 54.528                                       |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | 15.01.2018 ^                                  |        |        |          |        | Summe Polen                                  |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | 200                                           |        |        |          |        | PORTUGAL<br>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | 55                                            |        |        |          |        | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  | 0,00                                          |        |        |          |        | 2,949 % fällig am 25.02.2034                 |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | €                                            |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 3.252                                        |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 3.831                                        |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 0,04                                         |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | Banco Espirito Santo S.A.                    |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 4,750 % fällig am                            |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 15.01.2018 ^                                 |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 200                                          |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 55                                           |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 0,00                                         |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | Galp Energia SGPS S.A.                       |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 2,000 % fällig am 15.01.2026                 |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 12.300                                       |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 14.415                                       |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 0,15                                         |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 14.470                                       |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 0,15                                         |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 18.301                                       |        |        |           |       |
|                                                   |        |         |          |                                  |                                               |        |        |          |        | 0,19                                         |        |        |           |       |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>RUMÄNIEN</b>                               |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                          |       |
| Romania Government International Bond         |                |                          |                          |       |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033                  | € 1.500        | \$ 1.352                 | 0,02                     |       |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030                  | 8.225          | 9.870                    | 0,10                     |       |
| 5,250 % fällig am 30.05.2032                  | 4.500          | 5.205                    | 0,05                     |       |
| 5,500 % fällig am 18.09.2028                  | 4.000          | 4.897                    | 0,05                     |       |
| 5,625 % fällig am 22.02.2036                  | 2.575          | 2.880                    | 0,03                     |       |
| 6,375 % fällig am 18.09.2033                  | 16.400         | 19.844                   | 0,20                     |       |
| 6,625 % fällig am 27.09.2029                  | 14.500         | 18.360                   | 0,19                     |       |
| Summe Rumänien                                |                | 62.408                   | 0,64                     |       |
| <b>RUSSLAND</b>                               |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| ALROSA Finance S.A.                           |                |                          |                          |       |
| 3,100 % fällig am 25.06.2027 ^                | \$ 22.400      | 1.344                    | 0,01                     |       |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 ^                | 3.200          | 192                      | 0,00                     |       |
| MMK International Capital DAC                 |                |                          |                          |       |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 ^                | 8.600          | 516                      | 0,01                     |       |
| Summe Russland                                |                | 2.052                    | 0,02                     |       |
| <b>SAUDI-ARABIEN</b>                          |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                          |       |
| Saudi Arabia Government International Bond    |                |                          |                          |       |
| 3,450 % fällig am 02.02.2061                  | 42.000         | 26.099                   | 0,27                     |       |
| 4,875 % fällig am 18.07.2033                  | 21.000         | 21.103                   | 0,22                     |       |
| 5,000 % fällig am 18.01.2053                  | 20.000         | 17.072                   | 0,17                     |       |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028                  | 24.000         | 24.406                   | 0,25                     |       |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031                  | 11.000         | 11.416                   | 0,12                     |       |
| 5,750 % fällig am 16.01.2054 (k)              | 8.500          | 8.111                    | 0,08                     |       |
| Summe Saudi-Arabien                           |                | 108.207                  | 1,11                     |       |
| <b>SENEGAL</b>                                |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                          |       |
| Senegal Government International Bond         |                |                          |                          |       |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028                  | € 3.100        | 2.887                    | 0,03                     |       |
| 5,375 % fällig am 08.06.2037                  | 7.800          | 5.692                    | 0,06                     |       |
| 6,250 % fällig am 23.05.2033                  | \$ 700         | 463                      | 0,00                     |       |
| 6,750 % fällig am 13.03.2048                  | 2.100          | 1.272                    | 0,01                     |       |
| 7,750 % fällig am 10.06.2031                  | 11.550         | 8.485                    | 0,09                     |       |
| Summe Senegal                                 |                | 18.799                   | 0,19                     |       |
| <b>SERBIEN</b>                                |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                          |       |
| Serbia Government International Bond          |                |                          |                          |       |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033                  | € 8.900        | 8.576                    | 0,09                     |       |
| 6,000 % fällig am 12.06.2034                  | \$ 4.450       | 4.499                    | 0,05                     |       |
| 6,500 % fällig am 26.09.2033 (k)              | 9.400          | 9.910                    | 0,10                     |       |
| Summe Serbien                                 |                | 22.985                   | 0,24                     |       |
| <b>SINGAPUR</b>                               |                |                          |                          |       |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>       |                |                          |                          |       |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.      |                |                          |                          |       |
| 5,806 % fällig am 11.04.2043                  | 920            | 920                      | 0,01                     |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| Flex Ltd.                                     |                |                          |                          |       |
| 3,750 % fällig am 01.02.2026                  | 14.000         | 13.910                   | 0,14                     |       |
| Yinson Production Financial Services Pte Ltd. |                |                          |                          |       |
| 9,625 % fällig am 03.05.2029                  | 7.975          | 8.291                    | 0,09                     |       |
|                                               |                | 22.201                   | 0,23                     |       |
| Summe Singapur                                |                | 23.121                   | 0,24                     |       |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                              |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| Sasol Financing USA LLC                       |                |                          |                          |       |
| 6,500 % fällig am 27.09.2028                  | 10.300         | 9.795                    | 0,10                     |       |
| 8,750 % fällig am 03.05.2029                  | 5.600          | 5.550                    | 0,06                     |       |
|                                               |                | 15.345                   | 0,16                     |       |
| <b>SCHWEIZ</b>                                |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| UBS Group AG                                  |                |                          |                          |       |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029                  | \$ 700         | \$ 690                   | 0,01                     |       |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026                  | 7.100          | 7.081                    | 0,07                     |       |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031                  | 1.400          | 1.371                    | 0,02                     |       |
| 4,703 % fällig am 05.08.2027                  | 4.200          | 4.209                    | 0,04                     |       |
| 5,617 % fällig am 13.09.2030                  | 3.800          | 3.947                    | 0,04                     |       |
| 6,442 % fällig am 11.08.2028                  | 8.200          | 8.522                    | 0,09                     |       |
| 6,537 % fällig am 12.08.2033                  | 5.500          | 5.984                    | 0,06                     |       |
| Summe Schweiz                                 |                | 31.804                   | 0,33                     |       |
| <b>TÜRKEI</b>                                 |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| Türkiye Varlik Fonu Yonetimi A/S              |                |                          |                          |       |
| 8,250 % fällig am 14.02.2029                  | 3.500          | 3.666                    | 0,04                     |       |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>     |                |                          |                          |       |
| Türkiye Vakiflar Bankasi T.A.O.               |                |                          |                          |       |
| 5,001 % fällig am 15.12.2028                  | € 3.400        | 4.006                    | 0,04                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                          |       |
| Turkey Government International Bond          |                |                          |                          |       |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043                  | \$ 33.067      | 23.352                   | 0,24                     |       |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047                  | 58.300         | 43.835                   | 0,45                     |       |
| 5,875 % fällig am 21.05.2030                  | € 5.000        | 6.271                    | 0,06                     |       |
| 47,469 % fällig am 06.09.2028                 | TRY 327.000    | 7.892                    | 0,08                     |       |
|                                               |                | 81.350                   | 0,83                     |       |
| Summe Türkei                                  |                | 89.022                   | 0,91                     |       |
| <b>UKRAINE</b>                                |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| NPC Ukregenergo                               |                |                          |                          |       |
| 6,875 % fällig am 09.11.2028                  | \$ 1.000       | 813                      | 0,01                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                          |       |
| Ukraine Government International Bond         |                |                          |                          |       |
| 0,000 % fällig am 01.02.2030                  | 2.841          | 1.372                    | 0,01                     |       |
| 0,000 % fällig am 01.02.2034                  | 10.616         | 4.119                    | 0,04                     |       |
| 0,000 % fällig am 01.02.2035                  | 2.383          | 1.132                    | 0,01                     |       |
| 0,000 % fällig am 01.08.2041                  | 982            | 710                      | 0,01                     |       |
| 1,750 % fällig am 01.02.2029 (k)              | 2.340          | 1.451                    | 0,02                     |       |
| 1,750 % fällig am 01.02.2034                  | 14.678         | 7.632                    | 0,08                     |       |
| 1,750 % fällig am 01.02.2035                  | 17.564         | 9.011                    | 0,09                     |       |
| 1,750 % fällig am 01.02.2036                  | 17.427         | 8.714                    | 0,09                     |       |
|                                               |                | 34.141                   | 0,35                     |       |
| Summe Ukraine                                 |                | 34.954                   | 0,36                     |       |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>           |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC      |                |                          |                          |       |
| 4,375 % fällig am 02.10.2031                  | 14.600         | 14.404                   | 0,15                     |       |
| 5,375 % fällig am 08.05.2029                  | 5.800          | 5.978                    | 0,06                     |       |
| 5,500 % fällig am 08.05.2034                  | 2.500          | 2.601                    | 0,02                     |       |
| DAE Sukuk Dift Ltd.                           |                |                          |                          |       |
| 3,750 % fällig am 15.02.2026                  | 11.500         | 11.426                   | 0,12                     |       |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate            |                | 34.409                   | 0,35                     |       |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                        |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       |
| Amber Finco PLC                               |                |                          |                          |       |
| 6,625 % fällig am 15.07.2029                  | € 3.100        | 3.814                    | 0,04                     |       |
| Barclays PLC                                  |                |                          |                          |       |
| 6,125 % fällig am 15.12.2025 (g)(i)           | \$ 11.100      | 11.118                   | 0,11                     |       |
| 7,437 % fällig am 02.11.2033                  | 8.500          | 9.650                    | 0,10                     |       |
| Boparan Finance PLC                           |                |                          |                          |       |
| 9,375 % fällig am 07.11.2029                  | £ 7.500        | 10.674                   | 0,11                     |       |
| British Telecommunications PLC                |                |                          |                          |       |
| 3,875 % fällig am 20.01.2034                  | € 1.250        | 1.496                    | 0,02                     |       |
| Burberry Group PLC                            |                |                          |                          |       |
| 5,750 % fällig am 20.06.2030                  | £ 3.250        | 4.459                    | 0,05                     |       |
| Greene King Finance PLC                       |                |                          |                          |       |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034                  | 302            | 410                      | 0,01                     |       |

| BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>HSBC Holdings PLC</b>                              |                |                          |                                   | <b>Edenbrook Mortgage Funding PLC</b>                                              |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>            |                |                          |                                   |
| 2,848 % fällig am 04.06.2031                          | \$             | 1.575                    | 0,02                              | 5,589 % fällig am 22.03.2057                                                       | £              | 2.248                    | 0,03                              | 4,974 % fällig am 25.11.2035                                 | \$             | 25                       | 0,00                              |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030                          |                | 9.300                    | 0,09                              | <b>Elstree Funding</b>                                                             |                |                          |                                   | 5,439 % fällig am 25.06.2035                                 |                | 130                      | 0,00                              |
| 5,887 % fällig am 14.08.2027                          |                | 2.400                    | 0,03                              | 4,943 % fällig am 21.01.2065                                                       |                | 3.818                    | 0,05                              | 5,684 % fällig am 25.08.2037                                 |                | 92                       | 0,00                              |
| <b>Informa PLC</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Harbour PLC</b>                                                                 |                |                          |                                   | <b>Carrington Mortgage Loan Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| 1,250 % fällig am 22.04.2028                          | €              | 7.500                    | 0,09                              | 5,332 % fällig am 28.10.2054                                                       |                | 13.911                   | 0,20                              | 4,594 % fällig am 25.10.2036                                 |                | 634                      | 0,01                              |
| 3,250 % fällig am 23.10.2030                          |                | 700                      | 0,01                              | <b>Hops Hill PLC</b>                                                               |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.01.2037                                 |                | 1.200                    | 0,01                              |
| <b>John Lewis PLC</b>                                 |                |                          |                                   | 5,103 % fällig am 21.04.2056                                                       |                | 6.668                    | 0,09                              | 4,684 % fällig am 25.10.2036                                 |                | 634                      | 0,01                              |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034                          | £              | 3.710                    | 0,04                              | 5,523 % fällig am 21.04.2056                                                       |                | 1.200                    | 0,02                              | 4,694 % fällig am 25.02.2037                                 |                | 1.676                    | 0,02                              |
| <b>Lloyds Banking Group PLC</b>                       |                |                          |                                   | <b>London Wall Mortgage Capital PLC</b>                                            |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.06.2036                                 |                | 1.785                    | 0,02                              |
| 4,976 % fällig am 11.08.2033                          | \$             | 1.300                    | 0,01                              | 5,227 % fällig am 15.05.2057                                                       |                | 1.588                    | 0,02                              | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                   |                |                          |                                   |
| 5,087 % fällig am 26.11.2028                          |                | 3.000                    | 0,03                              | <b>Pierpont BTL PLC</b>                                                            |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.05.2037                                 |                | 718                      | 0,01                              |
| 5,590 % fällig am 26.11.2035                          |                | 3.000                    | 0,03                              | 5,079 % fällig am 21.09.2061                                                       |                | 984                      | 0,01                              | 4,694 % fällig am 25.03.2037                                 |                | 823                      | 0,01                              |
| 5,679 % fällig am                                     |                |                          |                                   | <b>Polaris PLC</b>                                                                 |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.09.2036                                 |                | 543                      | 0,01                              |
| 05.01.2035 (k)                                        |                | 2.000                    | 0,02                              | 5,044 % fällig am 26.02.2068                                                       |                | 22.744                   | 0,32                              | 4,754 % fällig am 25.01.2037                                 |                | 673                      | 0,00                              |
| <b>Market Bidco Finco PLC</b>                         |                |                          |                                   | <b>Stratton Hawksmoor PLC</b>                                                      |                |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.11.2046                                 |                | 372                      | 0,00                              |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027                          | €              | 11.950                   | 0,14                              | 5,737 % fällig am 25.02.2053                                                       |                | 2.000                    | 0,03                              | 4,854 % fällig am 25.12.2036                                 |                | 1.025                    | 0,01                              |
| <b>Marks &amp; Spencer PLC</b>                        |                |                          |                                   | <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                                               |                |                          |                                   | 5,169 % fällig am 25.09.2035                                 |                | 49                       | 0,00                              |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027                          | £              | 6.138                    | 0,08                              | 5,214 % fällig am 25.06.2049                                                       |                | 15.618                   | 0,22                              | <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>     |                |                          |                                   |
| <b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>            |                |                          |                                   | <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                                             |                |                          |                                   | 4,419 % fällig am 25.07.2036                                 |                | 1.163                    | 0,01                              |
| 4,808 % fällig am 15.12.2030                          |                | 2.275                    | 0,03                              | 5,223 % fällig am 20.07.2053                                                       |                | 13.906                   | 0,20                              | 4,419 % fällig am 25.07.2036                                 |                | 20                       | 0,00                              |
| 5,111 % fällig am 15.12.2030                          | \$             | 917                      | 0,01                              | <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                                                    |                |                          |                                   | 4,574 % fällig am 25.07.2037                                 |                | 27                       | 0,00                              |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030                          | £              | 248                      | 0,00                              | 5,117 % fällig am 20.05.2066                                                       |                | 1.017                    | 0,02                              | 4,664 % fällig am 25.10.2047                                 |                | 264                      | 0,00                              |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032                          |                | 1.700                    | 0,02                              | <b>Trinity Square PLC</b>                                                          |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.06.2037                                 |                | 626                      | 0,01                              |
| <b>National Grid PLC</b>                              |                |                          |                                   | 5,217 % fällig am 15.07.2059                                                       |                | 4.029                    | 0,06                              | 4,874 % fällig am 25.09.2037                                 |                | 51                       | 0,00                              |
| 5,418 % fällig am 11.01.2034                          | \$             | 5.000                    | 0,05                              | 5,617 % fällig am 15.07.2059                                                       |                | 1.000                    | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.02.2037                                 |                | 2.600                    | 0,03                              |
| <b>Nationwide Building Society</b>                    |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.01.2046                                 |                | 5.537                    | 0,06                              |
| 5,750 % fällig am                                     |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 4,959 % fällig am 25.08.2036                                 |                | 2.901                    | 0,03                              |
| 20.06.2027 (g)(i)                                     | £              | 4.300                    | 0,06                              | Summe Großbritannien                                                               |                |                          |                                   | 4,994 % fällig am 25.04.2034                                 |                | 16                       | 0,00                              |
| <b>NatWest Group PLC</b>                              |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 5,054 % fällig am 25.09.2037                                 |                | 655                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am                                     |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 5,134 % fällig am 25.03.2036                                 |                | 1.118                    | 0,01                              |
| 29.12.2025 (g)(i)                                     | \$             | 17.800                   | 0,18                              |                                                                                    |                |                          |                                   | 5,154 % fällig am 25.07.2034                                 |                | 10                       | 0,00                              |
| <b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b> |                |                          |                                   | <b>USA</b>                                                                         |                |                          |                                   | 5,184 % fällig am 25.03.2034                                 |                | 18                       | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am                                     |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                            |                |                          |                                   | 5,274 % fällig am 25.10.2047                                 |                | 2.887                    | 0,03                              |
| 05.04.2032 (d)                                        |                | 19.529                   | 0,14                              | <b>AASET Apollo Aviation Securitization</b>                                        |                |                          |                                   | 5,289 % fällig am 25.08.2034                                 |                | 4                        | 0,00                              |
| <b>Pinnacle Bidco PLC</b>                             |                |                          |                                   | 5,522 % fällig am 16.02.2050                                                       | \$             | 8.300                    | 0,09                              | 5,334 % fällig am 25.03.2047                                 |                | 49                       | 0,00                              |
| 8,250 % fällig am 11.10.2028                          | €              | 6.000                    | 0,08                              | <b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>                                              |                |                          |                                   | 5,424 % fällig am 25.02.2036                                 |                | 10.608                   | 0,10                              |
| <b>Royalty Pharma PLC</b>                             |                |                          |                                   | 4,694 % fällig am 25.09.2036                                                       |                | 230                      | 0,00                              | 5,534 % fällig am 25.05.2047                                 |                | 674                      | 0,01                              |
| 3,300 % fällig am 02.09.2040                          | \$             | 5.000                    | 0,04                              | 5,379 % fällig am 25.09.2035                                                       |                | 7.750                    | 0,07                              | 5,934 % fällig am 25.02.2035                                 |                | 60                       | 0,00                              |
| <b>Santander UK Group Holdings PLC</b>                |                |                          |                                   | <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   | 6,009 % fällig am 25.11.2034                                 |                | 534                      | 0,01                              |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028                          |                | 15.824                   | 0,16                              | 4,734 % fällig am 25.04.2036                                                       |                | 184                      | 0,00                              | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b>  |                |                          |                                   |
| 4,858 % fällig am 11.09.2030                          |                | 2.000                    | 0,02                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                       |                | 10.925                   | 0,03                              | 4,562 % fällig am 25.01.2032                                 |                | 13                       | 0,00                              |
| 5,694 % fällig am 15.04.2031                          |                | 6.100                    | 0,07                              | 4,744 % fällig am 25.08.2036                                                       |                | 327                      | 0,00                              | <b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization LLC</b> |                |                          |                                   |
| <b>Tesco Property Finance PLC</b>                     |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.08.2036                                                       |                | 2.255                    | 0,01                              | 3,364 % fällig am 25.07.2036                                 |                | 2.831                    | 0,03                              |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040                          | £              | 1.863                    | 0,03                              | 4,794 % fällig am 25.02.2037                                                       |                | 2.762                    | 0,01                              | 4,654 % fällig am 25.07.2037                                 |                | 155                      | 0,00                              |
| <b>Thames Water Super Senior Issuer PLC</b>           |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.02.2037                                                       |                | 2.808                    | 0,01                              | <b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027                          |                | 466                      | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.02.2036                                                       |                | 131                      | 0,00                              | 5,484 % fällig am 25.05.2037                                 |                | 1.610                    | 0,02                              |
| <b>Thames Water Utilities Finance PLC</b>             |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.11.2035                                                       |                | 75                       | 0,00                              | <b>EMC Mortgage Loan Trust</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 18.01.2033                          | €              | 6.450                    | 0,05                              | 5,229 % fällig am 25.01.2035                                                       |                | 507                      | 0,01                              | 5,534 % fällig am 25.11.2041                                 |                | 3                        | 0,00                              |
| 5,125 % fällig am 28.09.2039                          | £              | 900                      | 0,01                              | 5,334 % fällig am 25.12.2034                                                       |                | 896                      | 0,01                              | <b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>                    |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 09.02.2034                          |                | 1.300                    | 0,01                              | 5,364 % fällig am 25.02.2036                                                       |                | 50                       | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.04.2036                                 |                | 90                       | 0,00                              |
| 7,125 % fällig am 30.04.2033                          |                | 1.400                    | 0,01                              | 5,409 % fällig am 25.06.2034                                                       |                | 344                      | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.04.2036                                 |                | 400                      | 0,00                              |
| <b>Thames Water Utilities Ltd.</b>                    |                |                          |                                   | <b>ACREC LLC</b>                                                                   |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.08.2036                                 |                | 116                      | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am                                     |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 18.08.2042                                                       |                | 1.800                    | 0,02                              | 5,379 % fällig am 25.03.2035                                 |                | 22                       | 0,00                              |
| 22.03.2027 (d)                                        |                | 68                       | 0,00                              | <b>Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates</b>      |                |                          |                                   | 5,634 % fällig am 25.01.2035                                 |                | 43                       | 0,00                              |
| <b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>               |                |                          |                                   | 5,079 % fällig am 25.12.2035                                                       |                | 2.958                    | 0,03                              | 5,859 % fällig am 25.10.2034                                 |                | 130                      | 0,00                              |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030                          |                | 27.700                   | 0,35                              | 5,434 % fällig am 25.03.2035                                                       |                | 131                      | 0,00                              | 6,309 % fällig am 25.07.2034                                 |                | 313                      | 0,00                              |
| <b>Vmed O2 UK Financing PLC</b>                       |                |                          |                                   | <b>Ameriquist Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | <b>First NLC Trust</b>                                       |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 31.01.2029                          |                | 15.775                   | 0,21                              | 5,304 % fällig am 25.07.2034                                                       |                | 25                       | 0,00                              | 1,656 % fällig am 25.05.2035                                 |                | 155                      | 0,00                              |
| 4,500 % fällig am 15.07.2031                          |                | 7.200                    | 0,09                              | 5,364 % fällig am 25.05.2035                                                       |                | 17                       | 0,00                              | <b>Fremont Home Loan Trust</b>                               |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | 5,454 % fällig am 25.09.2034                                                       |                | 303                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.02.2036                                 |                | 1.040                    | 0,01                              |
|                                                       |                |                          |                                   | 5,454 % fällig am 25.10.2034                                                       |                | 8                        | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.02.2037                                 |                | 1.024                    | 0,00                              |
|                                                       |                |                          |                                   | 5,469 % fällig am 25.01.2036                                                       |                | 9.300                    | 0,08                              | 5,364 % fällig am 25.06.2035                                 |                | 2.677                    | 0,03                              |
|                                                       |                |                          |                                   | 5,484 % fällig am 25.11.2034                                                       |                | 166                      | 0,00                              | <b>Greystone CRE Notes LLC</b>                               |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | 5,544 % fällig am 25.03.2035                                                       |                | 116                      | 0,00                              | 5,793 % fällig am 15.01.2043                                 |                | 17.000                   | 0,18                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>             |                |                          |                                   | <b>Amortizing Residential Collateral Trust</b>                                     |                |                          |                                   | <b>GSA Home Equity Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Ineos Finance PLC</b>                              |                |                          |                                   | 5,434 % fällig am 25.10.2034                                                       |                | 66                       | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.11.2036                                 |                | 394                      | 0,00                              |
| 4,679 % fällig am 08.11.2028                          | €              | 7.075                    | 0,08                              | <b>Argent Securities Trust</b>                                                     |                |                          |                                   | 4,674 % fällig am 25.04.2047                                 |                | 47                       | 0,00                              |
| <b>INEOS Quattro Holdings U.K. Ltd.</b>               |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.05.2036                                                       |                | 759                      | 0,00                              | 5,334 % fällig am 25.08.2037                                 |                | 14                       | 0,00                              |
| 6,429 % fällig am 02.04.2029                          |                | 4.769                    | 0,06                              | <b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>                                     |                |                          |                                   | <b>GSAMP Trust</b>                                           |                |                          |                                   |
| 8,677 % fällig am 02.04.2029                          | \$             | 9.090                    | 0,09                              | 4,654 % fällig am 25.01.2037                                                       |                | 159                      | 0,00                              | 3,610 % fällig am 25.11.2034                                 |                | 235                      | 0,00                              |
| <b>OCS Group Holdings Ltd.</b>                        |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.01.2037                                                       |                | 550                      | 0,00                              | 4,524 % fällig am 25.01.2037                                 |                | 245                      | 0,00                              |
| 9,961 % fällig am 28.11.2031                          | £              | 16.000                   | 0,22                              | 4,874 % fällig am 25.01.2037                                                       |                | 183                      | 0,00                              | 4,534 % fällig am 25.12.2046                                 |                | 213                      | 0,00                              |
| <b>Project Alfa</b>                                   |                |                          |                                   | 5,484 % fällig am 25.03.2034                                                       |                | 210                      | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.12.2036                                 |                | 5.274                    | 0,03                              |
| 4,256 % fällig am                                     |                |                          |                                   | 5,684 % fällig am 25.06.2037                                                       |                | 10.568                   | 0,08                              | 4,974 % fällig am 25.04.2036                                 |                | 2.589                    | 0,02                              |
| 27.02.2026 (j)                                        | €              | 1.701                    | 0,02                              | <b>Asset-Backed Pass-Through Certificates Series</b>                               |                |                          |                                   | <b>Home Equity Loan Trust</b>                                |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | 5,439 % fällig am 25.07.2035                                                       |                | 3.500                    | 0,03                              | 4,774 % fällig am 25.04.2037                                 |                | 2.000                    | 0,02                              |
|                                                       |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | <b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>          |                |                          |                                   |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                 |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 4,574 % fällig am 25.11.2036                                 |                | 236                      | 0,00                              |
| <b>Curzon Mortgages PLC</b>                           |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                          | £              | 45.318                   | 0,64                              |                                                                                    |                |                          |                                   |                                                              |                |                          |                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,674 % fällig am 25.04.2037                   | \$ 705         |                          |                                   | NovaStar Mortgage Funding Trust                                       | \$ 952         | \$ 315                   | 0,00                              | 5,364 % fällig am 25.01.2035                          | \$ 147         | \$ 145                   | 0,00                              |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust           |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.01.2037                                          |                |                          |                                   | 5,559 % fällig am 25.07.2033                          | 14             | 14                       | 0,00                              |
| 4,654 % fällig am 25.12.2036                   | 472            | 118                      | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.03.2037                                          | 806            | 266                      | 0,00                              | 5,814 % fällig am 25.04.2033                          | 11             | 11                       | 0,00                              |
| 4,694 % fällig am 25.12.2036                   | 9.495          | 3.561                    | 0,04                              | 4,734 % fällig am 25.03.2037                                          | 1.010          | 334                      | 0,00                              | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.01.2037                   | 2.721          | 1.948                    | 0,02                              | 4,854 % fällig am 25.01.2037                                          | 1.135          | 376                      | 0,01                              | 4,664 % fällig am 25.01.2037                          | 1.856          | 1.059                    | 0,01                              |
| 4,934 % fällig am 25.07.2036                   | 2.349          | 1.028                    | 0,01                              | 6,309 % fällig am 25.03.2035                                          | 318            | 314                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.12.2036                          | 58             | 58                       | 0,00                              |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust            |                |                          |                                   | Option One Mortgage Loan Trust                                        |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.02.2037                          | 92             | 91                       | 0,00                              |
| 4,214 % fällig am 25.01.2037                   | 438            | 217                      | 0,00                              | 4,604 % fällig am 25.05.2037                                          | 116            | 62                       | 0,00                              | 5,124 % fällig am 25.09.2035                          | 115            | 110                      | 0,00                              |
| 4,559 % fällig am 25.11.2036                   | 852            | 1.141                    | 0,01                              | 4,614 % fällig am 25.04.2037                                          | 1.003          | 490                      | 0,01                              | 6,234 % fällig am 25.08.2037                          | 12             | 12                       | 0,00                              |
| 4,694 % fällig am 25.03.2037                   | 69             | 68                       | 0,00                              | 4,684 % fällig am 25.07.2037                                          | 2.013          | 1.297                    | 0,01                              | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust             |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                   | 4.349          | 4.230                    | 0,04                              | 4,714 % fällig am 25.07.2036                                          | 12.400         | 7.128                    | 0,07                              | 4,734 % fällig am 25.01.2037                          | 1.295          | 1.120                    | 0,01                              |
| 4,839 % fällig am 25.07.2036                   | 95             | 94                       | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.01.2037                                          | 135            | 79                       | 0,00                              | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust     |                |                          |                                   |
| Lehman ABS Mortgage Loan Trust                 |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.01.2036                                          | 380            | 358                      | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.05.2036                          | 571            | 443                      | 0,01                              |
| 4,524 % fällig am 25.06.2037                   | 228            | 152                      | 0,00                              | 5,004 % fällig am 25.01.2036                                          | 7.092          | 5.551                    | 0,06                              | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.06.2037                   | 117            | 78                       | 0,00                              | 5,199 % fällig am 25.08.2035                                          | 238            | 232                      | 0,00                              | 5,174 % fällig am 25.04.2034                          | 117            | 117                      | 0,00                              |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                 |                |                          |                                   | Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,614 % fällig am 25.09.2036                   | 13.409         | 3.565                    | 0,04                              | 5,124 % fällig am 25.11.2035                                          | 291            | 280                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.05.2046                   | 2.359          | 707                      | 0,01                              | Ownit Mortgage Loan Trust                                             |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.02.2036                   | 10.478         | 9.033                    | 0,09                              | 5,334 % fällig am 25.10.2036                                          | 101            | 96                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.06.2035                   | 330            | 324                      | 0,00                              | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates    |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,709 % fällig am 25.02.2035                   | 1.358          | 1.337                    | 0,01                              | 5,169 % fällig am 25.08.2035                                          | 193            | 192                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| Lyra Music Assets Delaware LP                  |                |                          |                                   | 5,169 % fällig am 25.09.2035                                          | 3.407          | 3.344                    | 0,04                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,760 % fällig am 22.12.2064                   | 5.392          | 5.423                    | 0,06                              | 5,229 % fällig am 25.07.2035                                          | 2              | 2                        | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust            |                |                          |                                   | 5,259 % fällig am 25.07.2035                                          | 1.805          | 1.742                    | 0,02                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.08.2036                   | 4.675          | 1.372                    | 0,02                              | 5,484 % fällig am 25.10.2034                                          | 142            | 141                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.08.2036                   | 1.781          | 653                      | 0,01                              | 5,559 % fällig am 25.03.2035                                          | 115            | 113                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,704 % fällig am 25.08.2036                   | 3.152          | 1.155                    | 0,01                              | 5,684 % fällig am 25.01.2036                                          | 0              | 0                        | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.03.2036                   | 826            | 772                      | 0,01                              | 6,234 % fällig am 25.12.2034                                          | 290            | 289                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.02.2036                   | 310            | 113                      | 0,00                              | People's Choice Home Loan Securities Trust                            |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.03.2036                   | 890            | 530                      | 0,01                              | 5,784 % fällig am 25.01.2035                                          | 147            | 144                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,184 % fällig am 25.10.2035                   | 249            | 237                      | 0,00                              | People's Financial Realty Mortgage Securities Trust                   |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.02.2034                   | 379            | 387                      | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.09.2036                                          | 954            | 235                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,334 % fällig am 25.04.2034                   | 219            | 217                      | 0,00                              | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust                               |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,334 % fällig am 25.10.2035                   | 1.325          | 1.217                    | 0,01                              | 4,644 % fällig am 25.01.2037                                          | 233            | 225                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| MASTR Specialized Loan Trust                   |                |                          |                                   | RAAC Trust                                                            |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,559 % fällig am 25.11.2035                   | 104            | 100                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.06.2044                                          | 35             | 32                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust         |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.09.2045                                          | 38             | 37                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,400 % fällig am 25.11.2037                   | 5.237          | 1.644                    | 0,02                              | 5,134 % fällig am 25.11.2046                                          | 131            | 120                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.08.2037                   | 2.528          | 1.239                    | 0,01                              | 5,934 % fällig am 25.09.2047                                          | 334            | 332                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,154 % fällig am 25.05.2036                   | 10             | 10                       | 0,00                              | Renaissance Home Equity Loan Trust                                    |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,334 % fällig am 25.02.2047                   | 94             | 55                       | 0,00                              | 5,340 % fällig am 25.01.2037                                          | 1.336          | 411                      | 0,01                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.04.2035                   | 28             | 28                       | 0,00                              | Residential Asset Mortgage Products Trust                             |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust         |                |                          |                                   | 5,074 % fällig am 25.01.2036                                          | 327            | 303                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,504 % fällig am 25.10.2036                   | 62             | 27                       | 0,00                              | Residential Asset Securities Corp. Trust                              |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,564 % fällig am 25.11.2036                   | 285            | 125                      | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.11.2036                                          | 197            | 183                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,564 % fällig am 25.01.2037                   | 809            | 372                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.11.2036                                          | 49             | 45                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.10.2036                   | 1.797          | 784                      | 0,01                              | 4,994 % fällig am 25.04.2036                                          | 13             | 13                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.11.2036                   | 173            | 82                       | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.02.2036                                          | 96             | 96                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.05.2037                   | 2.907          | 2.237                    | 0,02                              | 5,094 % fällig am 25.12.2035                                          | 123            | 107                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,584 % fällig am 25.10.2036                   | 159            | 82                       | 0,00                              | Saxon Asset Securities Trust                                          |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.09.2036                   | 3              | 1                        | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.05.2047                                          | 5.695          | 4.156                    | 0,04                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.11.2036                   | 216            | 103                      | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.09.2047                                          | 9.995          | 9.300                    | 0,10                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,684 % fällig am 25.03.2037                   | 1.011          | 431                      | 0,01                              | 4,899 % fällig am 25.03.2036                                          | 1.016          | 993                      | 0,01                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.11.2036                   | 2.661          | 1.507                    | 0,02                              | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                        |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.09.2036                   | 1.562          | 674                      | 0,01                              | 4,714 % fällig am 25.07.2036                                          | 584            | 501                      | 0,01                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.03.2036                   | 82             | 68                       | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.03.2036                                          | 1.148          | 718                      | 0,01                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,054 % fällig am 25.12.2035                   | 68             | 67                       | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.05.2036                                          | 229            | 118                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,139 % fällig am 25.12.2034                   | 69             | 68                       | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.03.2036                                          | 90             | 83                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,139 % fällig am 25.01.2035                   | 1.380          | 1.369                    | 0,02                              | 5,094 % fällig am 25.08.2035                                          | 88             | 65                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,229 % fällig am 25.03.2034                   | 463            | 488                      | 0,01                              | SG Mortgage Securities Trust                                          |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,289 % fällig am 25.03.2034                   | 212            | 216                      | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.10.2036                                          | 1.500          | 1.139                    | 0,01                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,304 % fällig am 25.09.2035                   | 4.416          | 3.667                    | 0,04                              | Soundview Home Loan Trust                                             |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,424 % fällig am 25.06.2035                   | 213            | 213                      | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.11.2036                                          | 32             | 9                        | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,684 % fällig am 25.07.2037                   | 400            | 356                      | 0,00                              | 4,899 % fällig am 25.06.2036                                          | 13.290         | 11.875                   | 0,12                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 8,234 % fällig am 25.02.2047                   | 582            | 482                      | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.07.2036                                          | 185            | 170                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust |                |                          |                                   | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust                    |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,784 % fällig am 25.02.2033                   | 134            | 142                      | 0,00                              | 3,943 % fällig am 25.02.2037                                          | 452            | 147                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust          |                |                          |                                   | 4,704 % fällig am 25.04.2037                                          | 106            | 78                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,534 % fällig am 25.12.2036                   | 1.304          | 624                      | 0,01                              | 4,734 % fällig am 25.11.2037                                          | 583            | 321                      | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,664 % fällig am 25.04.2037                   | 2.145          | 1.113                    | 0,01                              | Structured Asset Investment Loan Trust                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.04.2036                   | 60             | 42                       | 0,00                              | 4,584 % fällig am 25.09.2036                                          | 22             | 22                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,784 % fällig am 25.04.2037                   | 14.649         | 7.602                    | 0,08                              | 4,734 % fällig am 25.06.2036                                          | 7              | 7                        | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust             |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.01.2036                                          | 41             | 40                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,960 % fällig am 25.11.2036                   | 211            | 78                       | 0,00                              | 5,109 % fällig am 25.11.2035                                          | 7.428          | 6.628                    | 0,07                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037                   | 49             | 27                       | 0,00                              | 5,199 % fällig am 25.08.2035                                          | 2.925          | 2.861                    | 0,03                              |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037                   | 9.462          | 3.241                    | 0,03                              | 5,334 % fällig am 25.09.2034                                          | 37             | 36                       | 0,00                              |                                                       |                |                          |                                   |
| New Century Home Equity Loan Trust             |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.05.2036                   | 4              | 4                        | 0,00                              |                                                                       |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,154 % fällig am 25.03.2035                   | 157            | 157                      | 0,00                              |                                                                       |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |

AKTIEN

STAMMAKTIE  
ENERGIE

New Fortress Energy, Inc. 'A' (c)

INDUSTRIEWERTE

Spirit Aviation Holdings, Inc. (c)

UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

AES Corp.

5,800 % fällig am 15.03.2032

Aethon United BR LP

7,500 % fällig am 01.10.2029

Alaska Airlines Pass-Through Trust

4,800 % fällig am 15.02.2029

Alcon Finance Corp.

5,375 % fällig am 06.12.2032

Alliant Holdings Intermediate LLC

6,500 % fällig am 01.10.2031

Ally Financial, Inc.

8,000 % fällig am 01.11.2031

AMC Networks, Inc.

4,250 % fällig am 15.02.2029

Amentum Holdings, Inc.

7,250 % fällig am 01.08.2032

American Airlines Pass-Through Trust

3,000 % fällig am 15.04.2030

3,150 % fällig am 15.08.2033

3,200 % fällig am 15.12.2029

3,350 % fällig am 15.04.2031

3,375 % fällig am 01.11.2028

3,575 % fällig am 15.07.2029

3,650 % fällig am 15.12.2029

3,650 % fällig am 15.08.2030

3,700 % fällig am 01.04.2028

American Builders & Contractors Supply Co., Inc.

4,000 % fällig am 15.01.2028

American Express Co.

5,667 % fällig am 25.04.2036

American Tower Corp.

2,950 % fällig am 15.01.2051

4,100 % fällig am 16.05.2034

5,200 % fällig am 15.02.2029

5,450 % fällig am 15.02.2034

5,900 % fällig am 15.11.2033

Amgen, Inc.

5,250 % fällig am 02.03.2033

5,750 % fällig am 02.03.2063

Antares Holdings LP

2,750 % fällig am 15.01.2027

6,350 % fällig am 23.10.2029

AppLovin Corp.

5,125 % fällig am 01.12.2029

|                                     |          |          | % DES  |                                       |           |          | % DES  |                                                        |           |        | % DES  |
|-------------------------------------|----------|----------|--------|---------------------------------------|-----------|----------|--------|--------------------------------------------------------|-----------|--------|--------|
| BESCHREIBUNG                        | PARI     | MARKT-   | NETTO- | BESCHREIBUNG                          | PARI      | MARKT-   | NETTO- | BESCHREIBUNG                                           | PARI      | MARKT- | NETTO- |
|                                     | (000S)   | WERT     | VERMÖ- |                                       | (000S)    | WERT     | VERMÖ- |                                                        | (000S)    | WERT   | VERMÖ- |
|                                     |          | (000S)   | GENS   |                                       |           | (000S)   | GENS   |                                                        |           | (000S) | GENS   |
| Ares Strategic Income Fund          |          |          |        | 3,375 % fällig am 15.02.2030          | \$ 9.300  | \$ 8.572 | 0,09   | 6,625 % fällig am 15.10.2036                           | \$ 800    | \$ 864 | 0,01   |
| 6,200 % fällig am 21.03.2032        | \$ 5.000 | \$ 5.017 | 0,05   | 4,625 % fällig am 15.12.2029          | 12.200    | 11.874   | 0,12   | 7,500 % fällig am 01.07.2038                           | 12.865    | 14.740 | 0,15   |
| Arthur J Gallagher & Co.            |          |          |        | Charter Communications Operating LLC  |           |          |        | Entergy Louisiana LLC                                  |           |        |        |
| 5,150 % fällig am 15.02.2035        | 5.000    | 5.005    | 0,05   | 3,850 % fällig am 01.04.2061          | 32.900    | 21.096   | 0,22   | 5,150 % fällig am 15.09.2034                           | 8.700     | 8.756  | 0,09   |
| Ascent Resources Utica Holdings LLC |          |          |        | Cheniere Energy Partners LP           |           |          |        | 5,350 % fällig am 15.03.2034                           | 5.000     | 5.132  | 0,05   |
| 6,625 % fällig am 15.10.2032        | 4.150    | 4.227    | 0,04   | 4,000 % fällig am 01.03.2031          | 6.000     | 5.712    | 0,06   | EPR Properties                                         |           |        |        |
| Ashtead Capital, Inc.               |          |          |        | Chobani LLC                           |           |          |        | 3,750 % fällig am 15.08.2029                           | 3.000     | 2.858  | 0,03   |
| 5,800 % fällig am 15.04.2034        | 9.300    | 9.523    | 0,10   | 4,625 % fällig am 15.11.2028          | 5.000     | 4.912    | 0,05   | EQT Corp.                                              |           |        |        |
| AT&T, Inc.                          |          |          |        | Chord Energy Corp.                    |           |          |        | 4,750 % fällig am 15.01.2031                           | 14.175    | 13.960 | 0,14   |
| 3,800 % fällig am 01.12.2057        | 12.425   | 8.702    | 0,09   | 6,750 % fällig am 15.03.2033          | 11.650    | 11.909   | 0,12   | Equinix Europe Financing Corp. LLC                     |           |        |        |
| Aviation Capital Group LLC          |          |          |        | Citadel Finance LLC                   |           |          |        | 3,250 % fällig am 15.03.2031                           | € 8.100   | 9.423  | 0,10   |
| 4,875 % fällig am 01.10.2025        | 600      | 600      | 0,01   | 5,900 % fällig am 10.02.2030          | 16.600    | 16.765   | 0,17   | 3,625 % fällig am 22.11.2034                           | 3.700     | 4.231  | 0,04   |
| Axalta Coating Systems LLC          |          |          |        | Citigroup, Inc.                       |           |          |        | Esab Corp.                                             |           |        |        |
| 3,375 % fällig am 15.02.2029        | 7.000    | 6.636    | 0,07   | 2,572 % fällig am 03.06.2031          | 6.900     | 6.259    | 0,06   | 6,250 % fällig am 15.04.2029                           | \$ 5.150  | 5.279  | 0,05   |
| Axon Enterprise, Inc.               |          |          |        | Citizens Financial Group, Inc.        |           |          |        | Exelon Corp.                                           |           |        |        |
| 6,125 % fällig am 15.03.2030        | 12.000   | 12.370   | 0,13   | 5,253 % fällig am 05.03.2031          | 8.250     | 8.362    | 0,09   | 5,450 % fällig am 15.03.2034                           | 6.000     | 6.160  | 0,06   |
| B&G Foods, Inc.                     |          |          |        | Cloud Software Group, Inc.            |           |          |        | Expand Energy Corp.                                    |           |        |        |
| 8,000 % fällig am 15.09.2028        | 5.000    | 4.820    | 0,05   | 6,500 % fällig am 31.03.2029          | 8.600     | 8.686    | 0,09   | 4,750 % fällig am 01.02.2032                           | 16.800    | 16.347 | 0,17   |
| Bank of America Corp.               |          |          |        | Clue Opco LLC                         |           |          |        | F&G Global Funding                                     |           |        |        |
| 2,592 % fällig am 29.04.2031        | 10.000   | 9.145    | 0,09   | 9,500 % fällig am 15.10.2031          | 1.625     | 1.724    | 0,02   | 5,875 % fällig am 16.01.2030                           | 2.800     | 2.881  | 0,03   |
| 3,261 % fällig am 28.01.2031        | € 7.500  | 8.871    | 0,09   | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. |           |          |        | Fidelity National Financial, Inc.                      |           |        |        |
| 4,571 % fällig am 27.04.2033        | \$ 5.000 | 4.922    | 0,05   | 6,750 % fällig am 15.04.2032          | 8.500     | 8.729    | 0,09   | 3,400 % fällig am 15.06.2030                           | 200       | 187    | 0,00   |
| 5,202 % fällig am 25.04.2029        | 15.000   | 15.332   | 0,16   | 6,875 % fällig am 15.01.2030          | 7.200     | 7.369    | 0,08   | First Student Bidco, Inc.                              |           |        |        |
| 5,288 % fällig am 25.04.2034        | 5.950    | 6.071    | 0,06   | CNO Global Funding                    |           |          |        | 4,000 % fällig am 31.07.2029                           | 4.300     | 4.045  | 0,04   |
| 5,468 % fällig am 23.01.2035        | 10.000   | 10.277   | 0,11   | 4,875 % fällig am 10.12.2027          | 1.300     | 1.311    | 0,01   | Fiserv, Inc.                                           |           |        |        |
| Bayer U.S. Finance LLC              |          |          |        | Cogent Communications Group LLC       |           |          |        | 5,625 % fällig am 21.08.2033                           | 5.000     | 5.201  | 0,05   |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028        | 8.235    | 8.160    | 0,08   | 6,500 % fällig am 01.07.2032          | 7.300     | 7.198    | 0,07   | Ford Motor Credit Co. LLC                              |           |        |        |
| 6,125 % fällig am 21.11.2026        | 5.457    | 5.548    | 0,06   | Community Health Systems, Inc.        |           |          |        | 2,386 % fällig am 17.02.2026                           | € 4.200   | 4.920  | 0,05   |
| Beacon Mobility Corp.               |          |          |        | 6,000 % fällig am 15.01.2029          | 9.200     | 8.857    | 0,09   | 2,700 % fällig am 10.08.2026                           | \$ 11.600 | 11.297 | 0,12   |
| 7,250 % fällig am 01.08.2030 (a)    | 8.600    | 8.788    | 0,09   | 10,875 % fällig am 15.01.2032         | 3.900     | 4.138    | 0,04   | 3,815 % fällig am 02.11.2027                           | 1.200     | 1.159  | 0,01   |
| BGC Group, Inc.                     |          |          |        | Coty, Inc.                            |           |          |        | 4,125 % fällig am 17.08.2027                           | 6.100     | 5.964  | 0,06   |
| 6,600 % fällig am 10.06.2029        | 3.500    | 3.629    | 0,04   | 3,875 % fällig am 15.04.2026          | € 16.400  | 19.282   | 0,20   | 4,271 % fällig am 09.01.2027                           | 1.700     | 1.676  | 0,02   |
| Block, Inc.                         |          |          |        | CQP Holdco LP                         |           |          |        | 4,389 % fällig am 08.01.2026                           | 1.800     | 1.792  | 0,02   |
| 6,500 % fällig am 15.05.2032        | 17.375   | 17.938   | 0,18   | 5,500 % fällig am 15.06.2031          | \$ 23.125 | 22.861   | 0,23   | 4,542 % fällig am 01.08.2026                           | 1.900     | 1.887  | 0,02   |
| Blue Owl Finance LLC                |          |          |        | Credit Acceptance Corp.               |           |          |        | 5,850 % fällig am 17.05.2027                           | 4.300     | 4.335  | 0,04   |
| 6,250 % fällig am 18.04.2034        | 5.875    | 6.048    | 0,06   | 9,250 % fällig am 15.12.2028          | 5.050     | 5.352    | 0,06   | 5,875 % fällig am 07.11.2029                           | 9.000     | 9.030  | 0,09   |
| Boeing Co.                          |          |          |        | Crowdstrike Holdings, Inc.            |           |          |        | 7,350 % fällig am 04.11.2027                           | 1.100     | 1.143  | 0,01   |
| 3,250 % fällig am 01.02.2028        | 7.500    | 7.276    | 0,07   | 3,000 % fällig am 15.02.2029          | 10.200    | 9.657    | 0,10   | Fortress Intermediate, Inc.                            |           |        |        |
| 3,950 % fällig am 01.08.2059        | 1.500    | 1.026    | 0,01   | Crown Castle, Inc.                    |           |          |        | 7,500 % fällig am 01.06.2031                           | 4.750     | 4.982  | 0,05   |
| 5,150 % fällig am 01.05.2030        | 10.700   | 10.899   | 0,11   | 2,100 % fällig am 01.04.2031          | 6.500     | 5.580    | 0,06   | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC |           |        |        |
| 5,805 % fällig am 01.05.2050        | 1.400    | 1.344    | 0,01   | 2,250 % fällig am 15.01.2031          | 4.000     | 3.481    | 0,04   | 5,500 % fällig am 01.05.2028                           | 19.750    | 19.656 | 0,20   |
| 5,930 % fällig am 01.05.2060        | 10.000   | 9.514    | 0,10   | 2,500 % fällig am 15.07.2031          | 5.000     | 4.366    | 0,04   | 7,000 % fällig am 01.05.2031                           | 10.400    | 10.776 | 0,11   |
| 6,298 % fällig am 01.05.2029        | 1.700    | 1.798    | 0,02   | 5,000 % fällig am 11.01.2028          | 6.500     | 6.566    | 0,07   | Freedom Mortgage Corp.                                 |           |        |        |
| 7,008 % fällig am 01.05.2064        | 1.700    | 1.869    | 0,02   | CVS Health Corp.                      |           |          |        | 7,625 % fällig am 01.05.2026                           | 22.600    | 22.623 | 0,23   |
| Boost Newco Borrower LLC            |          |          |        | 3,250 % fällig am 15.08.2029          | 4.305     | 4.092    | 0,04   | Frontier Communications Holdings LLC                   |           |        |        |
| 7,500 % fällig am 15.01.2031        | 4.475    | 4.753    | 0,05   | DAE Funding LLC                       |           |          |        | 5,875 % fällig am 15.10.2027                           | 2.125     | 2.127  | 0,02   |
| Booz Allen Hamilton, Inc.           |          |          |        | 3,375 % fällig am 20.03.2028          | 3.725     | 3.587    | 0,04   | GA Global Funding Trust                                |           |        |        |
| 3,875 % fällig am 01.09.2028        | 4.200    | 4.075    | 0,04   | DCLI BidCo LLC                        |           |          |        | 5,400 % fällig am 13.01.2030                           | 1.600     | 1.644  | 0,02   |
| 5,950 % fällig am 15.04.2035        | 5.000    | 5.087    | 0,05   | 7,750 % fällig am 15.11.2029          | 6.000     | 6.083    | 0,06   | 5,900 % fällig am 13.01.2035                           | 2.400     | 2.436  | 0,03   |
| British Airways Pass-Through Trust  |          |          |        | Dell International LLC                |           |          |        | Gartner, Inc.                                          |           |        |        |
| 2,900 % fällig am 15.09.2036        | 1.081    | 976      | 0,01   | 8,100 % fällig am 15.07.2036          | 2.337     | 2.818    | 0,03   | 3,625 % fällig am 15.06.2029                           | 3.000     | 2.855  | 0,03   |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034        | 2.046    | 1.966    | 0,02   | Diamondback Energy, Inc.              |           |          |        | 3,750 % fällig am 01.10.2030                           | 5.000     | 4.682  | 0,05   |
| Brixmor Operating Partnership LP    |          |          |        | 5,550 % fällig am 01.04.2035          | 5.000     | 5.057    | 0,05   | Genesis Energy LP                                      |           |        |        |
| 5,200 % fällig am 01.04.2032        | 5.400    | 5.446    | 0,06   | Duke Energy Indiana LLC               |           |          |        | 7,875 % fällig am 15.05.2032                           | 2.600     | 2.706  | 0,03   |
| Broadcom, Inc.                      |          |          |        | 5,250 % fällig am 01.03.2034          | 9.000     | 9.207    | 0,09   | 8,250 % fällig am 15.01.2029                           | 4.100     | 4.290  | 0,04   |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031        | 8.900    | 7.961    | 0,08   | EchoStar Corp.                        |           |          |        | Georgia Power Co.                                      |           |        |        |
| 3,187 % fällig am 15.11.2036        | 2.600    | 2.156    | 0,02   | 10,750 % fällig am 30.11.2029         | 5.125     | 5.283    | 0,05   | 5,250 % fällig am 15.03.2034                           | 11.600    | 11.837 | 0,12   |
| 4,150 % fällig am 15.02.2028        | 3.600    | 3.590    | 0,04   | Edison International                  |           |          |        | Global Atlantic Fin Co.                                |           |        |        |
| 4,350 % fällig am 15.02.2030        | 3.500    | 3.488    | 0,04   | 5,450 % fällig am 15.06.2029          | 3.100     | 3.067    | 0,03   | 4,400 % fällig am 15.10.2029                           | 11.620    | 11.284 | 0,12   |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037        | 1.242    | 1.206    | 0,01   | 5,750 % fällig am 15.06.2027          | 300       | 302      | 0,00   | Global Medical Response, Inc. (9,500 % PIK)            |           |        |        |
| Builders FirstSource, Inc.          |          |          |        | El Paso Natural Gas Co. LLC           |           |          |        | 9,500 % fällig am 31.10.2028 (b)                       | 7.688     | 7.722  | 0,08   |
| 4,250 % fällig am 01.02.2032        | 7.175    | 6.652    | 0,07   | 8,375 % fällig am 15.06.2032          | 1.000     | 1.176    | 0,01   | GLP Capital LP                                         |           |        |        |
| 6,375 % fällig am 01.03.2034        | 4.000    | 4.081    | 0,04   | Elevance Health, Inc.                 |           |          |        | 5,750 % fällig am 01.06.2028                           | 6.720     | 6.890  | 0,07   |
| 6,750 % fällig am 15.05.2035        | 6.550    | 6.752    | 0,07   | 4,750 % fällig am 15.02.2033          | 2.400     | 2.386    | 0,02   | 6,250 % fällig am 15.09.2054                           | 3.500     | 3.419  | 0,04   |
| CACI International, Inc.            |          |          |        | 5,850 % fällig am 01.11.2064          | 3.475     | 3.377    | 0,03   | Goat Holdco LLC                                        |           |        |        |
| 6,375 % fällig am 15.06.2033        | 6.100    | 6.303    | 0,06   | Ellucian Holdings, Inc.               |           |          |        | 6,750 % fällig am 01.02.2032                           | 8.700     | 8.852  | 0,09   |
| Cantor Fitzgerald LP                |          |          |        | 6,500 % fällig am 01.12.2029          | 6.000     | 6.151    | 0,06   | Goldman Sachs Group, Inc.                              |           |        |        |
| 7,200 % fällig am 12.12.2028        | 4.950    | 5.256    | 0,05   | Encore Capital Group, Inc.            |           |          |        | 2,615 % fällig am 22.04.2032                           | 5.375     | 4.779  | 0,05   |
| Carvana Co. (13,000 % PIK)          |          |          |        | 8,500 % fällig am 15.05.2030          | 7.575     | 8.131    | 0,08   | 5,049 % fällig am 23.07.2030                           | 4.700     | 4.779  | 0,05   |
| 13,000 % fällig am 01.06.2030 (b)   | 7.345    | 7.729    | 0,08   | 9,250 % fällig am 01.04.2029          | 5.250     | 5.590    | 0,06   | 5,330 % fällig am 23.07.2035                           | 17.275    | 17.433 | 0,18   |
| Carvana Co. (14,000 % PIK)          |          |          |        | Energy Transfer LP                    |           |          |        | 5,727 % fällig am 25.04.2030                           | 7.950     | 8.277  | 0,09   |
| 14,000 % fällig am 01.06.2031 (b)   | 900      | 1.037    | 0,01   | 4,950 % fällig am 15.05.2028          | 14.763    | 14.975   | 0,15   | Gray Oak Pipeline LLC                                  |           |        |        |
| Centene Corp.                       |          |          |        | 5,950 % fällig am 01.10.2043          | 200       | 190      | 0,00   | 3,450 % fällig am 15.10.2027                           | 6.900     | 6.755  | 0,07   |
| 3,000 % fällig am 15.10.2030        | 5.000    | 4.471    | 0,05   | 6,050 % fällig am 01.06.2041          | 3.811     | 3.818    | 0,04   | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc.            |           |        |        |
|                                     |          |          |        | 6,100 % fällig am 15.02.2042          | 800       | 792      | 0,01   | 6,150 % fällig am 15.01.2031                           | 9.900     | 10.027 | 0,10   |
|                                     |          |          |        | 6,500 % fällig am 01.02.2042          | 7.140     | 7.407    | 0,08   | 6,375 % fällig am 01.07.2034                           | 5.700     | 5.704  | 0,06   |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

|                                      |                |                          |                          | % DES                                |                |                          |                          |                                          |                              |                          |                          | % DES        |                |                          |                          |
|--------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|------------------------------------------|------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------|----------------|--------------------------|--------------------------|
| BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S)               | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
| HAT Holdings LLC                     |                |                          |                          | 5,200 % fällig am 01.03.2035         | \$             | 5.000                    | \$ 5.062                 | 0,05                                     | 4,450 % fällig am 15.04.2042 | \$                       | 3.500                    | \$ 2.784     | 0,03           |                          |                          |
| 3,375 % fällig am 15.06.2026         | \$ 1.675       | \$ 1.641                 | 0,02                     | Marvell Technology, Inc.             |                |                          |                          |                                          | 4,500 % fällig am 01.07.2040 |                          | 9.396                    | 7.837        | 0,08           |                          |                          |
| 3,750 % fällig am 15.09.2030         | 2.085          | 1.915                    | 0,02                     | 5,750 % fällig am 15.02.2029         | 10.200         | 10.623                   | 0,11                     | 4,600 % fällig am 15.06.2043             | 3.600                        | 2.856                    | 0,03                     |              |                |                          |                          |
| 8,000 % fällig am 15.06.2027         | 5.300          | 5.528                    | 0,06                     | Matador Resources Co.                |                |                          |                          | 4,650 % fällig am 01.08.2028             | 100                          | 100                      | 0,00                     |              |                |                          |                          |
| HCA, Inc.                            |                |                          |                          | 6,250 % fällig am 15.04.2033         | 1.950          | 1.940                    | 0,02                     | PacifiCorp                               |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 3,500 % fällig am 15.07.2051         | 5.000          | 3.315                    | 0,03                     | Medline Borrower LP                  |                |                          |                          | 5,300 % fällig am 15.02.2031             | 3.300                        | 3.401                    | 0,03                     |              |                |                          |                          |
| 4,625 % fällig am 15.03.2052         | 4.100          | 3.298                    | 0,03                     | 3,875 % fällig am 01.04.2029         | 11.325         | 10.871                   | 0,11                     | 5,450 % fällig am 15.02.2034             | 9.000                        | 9.132                    | 0,09                     |              |                |                          |                          |
| 5,500 % fällig am 01.06.2033         | 4.925          | 5.044                    | 0,05                     | 5,250 % fällig am 01.10.2029         | 3.650          | 3.624                    | 0,04                     | Panther Escrow Issuer LLC                |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 5,750 % fällig am 01.03.2035         | 5.000          | 5.145                    | 0,05                     | 6,250 % fällig am 01.04.2029         | 4.200          | 4.320                    | 0,04                     | 7,125 % fällig am 01.06.2031             | 13.000                       | 13.512                   | 0,14                     |              |                |                          |                          |
| 5,900 % fällig am 01.06.2053         | 1.775          | 1.715                    | 0,02                     | Molina Healthcare, Inc.              |                |                          |                          | PennyMac Financial Services, Inc.        |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc.  |                |                          |                          | 3,875 % fällig am 15.11.2030         | 2.000          | 1.862                    | 0,02                     | 7,125 % fällig am 15.11.2030             | 11.250                       | 11.667                   | 0,12                     |              |                |                          |                          |
| 5,875 % fällig am 15.03.2033         | 3.450          | 3.517                    | 0,04                     | Morgan Stanley                       |                |                          |                          | Permian Resources Operating LLC          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Hologic, Inc.                        |                |                          |                          | 3,955 % fällig am 21.03.2035         | € 7.700        | 9.250                    | 0,10                     | 6,250 % fällig am 01.02.2033             | 8.125                        | 8.206                    | 0,08                     |              |                |                          |                          |
| 3,250 % fällig am 15.02.2029         | 7.000          | 6.676                    | 0,07                     | 4,654 % fällig am 18.10.2030         | \$ 10.000      | 10.021                   | 0,10                     | Plains All American Pipeline LP          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Host Hotels & Resorts LP             |                |                          |                          | 5,192 % fällig am 17.04.2031         | 3.300          | 3.384                    | 0,03                     | 5,150 % fällig am 01.06.2042             | 7.177                        | 6.402                    | 0,07                     |              |                |                          |                          |
| 5,500 % fällig am 15.04.2035         | 10.000         | 9.904                    | 0,10                     | 5,250 % fällig am 21.04.2034         | 5.000          | 5.088                    | 0,05                     | 6,650 % fällig am 15.01.2037             | 2.090                        | 2.257                    | 0,02                     |              |                |                          |                          |
| Howard Midstream Energy Partners LLC |                |                          |                          | 5,320 % fällig am 19.07.2035         | 9.575          | 9.696                    | 0,10                     | Post Holdings, Inc.                      |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 7,375 % fällig am 15.07.2032         | 5.275          | 5.552                    | 0,06                     | 5,664 % fällig am 17.04.2036         | 10.000         | 10.366                   | 0,11                     | 5,500 % fällig am 15.12.2029             | 3.900                        | 3.886                    | 0,04                     |              |                |                          |                          |
| HPS Corporate Lending Fund           |                |                          |                          | MPH Acquisition Holdings LLC         |                |                          |                          | 6,250 % fällig am 15.10.2034             | 4.200                        | 4.234                    | 0,04                     |              |                |                          |                          |
| 5,450 % fällig am 14.01.2028         | 7.000          | 7.022                    | 0,07                     | 5,750 % fällig am 31.12.2030         | 944            | 778                      | 0,01                     | PRA Group, Inc.                          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Hyatt Hotels Corp.                   |                |                          |                          | 11,500 % fällig am 31.12.2030        | 493            | 489                      | 0,01                     | 8,875 % fällig am 31.01.2030             | 3.150                        | 3.250                    | 0,03                     |              |                |                          |                          |
| 5,375 % fällig am 15.12.2031         | 4.000          | 4.058                    | 0,04                     | National Fuel Gas Co.                |                |                          |                          | Prime Healthcare Services, Inc.          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| IHG Finance LLC                      |                |                          |                          | 2,950 % fällig am 01.03.2031         | 1.017          | 908                      | 0,01                     | 9,375 % fällig am 01.09.2029             | 4.325                        | 4.296                    | 0,04                     |              |                |                          |                          |
| 3,625 % fällig am 27.09.2031         | € 7.300        | 8.607                    | 0,09                     | National Grid North America, Inc.    |                |                          |                          | Prime Security Services Borrower LLC     |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Imola Merger Corp.                   |                |                          |                          | 1,054 % fällig am 20.01.2031         | € 2.000        | 2.092                    | 0,02                     | 3,375 % fällig am 31.08.2027             | 8.275                        | 8.022                    | 0,08                     |              |                |                          |                          |
| 4,750 % fällig am 15.05.2029         | \$ 12.625      | 12.197                   | 0,13                     | 3,150 % fällig am 03.06.2030         | 4.700          | 5.516                    | 0,06                     | 5,750 % fällig am 15.04.2026             | 6.400                        | 6.439                    | 0,07                     |              |                |                          |                          |
| Ingevity Corp.                       |                |                          |                          | 3,631 % fällig am 03.09.2031         | 3.250          | 3.886                    | 0,04                     | Primo Water Holdings, Inc.               |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 3,875 % fällig am 01.11.2028         | 10.325         | 9.854                    | 0,10                     | 3,724 % fällig am 25.11.2034         | 7.000          | 8.183                    | 0,08                     | 6,250 % fällig am 01.04.2029             | 12.400                       | 12.497                   | 0,13                     |              |                |                          |                          |
| IQVIA, Inc.                          |                |                          |                          | Nationstar Mortgage Holdings, Inc.   |                |                          |                          | Quikrete Holdings, Inc.                  |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 5,700 % fällig am 15.05.2028         | 2.000          | 2.052                    | 0,02                     | 6,500 % fällig am 01.08.2029         | \$ 8.000       | 8.177                    | 0,08                     | 6,375 % fällig am 01.03.2032             | 12.750                       | 13.119                   | 0,13                     |              |                |                          |                          |
| 6,250 % fällig am 01.06.2032         | 20.100         | 20.652                   | 0,21                     | 7,125 % fällig am 01.02.2032         | 2.950          | 3.066                    | 0,03                     | 6,750 % fällig am 01.03.2033             | 3.550                        | 3.665                    | 0,04                     |              |                |                          |                          |
| Jackson National Life Global Funding |                |                          |                          | Netflix, Inc.                        |                |                          |                          | QXO Building Products, Inc.              |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 4,600 % fällig am 01.10.2029         | 6.400          | 6.393                    | 0,07                     | 4,875 % fällig am 15.06.2030 (k)     | 11.000         | 11.259                   | 0,12                     | 6,750 % fällig am 30.04.2032             | 5.775                        | 5.964                    | 0,06                     |              |                |                          |                          |
| Jane Street Group                    |                |                          |                          | Newfold Digital Holdings Group, Inc. |                |                          |                          | Raising Cane's Restaurants LLC           |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 6,125 % fällig am 01.11.2032         | 10.450         | 10.556                   | 0,11                     | 11,750 % fällig am 15.10.2028        | 1.200          | 906                      | 0,01                     | 9,375 % fällig am 01.05.2029             | 4.300                        | 4.543                    | 0,05                     |              |                |                          |                          |
| 7,125 % fällig am 30.04.2031         | 13.900         | 14.635                   | 0,15                     | Newmark Group, Inc.                  |                |                          |                          | Rand Parent LLC                          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| JetBlue Pass-Through Trust           |                |                          |                          | 7,500 % fällig am 12.01.2029         | 3.250          | 3.441                    | 0,04                     | 8,500 % fällig am 15.02.2030             | 425                          | 427                      | 0,00                     |              |                |                          |                          |
| 2,750 % fällig am 15.11.2033         | 744            | 653                      | 0,01                     | NGPL PipeCo LLC                      |                |                          |                          | Raven Acquisition Holdings LLC           |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034         | 8.205          | 7.701                    | 0,08                     | 7,768 % fällig am 15.12.2037         | 16.081         | 18.388                   | 0,19                     | 6,875 % fällig am 15.11.2031             | 6.700                        | 6.717                    | 0,07                     |              |                |                          |                          |
| JPMorgan Chase & Co.                 |                |                          |                          | NLG Global Funding                   |                |                          |                          | RELX Capital, Inc.                       |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 4,586 % fällig am 26.04.2033         | 5.000          | 4.950                    | 0,05                     | 5,400 % fällig am 23.01.2030         | 9.300          | 9.579                    | 0,10                     | 5,250 % fällig am 27.03.2035             | 5.000                        | 5.118                    | 0,05                     |              |                |                          |                          |
| 4,603 % fällig am 22.10.2030         | 4.000          | 4.014                    | 0,04                     | Noble Finance LLC                    |                |                          |                          | RFNA LP                                  |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 4,995 % fällig am 22.07.2030         | 6.200          | 6.315                    | 0,06                     | 8,000 % fällig am 15.04.2030         | 15.675         | 15.974                   | 0,16                     | 7,875 % fällig am 15.02.2030             | 2.000                        | 2.048                    | 0,02                     |              |                |                          |                          |
| 5,040 % fällig am 23.01.2028         | 4.000          | 4.039                    | 0,04                     | NuStar Logistics LP                  |                |                          |                          | RGA Global Funding                       |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 5,103 % fällig am 22.04.2031         | 2.400          | 2.460                    | 0,03                     | 5,625 % fällig am 28.04.2027         | 20.400         | 20.590                   | 0,21                     | 5,250 % fällig am 09.01.2030             | 8.400                        | 8.624                    | 0,09                     |              |                |                          |                          |
| 5,294 % fällig am 22.07.2035         | 7.825          | 7.966                    | 0,08                     | Occidental Petroleum Corp.           |                |                          |                          | Rio Oil Finance Trust                    |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 5,572 % fällig am 22.04.2036         | 10.000         | 10.367                   | 0,11                     | 6,625 % fällig am 01.09.2030         | 15.850         | 16.770                   | 0,17                     | 8,200 % fällig am 06.04.2028             | 945                          | 986                      | 0,01                     |              |                |                          |                          |
| 5,581 % fällig am 22.04.2030         | 1.700          | 1.766                    | 0,02                     | Olympus Water U.S. Holding Corp.     |                |                          |                          | 9,750 % fällig am 06.01.2027             | 1.063                        | 1.100                    | 0,01                     |              |                |                          |                          |
| 5,766 % fällig am 22.04.2035         | 11.000         | 11.561                   | 0,12                     | 7,250 % fällig am 15.06.2031         | 5.000          | 5.104                    | 0,05                     | RLJ Lodging Trust LP                     |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Kennedy-Wilson, Inc.                 |                |                          |                          | Omega Healthcare Investors, Inc.     |                |                          |                          | 3,750 % fällig am 01.07.2026             | 3.600                        | 3.566                    | 0,04                     |              |                |                          |                          |
| 4,750 % fällig am 01.02.2030         | 15.200         | 13.935                   | 0,14                     | 4,750 % fällig am 15.01.2028         | 200            | 201                      | 0,00                     | Rocket Cos., Inc.                        |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Kodiak Gas Services LLC              |                |                          |                          | OneMain Finance Corp.                |                |                          |                          | 6,125 % fällig am 01.08.2030             | 4.800                        | 4.894                    | 0,05                     |              |                |                          |                          |
| 7,250 % fällig am 15.02.2029         | 1.275          | 1.320                    | 0,01                     | 7,125 % fällig am 15.03.2026         | 1.206          | 1.225                    | 0,01                     | Rockies Express Pipeline LLC             |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Kraken Oil & Gas Partners LLC        |                |                          |                          | 7,125 % fällig am 15.11.2031         | 10.355         | 10.781                   | 0,11                     | 4,800 % fällig am 15.05.2030             | 550                          | 534                      | 0,01                     |              |                |                          |                          |
| 7,625 % fällig am 15.08.2029         | 7.400          | 7.276                    | 0,07                     | 7,125 % fällig am 15.09.2032         | 10.200         | 10.573                   | 0,11                     | 4,950 % fällig am 15.07.2029             | 2.175                        | 2.137                    | 0,02                     |              |                |                          |                          |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP |                |                          |                          | ONEOK, Inc.                          |                |                          |                          | Rollins, Inc.                            |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 5,500 % fällig am 01.08.2030 (a)     | 8.700          | 8.762                    | 0,09                     | 4,750 % fällig am 15.10.2031         | 4.175          | 4.136                    | 0,04                     | 5,250 % fällig am 24.02.2035             | 3.000                        | 3.013                    | 0,03                     |              |                |                          |                          |
| 7,000 % fällig am 15.07.2031         | 1.400          | 1.465                    | 0,02                     | 5,850 % fällig am 01.11.2064         | 2.125          | 1.972                    | 0,02                     | Sammons Financial Group, Inc.            |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Las Vegas Sands Corp.                |                |                          |                          | 6,500 % fällig am 01.09.2030         | 2.475          | 2.645                    | 0,03                     | 6,875 % fällig am 15.04.2034             | 6.550                        | 7.029                    | 0,07                     |              |                |                          |                          |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026         | 6.500          | 6.416                    | 0,07                     | Oracle Corp.                         |                |                          |                          | SBA Tower Trust                          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029         | 6.875          | 6.550                    | 0,07                     | 4,200 % fällig am 27.09.2029         | 8.000          | 7.947                    | 0,08                     | 4,831 % fällig am 15.10.2029             | 21.800                       | 21.846                   | 0,22                     |              |                |                          |                          |
| 5,900 % fällig am 01.06.2027         | 8.250          | 8.433                    | 0,09                     | 4,700 % fällig am 27.09.2034         | 8.000          | 7.770                    | 0,08                     | Selective Insurance Group, Inc.          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 6,000 % fällig am 15.08.2029         | 3.475          | 3.573                    | 0,04                     | Organon & Co.                        |                |                          |                          | 5,900 % fällig am 15.04.2035             | 3.000                        | 3.069                    | 0,03                     |              |                |                          |                          |
| Level 3 Financing, Inc.              |                |                          |                          | 2,875 % fällig am 30.04.2028         | € 23.850       | 27.351                   | 0,28                     | Shift4 Payments LLC                      |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 11,000 % fällig am 15.11.2029        | 5.039          | 5.787                    | 0,06                     | 4,125 % fällig am 30.04.2028         | \$ 7.150       | 6.881                    | 0,07                     | Sirius XM Radio LLC                      |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| LifePoint Health, Inc.               |                |                          |                          | Pacific Gas & Electric Co.           |                |                          |                          | 4,000 % fällig am 15.07.2028             | 1.530                        | 1.471                    | 0,02                     |              |                |                          |                          |
| 11,000 % fällig am 15.10.2030        | 12.075         | 13.336                   | 0,14                     | 2,100 % fällig am 01.08.2027         | 300            | 284                      | 0,00                     | Sitio Royalties Operating Partnership LP |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Live Nation Entertainment, Inc.      |                |                          |                          | 2,500 % fällig am 01.02.2031         | 1.300          | 1.129                    | 0,01                     | 7,875 % fällig am 01.11.2028             | 2.150                        | 2.253                    | 0,02                     |              |                |                          |                          |
| 3,750 % fällig am 15.01.2028         | 7.700          | 7.470                    | 0,08                     | 3,150 % fällig am 01.01.2026         | 8.400          | 8.321                    | 0,09                     | Sixth Street Lending Partners            |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Lseg U.S. Fin Corp.                  |                |                          |                          | 3,300 % fällig am 15.03.2027         | 3.100          | 3.030                    | 0,03                     | 5,750 % fällig am 15.01.2030             | 10.000                       | 10.029                   | 0,10                     |              |                |                          |                          |
| 5,297 % fällig am 28.03.2034         | 5.000          | 5.140                    | 0,05                     | 3,300 % fällig am 01.12.2027         | 2.900          | 2.807                    | 0,03                     | SLM Corp.                                |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| Marriott International, Inc.         |                |                          |                          | 3,300 % fällig am 01.08.2040         | 31.900         | 22.845                   | 0,23                     | 6,500 % fällig am 31.01.2030             | 13.325                       | 13.997                   | 0,14                     |              |                |                          |                          |
| 4,625 % fällig am 15.06.2030         | 900            | 902                      | 0,01                     | 3,450 % fällig am 01.07.2025         | 2.250          | 2.250                    | 0,02                     | Snap, Inc.                               |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 5,500 % fällig am 15.04.2037         | 9.250          | 9.257                    | 0,10                     | 3,750 % fällig am 01.07.2028         | 2.350          | 2.281                    | 0,02                     | 6,875 % fällig am 01.03.2033             | 10.000                       | 10.268                   | 0,11                     |              |                |                          |                          |
| Mars, Inc.                           |                |                          |                          | 3,950 % fällig am 01.12.2047         | 800            | 565                      | 0,01                     |                                          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
| 4,800 % fällig am 01.03.2030         | 8.800          | 8.919                    | 0,09                     | 4,200 % fällig am 01.06.2041         | 1.100          | 847                      | 0,01                     |                                          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |
|                                      |                |                          |                          | 4,250 % fällig am 15.03.2046         | 2.000          | 1.492                    | 0,02                     |                                          |                              |                          |                          |              |                |                          |                          |



| BESCHREIBUNG                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Southern California Edison Co.<br>4,000 % fällig am 01.04.2047 \$  | 7.900          | \$ 5.681                 | 0,06                              | VMware LLC<br>4,700 % fällig am 15.05.2030 \$                                                              | 3.900          | \$ 3.917                 | 0,04                              | Medline Borrower LP<br>6,577 % fällig am 23.10.2028 \$                                  | 1.592          | \$ 1.596                 | 0,02                              |
| 5,200 % fällig am 01.06.2034                                       | 7.700          | 7.473                    | 0,08                              | Walgreens Boots Alliance, Inc.<br>3,600 % fällig am 20.11.2025 £                                           | 5.850          | 7.932                    | 0,08                              | Modena Buyer LLC<br>8,780 % fällig am 01.07.2031                                        | 4.309          | 4.161                    | 0,04                              |
| Spirit AeroSystems, Inc.<br>9,375 % fällig am 30.11.2029           | 1.925          | 2.045                    | 0,02                              | 8,125 % fällig am 15.08.2029 \$                                                                            | 5.000          | 5.306                    | 0,05                              | MPH Acquisition Holdings LLC<br>8,030 % fällig am 31.12.2030                            | 347            | 343                      | 0,00                              |
| 9,750 % fällig am 15.11.2030                                       | 4.816          | 5.317                    | 0,05                              | Warnermedia Holdings, Inc.<br>4,279 % fällig am 15.03.2032                                                 | 3.098          | 2.622                    | 0,03                              | 9,141 % fällig am 31.12.2030                                                            | 349            | 314                      | 0,00                              |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust<br>3,375 % fällig am 15.08.2031 | 624            | 554                      | 0,01                              | 5,050 % fällig am 15.03.2042                                                                               | 3.000          | 2.036                    | 0,02                              | Novelis Corp.<br>6,296 % fällig am 11.03.2032                                           | 8.978          | 9.000                    | 0,09                              |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029                                       | 1.285          | 1.181                    | 0,01                              | Wayfair LLC<br>7,250 % fällig am 31.10.2029                                                                | 3.175          | 3.184                    | 0,03                              | Olympus Water U.S. Holding Corp.<br>7,296 % fällig am 20.06.2031                        | 449            | 444                      | 0,00                              |
| Sprint Capital Corp.<br>8,750 % fällig am 15.03.2032               | 12.000         | 14.564                   | 0,15                              | Weir Group, Inc.<br>5,350 % fällig am 06.05.2030                                                           | 6.800          | 6.898                    | 0,07                              | Pantheon Senior Debt Secondaries<br>6,317 % fällig am 26.03.2026 (j)                    | 3.000          | 3.000                    | 0,03                              |
| Standard Industries, Inc.<br>2,250 % fällig am 21.11.2026 €        | 37.000         | 43.040                   | 0,44                              | Wells Fargo & Co.<br>3,900 % fällig am 22.07.2032                                                          | 10.700         | 12.944                   | 0,13                              | Primo Brands Corp.<br>6,546 % fällig am 31.03.2028                                      | 2.866          | 2.879                    | 0,03                              |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 \$                                    | 3.450          | 3.414                    | 0,04                              | 5,198 % fällig am 23.01.2030                                                                               | 3.100          | 3.176                    | 0,03                              | Project Hudson<br>7,730 % fällig am 29.05.2026                                          | 3.900          | 3.957                    | 0,04                              |
| Station Casinos LLC<br>4,625 % fällig am 01.12.2031                | 2.450          | 2.297                    | 0,02                              | 5,499 % fällig am 23.01.2035 (k)                                                                           | 10.000         | 10.259                   | 0,11                              | QualityTech LP<br>7,813 % fällig am 30.10.2031                                          | 9.200          | 9.246                    | 0,10                              |
| Stonepeak Nile Parent LLC<br>7,250 % fällig am 15.03.2032          | 8.025          | 8.512                    | 0,09                              | 5,557 % fällig am 25.07.2034                                                                               | 5.000          | 5.162                    | 0,05                              | Quikrete Holdings, Inc.<br>6,577 % fällig am 10.02.2032                                 | 2.045          | 2.045                    | 0,02                              |
| Stryker Corp.<br>3,375 % fällig am 11.09.2032 €                    | 1.600          | 1.888                    | 0,02                              | Westinghouse Air Brake Technologies Corp.<br>5,611 % fällig am 11.03.2034                                  | 3.800          | 3.936                    | 0,04                              | QXO, Inc.<br>7,296 % fällig am 30.04.2032                                               | 1.492          | 1.504                    | 0,02                              |
| 3,625 % fällig am 11.09.2036                                       | 1.850          | 2.164                    | 0,02                              | Windstream Services LLC<br>8,250 % fällig am 01.10.2031                                                    | 15.425         | 16.168                   | 0,17                              | Raven Acquisition Holdings LLC<br>3,250 % fällig am 19.11.2031                          | 807            | 807                      | 0,01                              |
| 4,250 % fällig am 11.09.2029 \$                                    | 3.050          | 3.046                    | 0,03                              | WMG Acquisition Corp.<br>2,250 % fällig am 15.08.2031                                                      | 5.145          | 5.612                    | 0,06                              | 7,577 % fällig am 19.11.2031                                                            | 11.265         | 11.269                   | 0,12                              |
| Synopsys, Inc.<br>4,650 % fällig am 01.04.2028                     | 1.400          | 1.415                    | 0,01                              | 3,000 % fällig am 15.02.2031                                                                               | 6.700          | 6.080                    | 0,06                              | Rockpoint Gas Storage Partners LP<br>7,296 % fällig am 18.09.2031                       | 9.491          | 9.537                    | 0,10                              |
| T-Mobile USA, Inc.<br>3,500 % fällig am 11.02.2037 €               | 5.000          | 5.645                    | 0,06                              | 3,875 % fällig am 15.07.2030                                                                               | 3.000          | 2.806                    | 0,03                              | SS&C Technologies, Inc.<br>6,327 % fällig am 09.05.2031                                 | 9.407          | 9.463                    | 0,10                              |
| 4,200 % fällig am 01.10.2029 \$                                    | 2.000          | 1.987                    | 0,02                              | Wynn Las Vegas LLC<br>5,250 % fällig am 15.05.2027                                                         | 700            | 701                      | 0,01                              | Standard Industries, Inc.<br>6,071 % fällig am 22.09.2028                               | 3.835          | 3.848                    | 0,04                              |
| 4,700 % fällig am 15.01.2035                                       | 8.000          | 7.754                    | 0,08                              | Wynn Resorts Finance LLC<br>5,125 % fällig am 01.10.2029                                                   | 9.900          | 9.835                    | 0,10                              | Station Casinos LLC<br>6,327 % fällig am 14.03.2031                                     | 6.542          | 6.561                    | 0,07                              |
| 4,950 % fällig am 15.03.2028                                       | 1.500          | 1.526                    | 0,02                              | 7,125 % fällig am 15.02.2031                                                                               | 4.000          | 4.268                    | 0,04                              | Stepstone Group Midco GmbH<br>6,673 % fällig am 26.04.2032 €                            | 8.325          | 9.601                    | 0,10                              |
| 5,650 % fällig am 15.01.2053                                       | 2.000          | 1.936                    | 0,02                              | XPO, Inc.<br>6,250 % fällig am 01.06.2028                                                                  | 2.475          | 2.517                    | 0,03                              | 8,608 % - 8,651 % fällig am 19.12.2031 \$                                               | 1.250          | 1.216                    | 0,01                              |
| Tallgrass Energy Partners LP<br>5,500 % fällig am 15.01.2028       | 2.400          | 2.387                    | 0,02                              | Zayo Group Holdings, Inc.<br>4,000 % fällig am 01.03.2027                                                  | 815            | 765                      | 0,01                              | Stonepeak Nile Parent LLC<br>9,250 % fällig am 09.04.2032                               | 1.825          | 1.833                    | 0,02                              |
| Tennessee Gas Pipeline Co. LLC<br>8,375 % fällig am 15.06.2032     | 1.351          | 1.568                    | 0,02                              |                                                                                                            | 2.435.575      | 25,00                    |                                   | TransDigm, Inc.<br>6,796 % fällig am 28.02.2031                                         | 570            | 572                      | 0,01                              |
| TopBuild Corp.<br>3,625 % fällig am 15.03.2029                     | 4.775          | 4.521                    | 0,05                              | KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG                                                                         |                |                          |                                   | 7,046 % fällig am 22.03.2030                                                            | 1.930          | 1.940                    | 0,02                              |
| 4,125 % fällig am 15.02.2032                                       | 8.900          | 8.259                    | 0,08                              | Aligned Data Centers International LP<br>7,799 % fällig am 18.12.2029                                      | 6.000          | 6.016                    | 0,06                              | Twitter, Inc.<br>10,927 % fällig am 26.10.2029                                          | 14.874         | 14.550                   | 0,15                              |
| TransDigm, Inc.<br>6,375 % fällig am 01.03.2029                    | 3.400          | 3.492                    | 0,04                              | Amentum Government Services Holdings LLC<br>6,577 % fällig am 29.09.2031                                   | 6.840          | 6.840                    | 0,07                              | U.S. Renal Care, Inc.<br>9,441 % fällig am 20.06.2028                                   | 8.187          | 7.771                    | 0,08                              |
| 7,125 % fällig am 01.12.2031                                       | 7.125          | 7.474                    | 0,08                              | American Airlines, Inc.<br>6,522 % fällig am 20.04.2028                                                    | 65             | 65                       | 0,00                              | UKG, Inc.<br>7,311 % fällig am 10.02.2031                                               | 8.192          | 8.232                    | 0,08                              |
| Uber Technologies, Inc.<br>4,300 % fällig am 15.01.2030            | 2.000          | 1.993                    | 0,02                              | Avolon TLB Borrower U.S. LLC<br>6,071 % fällig am 24.06.2030                                               | 28.079         | 28.131                   | 0,29                              | Vista Management Holding Inc.<br>8,048 % fällig am 01.04.2031                           | 8.600          | 8.632                    | 0,09                              |
| 4,800 % fällig am 15.09.2034                                       | 4.100          | 4.030                    | 0,04                              | Boost Newco Borrower LLC<br>6,296 % fällig am 31.01.2031                                                   | 1.095          | 1.099                    | 0,01                              | Wand NewCo, Inc.<br>6,827 % fällig am 30.01.2031                                        | 4.116          | 4.102                    | 0,04                              |
| UKG, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.02.2031                          | 10.800         | 11.213                   | 0,12                              | Carnival Corp.<br>6,312 % fällig am 08.08.2027                                                             | 765            | 767                      | 0,01                              |                                                                                         | 266.895        | 2,74                     |                                   |
| United Airlines Pass-Through Trust<br>2,700 % fällig am 01.11.2033 | 1.362          | 1.221                    | 0,01                              | Charter Communications Operating LLC<br>6,548 % fällig am 15.12.2031                                       | 6.218          | 6.234                    | 0,06                              | KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL                                                            |                |                          |                                   |
| 2,900 % fällig am 01.11.2029                                       | 1.990          | 1.848                    | 0,02                              | Cotiviti Corp.<br>7,074 % fällig am 01.05.2031                                                             | 17.874         | 17.813                   | 0,18                              | Massachusetts Port Authority Revenue Bonds, Series 2011<br>6,202 % fällig am 01.07.2031 | 385            | 402                      | 0,01                              |
| 3,100 % fällig am 07.01.2030                                       | 604            | 578                      | 0,01                              | 7,074 % fällig am 26.03.2032                                                                               | 6.000          | 5.979                    | 0,06                              | NON-AGENCY-MBS                                                                          |                |                          |                                   |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029                                       | 678            | 658                      | 0,01                              | Databricks, Inc.<br>1,000 % fällig am 03.01.2031                                                           | 3.135          | 3.167                    | 0,03                              | Adjustable Rate Mortgage Trust<br>4,047 % fällig am 25.01.2036                          | 23             | 21                       | 0,00                              |
| 3,450 % fällig am 07.01.2030                                       | 1.209          | 1.156                    | 0,01                              | 8,816 % fällig am 03.01.2031                                                                               | 14.165         | 14.306                   | 0,15                              | 4,609 % fällig am 25.02.2036                                                            | 71             | 45                       | 0,00                              |
| 3,500 % fällig am 01.09.2031                                       | 1.595          | 1.506                    | 0,02                              | DirecTV Financing LLC<br>9,791 % fällig am 02.08.2029                                                      | 6.326          | 6.289                    | 0,07                              | American Home Mortgage Assets Trust<br>4,814 % fällig am 25.09.2046                     | 1.243          | 1.168                    | 0,01                              |
| 4,000 % fällig am 11.10.2027                                       | 455            | 452                      | 0,00                              | Endure Digital, Inc.<br>7,927 % fällig am 10.02.2028                                                       | 15.652         | 12.052                   | 0,12                              | 6,750 % fällig am 25.06.2037                                                            | 80             | 72                       | 0,00                              |
| 4,150 % fällig am 25.02.2033                                       | 414            | 397                      | 0,00                              | Fortress Intermediate, Inc.<br>7,827 % fällig am 27.06.2031                                                | 3.126          | 3.138                    | 0,03                              | American Home Mortgage Investment Trust<br>6,460 % fällig am 25.12.2035                 | 703            | 236                      | 0,00                              |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029                                       | 17.410         | 17.781                   | 0,18                              | Global Medical Response, Inc. (9,079 % Cash und 0,750 % PIK)<br>0,750 % - 9,079 % fällig am 31.10.2028 (b) | 2.188          | 2.194                    | 0,02                              | Angel Oak Mortgage Trust<br>1,469 % fällig am 25.06.2065                                | 107            | 101                      | 0,00                              |
| United Airlines, Inc.<br>4,375 % fällig am 15.04.2026              | 5.900          | 5.865                    | 0,06                              | Hilton Grand Vacations Borrower LLC<br>6,327 % fällig am 02.08.2028                                        | 761            | 761                      | 0,01                              | Banc of America Alternative Loan Trust<br>6,000 % fällig am 25.06.2046                  | 74             | 64                       | 0,00                              |
| Univision Communications, Inc.<br>6,625 % fällig am 01.06.2027     | 3.920          | 3.913                    | 0,04                              | Kaseya, Inc.<br>7,577 % fällig am 20.03.2032                                                               | 6.708          | 6.742                    | 0,07                              | 6,000 % fällig am 25.07.2046                                                            | 77             | 68                       | 0,00                              |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,250 % fällig am 15.01.2030  | 11.100         | 11.457                   | 0,12                              | LifePoint Health, Inc.<br>8,006 % fällig am 19.05.2031                                                     | 6.070          | 6.014                    | 0,06                              |                                                                                         |                |                          |                                   |
| Venture Global LNG, Inc.<br>7,000 % fällig am 15.01.2030           | 20.000         | 20.236                   | 0,21                              | Marriott Ownership Resorts, Inc.<br>6,577 % fällig am 01.04.2031                                           | 863            | 865                      | 0,01                              |                                                                                         |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 15.01.2030                                       | 20.000         | 20.236                   | 0,21                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| 8,125 % fällig am 01.06.2028                                       | 22.425         | 23.191                   | 0,24                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| 8,375 % fällig am 01.06.2031                                       | 21.825         | 22.684                   | 0,23                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| 9,500 % fällig am 01.02.2029                                       | 12.232         | 13.333                   | 0,14                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| Verizon Communications, Inc.<br>2,355 % fällig am 15.03.2032       | 21.975         | 18.950                   | 0,19                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| VF Corp.<br>0,250 % fällig am 25.02.2028 €                         | 2.500          | 2.571                    | 0,03                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| VICI Properties LP<br>3,875 % fällig am 15.02.2029 \$              | 2.350          | 2.275                    | 0,02                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028                                       | 2.750          | 2.739                    | 0,03                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 15.11.2031                                       | 3.000          | 3.006                    | 0,03                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 01.04.2035                                       | 4.900          | 4.947                    | 0,05                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |
| Vital Energy, Inc.<br>7,875 % fällig am 15.04.2032 (k)             | 2.980          | 2.550                    | 0,03                              |                                                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Banc of America Funding Trust</b>                       |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.04.2036                                | \$ 2.878       | \$ 983                   | 0,01                              | 4,774 % fällig am 25.12.2034                          | \$ 3           | \$ 3                     | 0,00                              |
| 4,750 % fällig am 20.09.2047                               | \$ 59          | \$ 52                    | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.07.2035                                | 47             | 43                       | 0,00                              | 4,985 % fällig am 25.11.2035                          | 29             | 28                       | 0,00                              |
| 4,852 % fällig am 20.04.2047                               | 188            | 157                      | 0,00                              | 5,054 % fällig am 25.08.2035                                | 67             | 62                       | 0,00                              | 5,283 % fällig am 25.04.2035                          | 13             | 12                       | 0,00                              |
| 5,014 % fällig am 25.07.2037                               | 196            | 188                      | 0,00                              | 5,096 % fällig am 20.11.2035                                | 223            | 220                      | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.02.2036                          | 122            | 107                      | 0,00                              |
| 5,078 % fällig am 20.01.2047                               | 177            | 154                      | 0,00                              | 5,250 % fällig am 25.06.2035                                | 185            | 138                      | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.03.2036                          | 33             | 30                       | 0,00                              |
| 5,234 % fällig am 25.05.2037                               | 50             | 43                       | 0,00                              | 5,372 % fällig am 25.05.2036                                | 109            | 104                      | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.01.2037                          | 87             | 51                       | 0,00                              |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036                               | 42             | 34                       | 0,00                              | 5,377 % fällig am 25.02.2036                                | 232            | 180                      | 0,00                              | 5,880 % fällig am 25.04.2032                          | 22             | 21                       | 0,00                              |
| 5,760 % fällig am 20.09.2035                               | 58             | 47                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.02.2035                                | 745            | 689                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.02.2036                          | 344            | 149                      | 0,00                              |
| <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                      |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                | 1.630          | 895                      | 0,01                              | 6,500 % fällig am 25.09.2036                          | 250            | 110                      | 0,00                              |
| 5,056 % fällig am 25.02.2036                               | 2              | 1                        | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.12.2035                                | 477            | 289                      | 0,00                              | 6,562 % fällig am 25.09.2035                          | 10             | 10                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036                               | 19             | 16                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.05.2036                                | 301            | 104                      | 0,00                              | <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                 |                |                          |                                   |
| 6,019 % fällig am 25.01.2035                               | 22             | 22                       | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.01.2035                                | 130            | 130                      | 0,00                              | 4,306 % fällig am 19.06.2036                          | 151            | 62                       | 0,00                              |
| 6,107 % fällig am 25.07.2035                               | 4              | 4                        | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.07.2037                                | 320            | 184                      | 0,00                              | 4,874 % fällig am 19.08.2036                          | 35             | 27                       | 0,00                              |
| <b>BCAP LLC Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 5,879 % fällig am 25.01.2036                                | 273            | 259                      | 0,00                              | 4,912 % fällig am 19.06.2035                          | 158            | 154                      | 0,00                              |
| 4,737 % fällig am 26.05.2037                               | 3.609          | 3.470                    | 0,04                              | 6,000 % fällig am 25.03.2035                                | 4.175          | 1.879                    | 0,02                              | 4,972 % fällig am 19.03.2035                          | 17             | 17                       | 0,00                              |
| 4,874 % fällig am 25.05.2047                               | 155            | 141                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.02.2036                                | 136            | 63                       | 0,00                              | 5,052 % fällig am 19.11.2035                          | 79             | 51                       | 0,00                              |
| 5,734 % fällig am 25.09.2047                               | 47             | 41                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.03.2036                                | 333            | 150                      | 0,00                              | 5,132 % fällig am 19.01.2035                          | 176            | 169                      | 0,00                              |
| 6,250 % fällig am 26.08.2036                               | 1.881          | 743                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.08.2036                                | 194            | 110                      | 0,00                              | 5,514 % fällig am 19.08.2036                          | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>         |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.01.2037                                | 451            | 374                      | 0,01                              | <b>HomeBanc Mortgage Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| 4,235 % fällig am 25.07.2036                               | 14             | 12                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.02.2037                                | 1.988          | 730                      | 0,01                              | 4,934 % fällig am 25.03.2035                          | 70             | 57                       | 0,00                              |
| 4,317 % fällig am 25.06.2047                               | 82             | 72                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.03.2037                                | 490            | 168                      | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.01.2036                          | 62             | 60                       | 0,00                              |
| 4,361 % fällig am 25.05.2034                               | 16             | 15                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.04.2037                                | 1.444          | 659                      | 0,01                              | <b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>           |                |                          |                                   |
| 4,521 % fällig am 25.02.2036                               | 26             | 24                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.05.2037                                | 196            | 84                       | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.11.2035                          | 1.112          | 1.040                    | 0,01                              |
| 4,847 % fällig am 25.03.2035                               | 20             | 19                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                | 201            | 89                       | 0,00                              | <b>Impac Secured Assets Trust</b>                     |                |                          |                                   |
| 5,117 % fällig am 25.01.2035                               | 79             | 76                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                                | 40             | 19                       | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.05.2037                          | 33             | 28                       | 0,00                              |
| 5,166 % fällig am 25.01.2035                               | 1              | 1                        | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.02.2047                                | 307            | 149                      | 0,00                              | <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                    |                |                          |                                   |
| 5,513 % fällig am 25.07.2034                               | 14             | 14                       | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.12.2036                                | 238            | 98                       | 0,00                              | 3,203 % fällig am 25.06.2037                          | 38             | 31                       | 0,00                              |
| 6,244 % fällig am 25.06.2035                               | 1              | 1                        | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.08.2032                                | 10             | 10                       | 0,00                              | 3,404 % fällig am 25.07.2037                          | 44             | 29                       | 0,00                              |
| 6,373 % fällig am 25.12.2046                               | 47             | 39                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.09.2037                                | 8.783          | 3.098                    | 0,03                              | 3,446 % fällig am 25.06.2036                          | 105            | 91                       | 0,00                              |
| 6,464 % fällig am 25.10.2035                               | 18             | 18                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.11.2037                                | 799            | 357                      | 0,01                              | 3,736 % fällig am 25.08.2035                          | 503            | 365                      | 0,01                              |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                            |                |                          |                                   | <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>    |                |                          |                                   | 4,170 % fällig am 25.12.2036                          | 49             | 38                       | 0,00                              |
| 4,192 % fällig am 25.08.2036                               | 231            | 106                      | 0,00                              | 4,157 % fällig am 25.09.2037                                | 17             | 16                       | 0,00                              | 4,190 % fällig am 25.11.2035                          | 25             | 19                       | 0,00                              |
| 4,608 % fällig am 25.11.2036                               | 220            | 127                      | 0,00                              | 4,252 % fällig am 25.03.2037                                | 37             | 32                       | 0,00                              | 4,380 % fällig am 25.05.2037                          | 106            | 91                       | 0,00                              |
| 4,698 % fällig am 25.03.2036                               | 244            | 141                      | 0,00                              | 4,478 % fällig am 20.10.2035                                | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,576 % fällig am 25.06.2035                          | 117            | 111                      | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.01.2047                               | 105            | 90                       | 0,00                              | 4,860 % fällig am 25.09.2047                                | 3              | 3                        | 0,00                              | 4,708 % fällig am 25.11.2035                          | 408            | 317                      | 0,01                              |
| 4,843 % fällig am 25.05.2036                               | 332            | 138                      | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.03.2036                                | 83             | 75                       | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.07.2047                          | 152            | 100                      | 0,00                              |
| 4,874 % fällig am 25.04.2036                               | 58             | 52                       | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.04.2046                                | 7.069          | 2.033                    | 0,02                              | 4,834 % fällig am 25.06.2046                          | 1.029          | 899                      | 0,01                              |
| 4,905 % fällig am 25.09.2035                               | 54             | 31                       | 0,00                              | 5,114 % fällig am 25.03.2035                                | 36             | 34                       | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.07.2036                          | 4.605          | 4.423                    | 0,05                              |
| 5,409 % fällig am 25.07.2035                               | 6.328          | 6.229                    | 0,07                              | 5,129 % fällig am 25.10.2035                                | 194            | 158                      | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.07.2035                          | 5              | 4                        | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>        |                |                          |                                   | 5,359 % fällig am 25.04.2046                                | 747            | 205                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.07.2035                          | 118            | 95                       | 0,00                              |
| 5,062 % fällig am 26.01.2036                               | 65             | 46                       | 0,00                              | 5,432 % fällig am 20.12.2035                                | 3              | 3                        | 0,00                              | 5,297 % fällig am 25.10.2034                          | 176            | 169                      | 0,00                              |
| <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                        |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.10.2034                                | 294            | 298                      | 0,01                              | <b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>                |                |                          |                                   |
| 4,639 % fällig am 25.01.2036                               | 153            | 140                      | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.09.2035                                | 83             | 83                       | 0,00                              | 4,250 % fällig am 25.05.2036                          | 154            | 86                       | 0,00                              |
| 4,669 % fällig am 25.03.2037                               | 36             | 34                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.10.2035                                | 41             | 20                       | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.10.2036                          | 687            | 629                      | 0,01                              |
| 5,034 % fällig am 25.02.2037                               | 45             | 13                       | 0,00                              | 5,541 % fällig am 20.11.2035                                | 42             | 35                       | 0,00                              | 4,826 % fällig am 25.05.2037                          | 146            | 130                      | 0,00                              |
| 5,078 % fällig am 25.03.2037                               | 157            | 152                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.05.2036                                | 115            | 52                       | 0,00                              | 5,843 % fällig am 26.05.2037                          | 1.311          | 1.027                    | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036                               | 56             | 22                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.02.2037                                | 412            | 286                      | 0,00                              | <b>JPMorgan Mortgage Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037                               | 110            | 59                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.03.2037                                | 29             | 13                       | 0,00                              | 4,504 % fällig am 25.10.2036                          | 225            | 162                      | 0,00                              |
| <b>ChaseFlex Trust</b>                                     |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.09.2037                                | 25             | 12                       | 0,00                              | 5,290 % fällig am 25.08.2035                          | 14             | 14                       | 0,00                              |
| 5,034 % fällig am 25.07.2037                               | 128            | 113                      | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.09.2036                                | 616            | 217                      | 0,00                              | 5,298 % fällig am 25.06.2037                          | 167            | 129                      | 0,00                              |
| 6,300 % fällig am 25.06.2036                               | 47             | 42                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.11.2036                                | 151            | 44                       | 0,00                              | 5,461 % fällig am 25.10.2035                          | 106            | 81                       | 0,00                              |
| <b>Citicorp Mortgage Securities Trust</b>                  |                |                          |                                   | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b> |                |                          |                                   | 5,496 % fällig am 25.07.2035                          | 6              | 6                        | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037                               | 20             | 21                       | 0,00                              | 5,695 % fällig am 25.06.2033                                | 8              | 8                        | 0,00                              | 5,710 % fällig am 25.11.2035                          | 82             | 67                       | 0,00                              |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                 |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.01.2036                                | 191            | 117                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.01.2036                          | 94             | 42                       | 0,00                              |
| 4,118 % fällig am 25.10.2046                               | 48             | 42                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.04.2033                                | 0              | 0                        | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.07.2036                          | 225            | 71                       | 0,00                              |
| 4,400 % fällig am 25.09.2037                               | 9              | 9                        | 0,00                              | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Certificates</b>          |                |                          |                                   | 7,534 % fällig am 25.04.2035                          | 5              | 6                        | 0,00                              |
| 4,770 % fällig am 25.03.2037                               | 2.362          | 2.069                    | 0,02                              | 3,623 % fällig am 25.10.2043                                | 544            | 530                      | 0,01                              | <b>Lehman XS Trust</b>                                |                |                          |                                   |
| 4,783 % fällig am 25.09.2037                               | 54             | 50                       | 0,00                              | 3,844 % fällig am 28.04.2037                                | 98             | 91                       | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.12.2036                          | 1.587          | 1.540                    | 0,02                              |
| 5,483 % fällig am 25.07.2046                               | 140            | 132                      | 0,00                              | 5,760 % fällig am 27.09.2035                                | 965            | 821                      | 0,01                              | 4,834 % fällig am 25.03.2047                          | 3.406          | 3.092                    | 0,03                              |
| 6,080 % fällig am 25.09.2035                               | 4              | 4                        | 0,00                              | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b> |                |                          |                                   | 4,884 % fällig am 25.08.2046                          | 6.242          | 6.378                    | 0,07                              |
| 6,743 % fällig am 25.02.2034                               | 5              | 5                        | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.07.2036                                | 707            | 326                      | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.09.2046                          | 8              | 25                       | 0,00                              |
| 6,756 % fällig am 25.03.2034                               | 2              | 2                        | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.04.2037                                | 163            | 51                       | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.02.2046                          | 163            | 146                      | 0,00                              |
| 7,875 % fällig am 25.09.2037                               | 42             | 39                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.02.2022                                | 557            | 32                       | 0,00                              | 5,334 % fällig am 25.08.2047                          | 340            | 304                      | 0,00                              |
| <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                 |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 25.08.2036                                | 575            | 287                      | 0,00                              | 6,134 % fällig am 25.10.2037                          | 1.485          | 1.394                    | 0,02                              |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037                               | 36             | 32                       | 0,00                              | 7,000 % fällig am 25.08.2037                                | 600            | 284                      | 0,00                              | <b>Luminent Mortgage Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037                               | 441            | 386                      | 0,01                              | <b>Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust</b>        |                |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.10.2046                          | 709            | 647                      | 0,01                              |
| <b>Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust</b> |                |                          |                                   | 4,814 % fällig am 25.08.2047                                | 75             | 69                       | 0,00                              | <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>          |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036                               | 200            | 111                      | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.02.2035                                | 1.921          | 1.899                    | 0,02                              | 6,043 % fällig am 21.11.2034                          | 35             | 34                       | 0,00                              |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                  |                |                          |                                   | <b>Deutsche Mortgage &amp; Asset Receiving Corp.</b>        |                |                          |                                   | <b>Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust</b>     |                |                          |                                   |
| 4,612 % fällig am 20.02.2047                               | 136            | 109                      | 0,00                              | 4,554 % fällig am 27.11.2036                                | 9              | 9                        | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.03.2037                          | 213            | 50                       | 0,00                              |
| 4,622 % fällig am 20.09.2046                               | 67             | 68                       | 0,00                              | <b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>  |                |                          |                                   | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>         |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.08.2037                               | 285            | 265                      | 0,00                              | 5,138 % fällig am 25.06.2036                                | 30             | 24                       | 0,00                              | 4,448 % fällig am 25.03.2036                          | 269            | 133                      | 0,00                              |
| 4,714 % fällig am 25.04.2047                               | 3.534          | 3.250                    | 0,04                              | 6,250 % fällig am 25.08.2037                                | 60             | 21                       | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.04.2029                          | 8              | 7                        | 0,00                              |
| 4,784 % fällig am 25.08.2036                               | 51             | 20                       | 0,00                              | <b>First Horizon Mortgage Pass-Through Trust</b>            |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.11.2029                          | 2              | 1                        | 0,00                              |
| 4,794 % fällig am 25.11.2036                               | 17             | 22                       | 0,00                              | 6,973 % fällig am 25.09.2035                                | 243            | 235                      | 0,00                              | 5,205 % fällig am 25.05.2036                          | 113            | 106                      | 0,00                              |
| 4,814 % fällig am 25.07.2046                               | 18             | 19                       | 0,00                              | <b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>                    |                |                          |                                   | 6,028 % fällig am 25.11.2035                          | 74             | 72                       | 0,00                              |
| 4,814 % fällig am 25.09.2046                               | 151            | 147                      | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.10.2046                                | 547            | 501                      | 0,01                              | <b>Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust</b> |                |                          |                                   |
| 4,852 % fällig am 20.03.2046                               | 69             | 64                       | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.04.2036                                | 83             | 73                       | 0,00                              | 4,365 % fällig am 25.04.2037                          | 16             | 14                       | 0,00                              |
| 4,852 % fällig am 20.05.2046                               | 1.157          | 1.027                    | 0,01                              | <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   | <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>             |                |                          |                                   |
| 4,852 % fällig am 20.07.2046                               | 49             | 41                       | 0,00                              | 4,495 % fällig am 25.03.2047                                | 237            | 137                      | 0,00                              | 4,047 % fällig am 25.05.2036                          | 327            | 179                      | 0,00                              |
| 4,914 % fällig am 25.12.2046                               | 1.481          | 899                      | 0,01                              | 4,729 % fällig am 25.01.2036                                | 8              | 8                        | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.03.2036                          | 48             | 31                       | 0,00                              |
| 4,934 % fällig am 25.06.2035                               | 63             | 61                       | 0,00                              |                                                             |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,754 % fällig am 25.01.2035                                                   | \$ 12          | \$ 11                    | 0,00                              | 4,059 % fällig am 25.07.2037                                      | \$ 384         | \$ 344                   | 0,01                              | <b>USBEKISTAN</b>                                |                |                          |                                   |
| 4,882 % fällig am 25.09.2035                                                   | 146            | 43                       | 0,00                              | 4,068 % fällig am 25.12.2046                                      | 41             | 36                       | 0,00                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037                                                   | 1.110          | 574                      | 0,01                              | 4,093 % fällig am 25.02.2037                                      | 23             | 20                       | 0,00                              | <b>Republic of Uzbekistan International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 6,075 % fällig am 25.06.2036                                                   | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,182 % fällig am 27.02.2034                                      | 73             | 70                       | 0,00                              | 5,375 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 6,309 % fällig am 25.06.2036                                                   | 10             | 10                       | 0,00                              | 4,252 % fällig am 25.12.2036                                      | 20             | 18                       | 0,00                              | 29.05.2027                                       | € 5.100        | 6.139                    | 0,06                              |
| <b>Morgan Stanley Re-REMIC Trust</b>                                           |                |                          |                                   | 4,351 % fällig am 25.12.2036                                      | 7              | 7                        | 0,00                              | <b>VENEZUELA</b>                                 |                |                          |                                   |
| 3,262 % fällig am 26.02.2037                                                   | 80             | 75                       | 0,00                              | 4,385 % fällig am 25.04.2035                                      | 7              | 6                        | 0,00                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| 3,277 % fällig am 26.03.2037                                                   | 57             | 59                       | 0,00                              | 4,501 % fällig am 25.05.2046                                      | 50             | 41                       | 0,00                              | <b>Petroleos de Venezuela S.A.</b>               |                |                          |                                   |
| <b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   | 4,585 % fällig am 25.03.2036                                      | 102            | 92                       | 0,00                              | 5,375 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057                                                   | 1.153          | 1.118                    | 0,01                              | 4,688 % fällig am 25.12.2035                                      | 49             | 45                       | 0,00                              | 12.04.2027 ^                                     | \$ 42.309      | 5.334                    | 0,06                              |
| <b>Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 4,823 % fällig am 25.09.2036                                      | 423            | 370                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.12.2035                                                   | 205            | 202                      | 0,00                              | 4,993 % fällig am 25.01.2036                                      | 1.688          | 1.628                    | 0,02                              | 12.04.2037 ^                                     | 33.041         | 4.164                    | 0,04                              |
| <b>RBSGC Structured Trust</b>                                                  |                |                          |                                   | 5,014 % fällig am 25.10.2045                                      | 19             | 19                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035                                                   | 57             | 48                       | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.01.2045                                      | 401            | 398                      | 0,01                              | 16.05.2024 ^                                     | 8.400          | 1.073                    | 0,01                              |
| <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>                                  |                |                          |                                   | 5,077 % fällig am 25.08.2036                                      | 39             | 37                       | 0,00                              |                                                  |                | 10.571                   | 0,11                              |
| 4,584 % fällig am 25.02.2047                                                   | 703            | 215                      | 0,00                              | 5,174 % fällig am 25.11.2034                                      | 194            | 187                      | 0,00                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.05.2037                                                   | 279            | 252                      | 0,00                              | 5,209 % fällig am 25.07.2047                                      | 366            | 307                      | 0,01                              | <b>Venezuela Government International Bond</b>   |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.02.2037                                                   | 189            | 167                      | 0,00                              | 5,274 % fällig am 25.06.2044                                      | 199            | 197                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 4,784 % fällig am 25.08.2035                                                   | 328            | 264                      | 0,00                              | 5,399 % fällig am 25.08.2046                                      | 218            | 200                      | 0,00                              | 09.12.2020 ^                                     | 2.651          | 371                      | 0,00                              |
| 4,814 % fällig am 25.08.2036                                                   | 89             | 90                       | 0,00                              | 5,599 % fällig am 25.11.2042                                      | 2              | 2                        | 0,00                              | 7,000 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.09.2036                                                   | 334            | 307                      | 0,01                              | 5,661 % fällig am 25.02.2033                                      | 6              | 6                        | 0,00                              | 31.03.2038 ^                                     | 44.992         | 7.945                    | 0,08                              |
| 4,834 % fällig am 25.11.2036                                                   | 2.408          | 1.719                    | 0,02                              | 5,782 % fällig am 25.06.2033                                      | 22             | 22                       | 0,00                              | 7,650 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 4,864 % fällig am 25.05.2046                                                   | 561            | 507                      | 0,01                              | 5,799 % fällig am 25.04.2044                                      | 1              | 1                        | 0,00                              | 21.04.2025 ^                                     | 2.800          | 455                      | 0,01                              |
| 4,920 % fällig am 25.02.2035                                                   | 46             | 41                       | 0,00                              | 5,899 % fällig am 25.10.2046                                      | 15             | 14                       | 0,00                              | 8,250 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 4,959 % fällig am 25.08.2035                                                   | 744            | 684                      | 0,01                              | <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                |                          |                                   | 13.10.2024 ^                                     | 14.300         | 2.353                    | 0,02                              |
| 5,500 % fällig am 25.03.2037                                                   | 58             | 47                       | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.02.2037                                      | 454            | 351                      | 0,01                              | 9,250 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035                                                   | 75             | 23                       | 0,00                              | 4,884 % fällig am 25.05.2035                                      | 171            | 144                      | 0,00                              | 15.09.2027 ^                                     | 2.300          | 469                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                                                   | 296            | 243                      | 0,00                              | 5,000 % fällig am 25.07.2035                                      | 341            | 321                      | 0,01                              | 9,250 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036                                                   | 650            | 544                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                      | 105            | 98                       | 0,00                              | 07.05.2028 ^                                     | 10.613         | 1.882                    | 0,02                              |
| 6,250 % fällig am 25.03.2037                                                   | 142            | 114                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                      | 407            | 373                      | 0,01                              |                                                  |                | 13.475                   | 0,14                              |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037                                                   | 182            | 150                      | 0,00                              | <b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>                         |                |                          |                                   | <b>Summe Venezuela</b>                           |                | 24.046                   | 0,25                              |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037                                                   | 182            | 152                      | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.07.2037                                      | 44             | 38                       | 0,00                              | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>Residential Asset Securitization Trust</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>               |                |                          |                                   | <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>                    |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035                                                   | 81             | 37                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                      | 1.425          | 1.327                    | 0,02                              | 23,286 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035                                                   | 199            | 90                       | 0,00                              | 6,290 % fällig am 25.04.2036                                      | 6              | 6                        | 0,00                              | 04.11.2025 (d)(e)                                | NGN 1.273.000  | 762                      | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037                                                   | 1.213          | 323                      | 0,01                              | 6,678 % fällig am 25.04.2036                                      | 98             | 97                       | 0,00                              | 33,126 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| <b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>                     |                |                          |                                   | 6,678 % fällig am 25.11.2037                                      | 49             | 46                       | 0,00                              | 12.06.2026 (d)(e)                                | 12.098.577     | 6.409                    | 0,06                              |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036                                                   | 87             | 71                       | 0,00                              | 6,928 % fällig am 25.12.2036                                      | 43             | 42                       | 0,00                              | 33,156 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037                                                   | 57             | 44                       | 0,00                              |                                                                   |                |                          |                                   | 11.06.2026 (d)(e)                                | 12.109.626     | 6.418                    | 0,07                              |
| <b>Sequoia Mortgage Trust</b>                                                  |                |                          |                                   |                                                                   |                |                          |                                   | <b>Summe kurzfristige Instrumente</b>            |                | 13.589                   | 0,14                              |
| 4,731 % fällig am 20.01.2047                                                   | 3              | 2                        | 0,00                              |                                                                   |                | 87.865                   | 0,90                              | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>            | \$ 9.646.076   | 99,03                    |                                   |
| <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>                          |                |                          |                                   | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                      |                |                          |                                   | <b>AKTIEN</b>                                    |                |                          |                                   |
| 4,519 % fällig am 25.11.2035                                                   | 14             | 13                       | 0,00                              | <b>Freddie Mac</b>                                                |                |                          |                                   | <b>INVESTMENTFONDS</b>                           |                |                          |                                   |
| 4,520 % fällig am 25.04.2035                                                   | 7              | 7                        | 0,00                              | 2,862 % fällig am 25.07.2054                                      | 16.600         | 15.576                   | 0,16                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>         |                |                          |                                   |
| 4,600 % fällig am 25.10.2036                                                   | 70             | 35                       | 0,00                              | 5,205 % fällig am 25.11.2054                                      | 2.179          | 2.170                    | 0,02                              | <b>PIMCO Funds: Global</b>                       |                |                          |                                   |
| 4,605 % fällig am 25.09.2035                                                   | 16             | 10                       | 0,00                              | 5,505 % fällig am 25.02.2055                                      | 1.873          | 1.877                    | 0,02                              | <b>Investors Series plc - US</b>                 |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.10.2035                                                   | 54             | 51                       | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                           |                |                          |                                   | <b>Short-Term Fund (h)</b>                       | 36.896.909     | 377.086                  | 3,87                              |
| 4,874 % fällig am 25.06.2037                                                   | 81             | 74                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 01.12.2052                                      | 13.148         | 13.231                   | 0,13                              | <b>PIMCO Select Funds plc -</b>                  |                |                          |                                   |
| 5,030 % fällig am 25.09.2035                                                   | 56             | 50                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.02.2054                                      | 2.774          | 2.876                    | 0,03                              | <b>PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV</b>   |                |                          |                                   |
| 5,220 % fällig am 25.11.2036                                                   | 266            | 202                      | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>                      |                |                          |                                   | <b>Fund (h)</b>                                  | 29.263.715     | 291.811                  | 3,00                              |
| 5,519 % fällig am 25.02.2035                                                   | 118            | 112                      | 0,00                              | 3,000 % fällig am                                                 |                |                          |                                   |                                                  |                | 668.897                  | 6,87                              |
| 6,210 % fällig am 25.10.2037                                                   | 56             | 50                       | 0,00                              | 01.07.2055 - 01.08.2055                                           | 100.000        | 86.522                   | 0,89                              | <b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>                             |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am                                                 |                |                          |                                   | <b>PIMCO ETFs plc - PIMCO</b>                    |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.07.2046                                                   | 105            | 92                       | 0,00                              | 01.07.2055 - 01.08.2055                                           | 121.600        | 113.063                  | 1,16                              | <b>US Dollar Short Maturity</b>                  |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.09.2047                                                   | 31             | 29                       | 0,00                              | 4,500 % fällig am 01.08.2055                                      | 68.900         | 65.881                   | 0,68                              | <b>UCITS ETF (h)</b>                             | 2.698.640      | 270.161                  | 2,77                              |
| 4,814 % fällig am 25.06.2036                                                   | 34             | 33                       | 0,00                              | 5,000 % fällig am 01.08.2055                                      | 127.300        | 124.692                  | 1,28                              | <b>Summe Investmentfonds</b>                     | \$ 939.058     | 9,64                     |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.09.2047                                                   | 347            | 323                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                                      | 353.300        | 358.706                  | 3,68                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.04.2036                                                   | 21             | 19                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055                                      | 484.450        | 499.521                  | 5,13                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.05.2036                                                   | 28             | 19                       | 0,00                              |                                                                   |                | 1.284.115                | 13,18                             |                                                  |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.08.2036                                                   | 361            | 263                      | 0,00                              | <b>US-SCHATZobligationen</b>                                      |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 5,092 % fällig am 19.10.2034                                                   | 15             | 14                       | 0,00                              | <b>U.S. Treasury Bonds</b>                                        |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 5,132 % fällig am 19.03.2034                                                   | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,000 % fällig am 15.11.2042                                      | 98.500         | 89.893                   | 0,92                              |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates</b>    |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.08.2044                                      | 244.900        | 224.438                  | 2,31                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 6,554 % fällig am 25.06.2033                                                   | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,625 % fällig am 15.05.2044                                      | 19.900         | 19.521                   | 0,20                              |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>SunTrust Alternative Loan Trust</b>                                         |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)</b>           |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 5,084 % fällig am 25.12.2035                                                   | 93             | 81                       | 0,00                              | 0,125 % fällig am 15.10.2025                                      | 12.387         | 12.344                   | 0,12                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035                                                   | 107            | 98                       | 0,00                              |                                                                   |                | 346.196                  | 3,55                              |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>                                     |                |                          |                                   | <b>AKTIEN</b>                                                     |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 4,400 % fällig am 25.09.2037                                                   | 6              | 6                        | 0,00                              | <b>OPTIONSSCHEINE</b>                                             |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Towd Point Mortgage Trust</b>                                               |                |                          |                                   | <b>Spirit Aviation</b>                                            |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 25.06.2057                                                   | 299            | 292                      | 0,00                              | <b>Holdings, Inc. -</b>                                           |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Wachovia Mortgage Loan Trust LLC</b>                                        |                |                          |                                   | <b>Exp. 11.03.2035</b>                                            | 150.483        | 751                      | 0,01                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 7,482 % fällig am 20.10.2035                                                   | 20             | 20                       | 0,00                              | <b>Spirit Aviation</b>                                            |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>                           |                |                          |                                   | <b>Holdings, Inc. -</b>                                           |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 3,413 % fällig am 25.05.2037                                                   | 11             | 9                        | 0,00                              | <b>Exp. 11.03.2035 (j)</b>                                        | 45.432         | 227                      | 0,00                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 3,716 % fällig am 25.04.2037                                                   | 8              | 7                        | 0,00                              |                                                                   |                | 978                      | 0,01                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 3,775 % fällig am 25.01.2037                                                   | 10             | 9                        | 0,00                              | <b>Summe USA</b>                                                  |                | 4.677.954                | 48,02                             |                                                  |                |                          |                                   |
| 4,017 % fällig am 25.10.2036                                                   | 187            | 165                      | 0,00                              |                                                                   |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                 | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|------------|------------------|------------------|---------------|-----------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BUS                     | 2,680 %    | 26.06.2025       | 07.07.2025       | CAD 110.000   | Province of Ontario 4,700 % fällig<br>am 02.06.2037             | \$ (83.090)                | \$ 80.615                      | \$ 80.704                                                      | 0,82                    |
|                         | 2,690      | 17.06.2025       | 03.07.2025       | 40.000        | Province of Quebec 4,200 % fällig<br>am 01.12.2057              | (30.630)                   | 29.315                         | 29.362                                                         | 0,30                    |
|                         | 2,700      | 24.06.2025       | 08.07.2025       | 30.000        | Province of Quebec 3,600 % fällig<br>am 01.09.2033              | (22.563)                   | 21.986                         | 22.017                                                         | 0,23                    |
| CEW                     | 2,720      | 27.06.2025       | 07.07.2025       | 110.000       | Province of Quebec 3,500 % fällig<br>am 01.12.2045 - 01.12.2048 | (83.185)                   | 80.616                         | 80.698                                                         | 0,83                    |
|                         |            | 30.06.2025       | 09.07.2025       | 30.000        | Province of Ontario 3,750 % fällig<br>am 02.12.2053             | (22.651)                   | 21.986                         | 22.006                                                         | 0,23                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |               |                                                                 | \$ (242.119)               | \$ 234.518                     | \$ 234.787                                                     | 2,41                    |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                        | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 156                  | \$ 95                                           | 0,00                    |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures    | Long  | 09.2025     | 426                  | 330                                             | 0,00                    |
| Euro-Bobl September Futures                         | Long  | 09.2025     | 1.847                | (664)                                           | (0,01)                  |
| Euro-BTP September Futures                          | Long  | 09.2025     | 277                  | (31)                                            | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                         | Long  | 09.2025     | 617                  | (743)                                           | (0,01)                  |
| Euro-Oat September Futures                          | Short | 09.2025     | 250                  | 142                                             | 0,00                    |
| Euro-Schatz September Futures                       | Long  | 09.2025     | 1.739                | (385)                                           | 0,00                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 3.091                | 655                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 11.576               | 14.575                                          | 0,15                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures        | Long  | 09.2025     | 4.447                | 8.461                                           | 0,09                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures       | Long  | 09.2025     | 2.893                | 6.158                                           | 0,06                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures          | Long  | 09.2025     | 367                  | 1.081                                           | 0,01                    |
|                                                     |       |             |                      | \$ 29.674                                       | 0,30                    |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------|-----------|-------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 91                   | \$ (30)  | \$ (3)    | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000       | 25.07.2025    | 253                  | (110)    | (8)       | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500       | 25.07.2025    | 132                  | (43)     | (8)       | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250       | 25.07.2025    | 105                  | (26)     | (13)      | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000       | 25.07.2025    | 91                   | (31)     | (68)      | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500       | 25.07.2025    | 385                  | (148)    | (205)     | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750       | 25.07.2025    | 105                  | (33)     | (46)      | 0,00                    |
|                                                                |               |               |                      | \$ (421) | \$ (351)  | 0,00                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                      |          |           | \$ 29.323 0,30          |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

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

| Referenzeinheit                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| AT&T, Inc.                          | 1,000 %                        | 20.06.2026       | \$ 12.800                 | \$ (142)                                        | 0,00                    |
| AT&T, Inc.                          | 1,000                          | 20.06.2028       | 4.400                     | 95                                              | 0,00                    |
| Boeing Co.                          | 1,000                          | 20.12.2026       | 500                       | 7                                               | 0,00                    |
| Boeing Co.                          | 1,000                          | 20.06.2027       | 1.200                     | 11                                              | 0,00                    |
| Carnival Corp.                      | 1,000                          | 20.12.2028       | 6.200                     | 1.415                                           | 0,02                    |
| Cellnex Telecom S.A.                | 5,000                          | 20.12.2030       | € 19.300                  | 1.636                                           | 0,02                    |
| Charter Communications, Inc.        | 5,000                          | 20.12.2027       | \$ 11.800                 | 338                                             | 0,00                    |
| Ford Motor Credit Co. LLC           | 5,000                          | 20.06.2026       | 800                       | (4)                                             | 0,00                    |
| Ford Motor Credit Co. LLC           | 5,000                          | 20.06.2027       | 6.900                     | (19)                                            | 0,00                    |
| General Electric Co.                | 1,000                          | 20.06.2026       | 35.000                    | 46                                              | 0,00                    |
| General Electric Co.                | 1,000                          | 20.12.2026       | 4.300                     | 7                                               | 0,00                    |
| General Motors Co.                  | 5,000                          | 20.06.2026       | 4.200                     | (600)                                           | (0,01)                  |
| Glencore Finance Europe Ltd.        | 5,000                          | 20.06.2031       | € 10.000                  | 109                                             | 0,00                    |
| Glencore Finance Europe Ltd.        | 5,000                          | 20.12.2031       | 800                       | 19                                              | 0,00                    |
| Marks & Spencer PLC                 | 1,000                          | 20.12.2028       | 11.000                    | 1.044                                           | 0,01                    |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000                          | 20.06.2029       | 7.200                     | (62)                                            | 0,00                    |
|                                     |                                |                  |                           | \$ 3.900                                        | 0,04                    |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.EM-42 5-Year Index | 1,000 %                        | 20.12.2029       | \$ 30.850                 | \$ 468                                          | 0,00                    |
| CDX.HY-43 5-Year Index | 5,000                          | 20.12.2029       | 299.330                   | 218                                             | 0,00                    |
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000                          | 20.06.2030       | 440.950                   | 13.306                                          | 0,14                    |
| CDX.IG-43 5-Year Index | 1,000                          | 20.12.2029       | 124.625                   | 31                                              | 0,00                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 962.400                   | 5.038                                           | 0,05                    |
|                        |                                |                  |                           | <b>\$ 19.061</b>                                | <b>0,19</b>             |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz        | Variable Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 0,500 %         | 16.09.2025       | £ 21.100    | \$ 1.178                                        | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500           | 19.03.2030       | 218.700     | 4.211                                           | 0,04                    |
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 19.03.2055       | 5.000       | (213)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2030       | \$ 164.200  | (1.283)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 19.03.2035       | 114.700     | (3.705)                                         | (0,04)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2035       | 79.900      | (837)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2055       | 105.400     | (1.858)                                         | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2029       | 517.200     | 1.238                                           | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 20.06.2031       | 175.400     | 3.116                                           | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,842           | 04.03.2030       | 10.800      | (161)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,874           | 05.03.2035       | 5.500       | (63)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,884           | 25.03.2035       | 5.900       | (77)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,899           | 11.03.2035       | 5.600       | (77)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,900           | 15.02.2035       | 28.496      | (516)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,905           | 12.03.2035       | 5.300       | (78)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,908           | 04.03.2035       | 2.300       | (33)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,930           | 24.03.2035       | 10.900      | (184)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,975           | 21.03.2035       | 7.100       | (148)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,291          | 02.01.2029       | BRL 251.700 | 385                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,320          | 02.01.2029       | 26.600      | 45                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,926          | 04.01.2027       | 42.200      | (22)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927          | 04.01.2027       | 380.300     | (197)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,500           | 19.06.2029       | CAD 91.700  | 3.089                                           | 0,03                    |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2025       | 115.100     | 1.200                                           | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,750           | 20.12.2033       | AUD 285.000 | 919                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR                  | 3,365           | 28.11.2029       | CZK 512.000 | 398                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2030       | € 4.450     | 8                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,350           | 29.04.2030       | 4.400       | (17)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,450           | 05.05.2035       | 3.200       | 56                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520           | 09.04.2035       | 3.400       | 36                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,550           | 16.04.2035       | 3.200       | 22                                              | 0,00                    |
|                                                |                                     |                 |                  |             | <b>\$ 6.432</b>                                 | <b>0,07</b>             |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                     |                 |                  |             | <b>\$ 29.393</b>                                | <b>0,30</b>             |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-<br>verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld        | Marktwert     | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------------|---------------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %       | 16.07.2025    | 12.400                    | \$ (17)        | \$ (1)        | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 22.900                    | (26)           | (1)           | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000         | 16.07.2025    | 11.500                    | (12)           | (1)           | 0,00                    |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850         | 16.07.2025    | 12.400                    | (15)           | (1)           | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 10.900                    | (13)           | (1)           | 0,00                    |
|            |                                  |                         |               |               |                           | <b>\$ (83)</b> | <b>\$ (5)</b> | <b>0,00</b>             |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750    | 11.08.2025    | 4.300                     | \$ (134) | \$ (3)    | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750        | 11.08.2025    | 4.300                     | (95)     | (22)      | 0,00                 |
|            |                           |               |               |                           | \$ (229) | \$ (25)   | 0,00                 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,555 %       | 24.07.2025    | 7.200                     | \$ (23)  | \$ (26)   | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,637         | 18.07.2025    | 11.900                    | (38)     | (60)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,700         | 21.07.2025    | 2.500                     | (8)      | (19)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770         | 09.07.2025    | 2.400                     | (8)      | (22)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,905         | 24.07.2025    | 7.200                     | (23)     | (13)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,037         | 18.07.2025    | 11.900                    | (38)     | (5)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050         | 21.07.2025    | 2.500                     | (8)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120         | 09.07.2025    | 2.400                     | (8)      | 0         | 0,00                 |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564         | 24.07.2025    | 7.600                     | (25)     | (29)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605         | 23.07.2025    | 10.600                    | (38)     | (50)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914         | 24.07.2025    | 7.600                     | (23)     | (13)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955         | 23.07.2025    | 10.600                    | (35)     | (13)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380         | 03.07.2025    | 2.000                     | (5)      | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460         | 16.07.2025    | 200                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640         | 03.07.2025    | 2.000                     | (5)      | (3)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720         | 16.07.2025    | 200                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,750         | 03.07.2025    | 12.200                    | (45)     | (83)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,790         | 09.07.2025    | 15.300                    | (50)     | (159)     | (0,01)               |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,100         | 03.07.2025    | 12.200                    | (46)     | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,140         | 09.07.2025    | 15.300                    | (50)     | 0         | 0,00                 |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525         | 28.07.2025    | 6.500                     | (21)     | (22)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583         | 23.07.2025    | 1.200                     | (4)      | (5)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653         | 14.07.2025    | 9.000                     | (27)     | (39)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680         | 07.07.2025    | 4.600                     | (16)     | (17)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695         | 17.07.2025    | 3.400                     | (10)     | (24)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775         | 07.07.2025    | 2.200                     | (7)      | (20)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875         | 28.07.2025    | 6.500                     | (21)     | (17)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933         | 23.07.2025    | 1.200                     | (4)      | (2)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030         | 07.07.2025    | 4.600                     | (16)     | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053         | 14.07.2025    | 9.000                     | (27)     | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095         | 17.07.2025    | 3.400                     | (10)     | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125         | 07.07.2025    | 2.200                     | (7)      | 0         | 0,00                 |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772         | 10.07.2025    | 10.600                    | (35)     | (101)     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122         | 10.07.2025    | 10.600                    | (35)     | 0         | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664         | 14.07.2025    | 8.700                     | (26)     | (42)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697         | 16.07.2025    | 13.200                    | (38)     | (89)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715         | 02.07.2025    | 2.200                     | (8)      | (9)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725         | 03.07.2025    | 7.200                     | (27)     | (38)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064         | 14.07.2025    | 8.700                     | (26)     | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065         | 02.07.2025    | 2.200                     | (8)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075         | 03.07.2025    | 7.200                     | (27)     | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097         | 16.07.2025    | 13.200                    | (38)     | (2)       | 0,00                 |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | \$ (916) | \$ (926)  | (0,01)               |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond       | 1,000 %                        | 20.12.2028       | \$ 23.600                 | \$ (467)                                     | \$ 429                                             | \$ (38)   | 0,00                 |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2028       | 22.000                    | (1.915)                                      | 1.821                                              | (94)      | 0,00                 |
| BPS        | Brazil Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2028       | 23.700                    | (458)                                        | 420                                                | (38)      | 0,00                 |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2026       | 12.600                    | 70                                           | 6                                                  | 76        | 0,00                 |
| BRC        | Indonesia Government International Bond    | 1,000                          | 20.06.2031       | 61.600                    | (2.646)                                      | 2.975                                              | 329       | 0,01                 |
| CBK        | Israel Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2027       | 9.000                     | (45)                                         | 116                                                | 71        | 0,00                 |
| DUB        | Eskom Holdings SOC Ltd.                    | 4,650                          | 30.06.2029       | 5.000                     | 0                                            | 296                                                | 296       | 0,00                 |
| GST        | ADLER Real Estate AG                       | 5,000                          | 20.12.2026       | € 7.400                   | (47)                                         | 346                                                | 299       | 0,00                 |
|            | Israel Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2029       | \$ 200                    | (2)                                          | 4                                                  | 2         | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 3,750                          | 24.12.2025       | 7.053                     | 0                                            | 11                                                 | 11        | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 4,850                          | 07.05.2026       | 13.920                    | 0                                            | 171                                                | 171       | 0,00                 |
|            | SoftBank Group Corp.                       | 1,000                          | 20.06.2026       | 19.200                    | (163)                                        | 79                                                 | (84)      | 0,00                 |
| JPM        | Israel Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2029       | 200                       | (2)                                          | 4                                                  | 2         | 0,00                 |
|            | Turkey Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2029       | 8.100                     | (602)                                        | 56                                                 | (546)     | (0,01)               |
| MYC        | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2028       | 22.400                    | (1.303)                                      | 1.208                                              | (95)      | 0,00                 |
|            |                                            |                                |                  |                           | \$ (7.580)                                   | \$ 7.942                                           | \$ 362    | 0,00                 |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.



## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat |     | Zu zahlende<br>Währung |        | Zu erhaltende<br>Währung |           | Nicht realisierte<br>Wertzunahme |     | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) |          | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) |    | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|-----|------------------------|--------|--------------------------|-----------|----------------------------------|-----|------------------------------------|----------|------------------------------------------------------|----|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH | 72.926                 |        | \$                       | 10.122    | \$                               | 0   |                                    | \$       | (70)                                                 | \$ | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | €                      | 5.251  |                          | 6.148     |                                  | 0   |                                    |          | (16)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | \$                     | 24.957 | AUD                      | 38.419    |                                  | 221 |                                    |          | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     |                        | 619    | CAD                      | 845       |                                  | 0   |                                    |          | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     |                        | 1.550  | €                        | 1.364     |                                  | 51  |                                    |          | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     |                        | 2.834  | NZD                      | 4.710     |                                  | 25  |                                    |          | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD | 38.419                 |        | \$                       | 24.971    |                                  | 0   |                                    | (222)    | (222)                                                |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD | 844                    |        |                          | 619       |                                  | 0   |                                    |          | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH | 121.863                |        |                          | 16.966    |                                  | 0   |                                    | (111)    | (111)                                                |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD | 4.710                  |        |                          | 2.837     |                                  | 0   |                                    | (25)     | (25)                                                 |    | 0,00                    |
| BOA        | 08.2025          | \$  | 6.162                  | €      | 5.251                    |           | 16                               |     |                                    | 0        | 16                                                   |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD | 17.459                 |        | \$                       | 11.307    |                                  | 0   |                                    | (135)    | (135)                                                |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR | 212.060.856            |        |                          | 12.998    |                                  | 0   |                                    | (62)     | (62)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW | 11.715.209             |        |                          | 8.592     |                                  | 0   |                                    | (70)     | (70)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PEN | 12.645                 |        |                          | 3.376     |                                  | 0   |                                    | (186)    | (186)                                                |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD | 234                    |        |                          | 182       |                                  | 0   |                                    | (1)      | (1)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$  | 12.571                 | CHF    | 10.299                   |           | 367                              |     |                                    | 0        | 367                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 1.163                  | NOK    | 11.745                   |           | 0                                |     |                                    | (2)      | (2)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 1.173                  | SEK    | 11.250                   |           | 8                                |     |                                    | 0        | 8                                                    |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD | 2.031                  |        | \$                       | 62        |                                  | 0   |                                    | (8)      | (8)                                                  |    | 0,00                    |
| BPS        | 08.2025          | \$  | 17.240                 | CNH    | 123.264                  |           | 33                               |     |                                    | 0        | 33                                                   |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |     | 182                    | SGD    | 233                      |           | 1                                |     |                                    | 0        | 1                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL | 245.306                |        | \$                       | 43.693    |                                  | 0   |                                    | (1.253)  | (1.253)                                              |    | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CAD | 140.113                |        |                          | 102.639   |                                  | 107 |                                    | (180)    | (73)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY | 5.842                  |        |                          | 814       |                                  | 0   |                                    | (2)      | (2)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €   | 3.176                  |        |                          | 3.604     |                                  | 0   |                                    | (124)    | (124)                                                |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR | 328.348.482            |        |                          | 20.130    |                                  | 0   |                                    | (94)     | (94)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR | 4.981.236              |        |                          | 58.070    |                                  | 19  |                                    | 0        | 19                                                   |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥   | 955.400                |        |                          | 6.620     |                                  | 5   |                                    | 0        | 5                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK | 5.470                  |        |                          | 569       |                                  | 0   |                                    | (5)      | (5)                                                  |    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | THB | 5.234                  |        |                          | 158       |                                  | 0   |                                    | (3)      | (3)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY | 285.478                |        |                          | 6.952     |                                  | 0   |                                    | (77)     | (77)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD | 304.706                |        |                          | 9.377     |                                  | 0   |                                    | (1.112)  | (1.112)                                              |    | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$  | 23.805                 | BRL    | 130.636                  |           | 130                              |     |                                    | 0        | 130                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 3.040                  | CAD    | 4.149                    |           | 0                                |     |                                    | 0        | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 601                    | €      | 521                      |           | 12                               |     |                                    | 0        | 12                                                   |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 9.742                  | IDR    | 158.996.140              |           | 50                               |     |                                    | 0        | 50                                                   |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 27.820                 | KRW    | 37.662.247               |           | 20                               |     |                                    | 0        | 20                                                   |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 12.720                 | THB    | 416.226                  |           | 97                               |     |                                    | 0        | 97                                                   |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 54.360                 | TWD    | 1.615.899                |           | 1.187                            |     |                                    | 0        | 1.187                                                |    | 0,01                    |
| BSH        | 08.2025          | CNH | 89.445                 |        | \$                       | 12.517    |                                  | 0   |                                    | (17)     | (17)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CZK | 2.182                  |        |                          | 98        |                                  | 0   |                                    | (6)      | (6)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TRY | 1.092                  |        |                          | 26        |                                  | 0   |                                    | 0        | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD | 365.823                |        |                          | 11.224    |                                  | 0   |                                    | (1.492)  | (1.492)                                              |    | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$  | 17.427                 | CNH    | 124.304                  |           | 0                                |     |                                    | (8)      | (8)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |     | 3.207                  | INR    | 278.738                  |           | 36                               |     |                                    | 0        | 36                                                   |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |     | 10.837                 | TWD    | 314.441                  |           | 93                               |     |                                    | 0        | 93                                                   |    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | ILS | 20.773                 |        | \$                       | 5.676     |                                  | 0   |                                    | (497)    | (497)                                                |    | (0,01)                  |
|            | 10.2025          | BRL | 69.900                 |        |                          | 11.405    |                                  | 0   |                                    | (1.110)  | (1.110)                                              |    | (0,01)                  |
|            | 06.2026          | \$  | 368                    | KWD    | 113                      |           | 0                                |     |                                    | 0        | 0                                                    |    | 0,00                    |
| CBK        | 05.2030          | KWD | 4.881                  |        | \$                       | 16.809    |                                  | 671 |                                    | 0        | 671                                                  |    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | AUD | 1.633                  |        |                          | 1.055     |                                  | 0   |                                    | (15)     | (15)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD | 467                    |        |                          | 340       |                                  | 0   |                                    | (2)      | (2)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €   | 1.614.862              |        |                          | 1.834.002 |                                  | 0   |                                    | (61.604) | (61.604)                                             |    | (0,63)                  |
|            | 07.2025          | ILS | 718                    |        |                          | 206       |                                  | 0   |                                    | (7)      | (7)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW | 499.001                |        |                          | 365       |                                  | 0   |                                    | (4)      | (4)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK | 1.543                  |        |                          | 151       |                                  | 0   |                                    | (1)      | (1)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB | 74.440                 |        |                          | 2.284     |                                  | 0   |                                    | (8)      | (8)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY | 60.418                 |        |                          | 1.513     |                                  | 0   |                                    | (5)      | (5)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$  | 366.873                | £      | 269.644                  |           | 2.635                            |     |                                    | 0        | 2.635                                                |    | 0,03                    |
| CBK        | 07.2025          |     | 102                    | ILS    | 345                      |           | 0                                |     |                                    | 0        | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 22                     | ¥      | 3.215                    |           | 0                                |     |                                    | 0        | 0                                                    |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 506                    | PLN    | 1.897                    |           | 19                               |     |                                    | 0        | 19                                                   |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |     | 24.012                 | TRY    | 987.600                  |           | 294                              |     |                                    | 0        | 294                                                  |    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR | 837.776                |        | \$                       | 46.348    |                                  | 0   |                                    | (720)    | (720)                                                |    | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CZK | 21.536                 |        |                          | 968       |                                  | 0   |                                    | (56)     | (56)                                                 |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £   | 268.492                |        |                          | 365.363   |                                  | 0   |                                    | (2.619)  | (2.619)                                              |    | (0,03)                  |
|            | 08.2025          | TRY | 2.584                  |        |                          | 62        |                                  | 0   |                                    | (1)      | (1)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$  | 4.544                  | INR    | 390.092                  |           | 0                                |     |                                    | (6)      | (6)                                                  |    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |     | 34                     | TRY    | 1.432                    |           | 0                                |     |                                    | 0        | 0                                                    |    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025          | THB                    | 273.889                  | \$                               | 8.236                              | \$                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 549.453                  |                                  | 16.888                             | \$                                                   | (197)                   |
|            | 07.2025          | \$                     | 24.056                   | AUD                              | 36.925                             |                                                      | (2.028)                 |
|            | 07.2025          |                        | 40.388                   | CAD                              | 55.309                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 815                      | CNY                              | 5.843                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.801                    | EGP                              | 152.070                            |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.435                    | €                                | 1.243                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 10.468                   | £                                | 7.706                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 8.664                    | IDR                              | 141.092.947                        |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 7.191                    | PEN                              | 25.683                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.164                    | THB                              | 38.862                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 17.870                   | TWD                              | 530.335                            |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 23.218                   | \$                               | 3.230                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 817.541                  |                                  | 25.084                             |                                                      | (3.334)                 |
|            | 08.2025          | \$                     | 58.346                   | CNH                              | 417.155                            |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 14                       | EGP                              | 775                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 26.269                   | INR                              | 2.263.994                          |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 44                       | PEN                              | 158                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 09.2025          | ILS                    | 9.246                    | \$                               | 2.480                              |                                                      | (267)                   |
|            | 09.2025          | PEN                    | 77.498                   |                                  | 21.188                             |                                                      | (604)                   |
|            | 11.2025          |                        | 15.464                   |                                  | 4.226                              |                                                      | (115)                   |
|            | 12.2025          |                        | 14.556                   |                                  | 3.932                              |                                                      | (152)                   |
| DUB        | 07.2025          | ILS                    | 349                      |                                  | 101                                |                                                      | (3)                     |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.163                    | EGP                              | 117.295                            |                                                      | 187                     |
|            | 07.2025          |                        | 446                      | KZT                              | 235.955                            |                                                      | 5                       |
|            | 07.2025          |                        | 475                      | SGD                              | 612                                |                                                      | 5                       |
|            | 07.2025          |                        | 519                      | TWD                              | 15.432                             |                                                      | 12                      |
|            | 08.2025          |                        | 218                      | EGP                              | 12.009                             |                                                      | 19                      |
|            | 08.2025          |                        | 11.130                   | INR                              | 960.428                            |                                                      | 46                      |
|            | 09.2025          | MXN                    | 149.971                  | \$                               | 7.790                              |                                                      | (84)                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 1.025                    | KZT                              | 542.331                            |                                                      | (5)                     |
|            | 12.2025          |                        | 2.761                    |                                  | 1.470.683                          |                                                      | (67)                    |
| FAR        | 07.2025          | AUD                    | 56.223                   | \$                               | 36.275                             |                                                      | (571)                   |
|            | 07.2025          | BRL                    | 3.268                    |                                  | 592                                |                                                      | (7)                     |
|            | 07.2025          | CAD                    | 152.876                  |                                  | 111.706                            |                                                      | (573)                   |
|            | 07.2025          | CHF                    | 12.975                   |                                  | 15.756                             |                                                      | (544)                   |
|            | 07.2025          | CNH                    | 37.097                   |                                  | 5.162                              |                                                      | (22)                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 3.636                    |                                  | 25                                 |                                                      | 0                       |
|            | 07.2025          | PLN                    | 9.822                    |                                  | 2.663                              |                                                      | (54)                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 408                      |                                  | 319                                |                                                      | (2)                     |
|            | 07.2025          | \$                     | 5.910                    | BRL                              | 33.791                             |                                                      | 281                     |
|            | 07.2025          |                        | 3.361                    | CHF                              | 2.691                              |                                                      | 19                      |
|            | 07.2025          |                        | 12.364                   | ¥                                | 1.773.761                          |                                                      | (84)                    |
|            | 07.2025          |                        | 390                      | SGD                              | 502                                |                                                      | 4                       |
|            | 08.2025          | CHF                    | 2.680                    | \$                               | 3.361                              |                                                      | (19)                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 45.723                   |                                  | 6.390                              |                                                      | (18)                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 5.319                    | INR                              | 459.986                            |                                                      | 32                      |
|            | 08.2025          |                        | 25                       | ¥                                | 3.622                              |                                                      | 0                       |
|            | 08.2025          |                        | 147                      | SGD                              | 187                                |                                                      | 0                       |
|            | 09.2025          | MXN                    | 133.547                  | \$                               | 6.859                              |                                                      | (153)                   |
|            | 09.2025          | \$                     | 592                      | BRL                              | 3.318                              |                                                      | 7                       |
|            | 09.2025          |                        | 0                        | PEN                              | 1                                  |                                                      | 0                       |
| GLM        | 07.2025          | BRL                    | 158.523                  | \$                               | 28.748                             |                                                      | (297)                   |
|            | 07.2025          | SGD                    | 73                       |                                  | 57                                 |                                                      | 0                       |
|            | 07.2025          | TWD                    | 69.351                   |                                  | 2.132                              |                                                      | (255)                   |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.117                    | EGP                              | 60.673                             |                                                      | 98                      |
|            | 07.2025          |                        | 2.054                    | IDR                              | 33.467.861                         |                                                      | 7                       |
|            | 07.2025          |                        | 127                      | TWD                              | 4.127                              |                                                      | 15                      |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 14.028                   | \$                               | 781                                |                                                      | (7)                     |
|            | 08.2025          | \$                     | 75                       | EGP                              | 4.162                              |                                                      | 7                       |
|            | 08.2025          |                        | 167                      | HUF                              | 60.562                             |                                                      | 10                      |
|            | 08.2025          |                        | 57                       | SGD                              | 72                                 |                                                      | 0                       |
| JPM        | 09.2025          |                        | 28.748                   | BRL                              | 160.974                            |                                                      | 302                     |
|            | 07.2025          | CNH                    | 70.284                   | \$                               | 9.738                              |                                                      | (84)                    |
|            | 07.2025          | £                      | 14.142                   |                                  | 19.072                             |                                                      | (308)                   |
|            | 07.2025          | IDR                    | 153.461                  |                                  | 9                                  |                                                      | 0                       |
|            | 07.2025          | KRW                    | 1.270.629                |                                  | 930                                |                                                      | (9)                     |
|            | 07.2025          | NZD                    | 6.808                    |                                  | 4.060                              |                                                      | (73)                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 17.715                   |                                  | 4.793                              |                                                      | (107)                   |
|            | 07.2025          | SGD                    | 10.045                   |                                  | 7.820                              |                                                      | (66)                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 377.087                  |                                  | 11.594                             |                                                      | (1.388)                 |
|            | 07.2025          | \$                     | 7.329                    | AUD                              | 11.182                             |                                                      | (1)                     |
|            | 07.2025          |                        | 41.923                   | BRL                              | 242.371                            |                                                      | 2.486                   |
|            | 07.2025          |                        | 1.384                    | IDR                              | 22.519.618                         |                                                      | 3                       |
|            | 07.2025          |                        | 5.427                    | PLN                              | 20.381                             |                                                      | 212                     |
|            | 07.2025          |                        | 6.835                    | TWD                              | 203.129                            |                                                      | 157                     |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 237.544                  | \$                               | 13.292                             |                                                      | (54)                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 11.182                   |                                  | 7.333                              |                                                      | 1                       |
|            | 08.2025          | CNH                    | 112.957                  |                                  | 15.716                             |                                                      | (113)                   |
|            | 08.2025          | TRY                    | 289                      |                                  | 7                                  |                                                      | 0                       |
|            | 08.2025          | TWD                    | 411.861                  |                                  | 12.636                             |                                                      | (1.680)                 |
|            | 08.2025          | \$                     | 17.368                   | CNH                              | 124.131                            |                                                      | 27                      |



| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |       |          |        |         |        |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|-------|----------|--------|---------|--------|
| MBC        | 08.2025          | \$                     | 3.600                    | INR                              | 312.129                            | \$                                                   | 31                      | \$    | 0        | \$     | 31      | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 119                      | SGD                              | 153                                |                                                      | 1                       |       | 0        |        | 1       | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 26                       | TWD                              | 858                                |                                                      | 4                       |       | 0        |        | 4       | 0,00   |
|            | 07.2025          | AUD                    | 11.182                   | \$                               | 7.315                              |                                                      | 0                       |       | (13)     |        | (13)    | 0,00   |
|            | 07.2025          | CAD                    | 81.354                   |                                  | 59.363                             |                                                      | 0                       |       | (267)    |        | (267)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | CHF                    | 18                       |                                  | 23                                 |                                                      | 0                       |       | (1)      |        | (1)     | 0,00   |
|            | 07.2025          | CNH                    | 33.695                   |                                  | 4.676                              |                                                      | 0                       |       | (33)     |        | (33)    | 0,00   |
|            | 07.2025          | €                      | 10.941                   |                                  | 12.560                             |                                                      | 0                       |       | (283)    |        | (283)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | SGD                    | 27.838                   |                                  | 21.674                             |                                                      | 0                       |       | (183)    |        | (183)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | THB                    | 137.488                  |                                  | 4.154                              |                                                      | 0                       |       | (80)     |        | (80)    | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD                    | 214.007                  |                                  | 6.566                              |                                                      | 0                       |       | (801)    |        | (801)   | (0,01) |
|            | 07.2025          | \$                     | 43.826                   | €                                | 37.722                             |                                                      | 454                     |       | 0        |        | 454     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 1.639                    | £                                | 1.209                              |                                                      | 18                      |       | 0        |        | 18      | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 1.730                    | IDR                              | 28.102.311                         |                                                      | 1                       |       | 0        |        | 1       | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 58.145                   | ¥                                | 8.464.206                          |                                                      | 456                     |       | (3)      |        | 453     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 3.891                    | PLN                              | 14.571                             |                                                      | 140                     |       | 0        |        | 140     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 29.822                   | SGD                              | 38.323                             |                                                      | 267                     |       | 0        |        | 267     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 1.746                    | THB                              | 58.228                             |                                                      | 47                      |       | 0        |        | 47      | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 5.525                    | TWD                              | 175.100                            |                                                      | 503                     |       | 0        |        | 503     | 0,01   |
|            | 08.2025          | CNH                    | 33.788                   | \$                               | 4.677                              |                                                      | 0                       |       | (58)     |        | (58)    | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD                    | 323.754                  |                                  | 9.989                              |                                                      | 0                       |       | (1.265)  |        | (1.265) | (0,01) |
|            | 08.2025          | \$                     | 3.652                    | CAD                              | 5.011                              |                                                      | 27                      |       | 0        |        | 27      | 0,00   |
|            | MYI              | 08.2025                |                          | 226                              | EGP                                | 12.436                                               |                         | 20    |          | 0      |         | 20     |
| 08.2025    |                  |                        | 3.151                    | SGD                              | 4.066                              |                                                      | 49                      |       | 0        |        | 49      | 0,00   |
| 07.2025    |                  | AUD                    | 27                       | \$                               | 17                                 |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
| 07.2025    |                  | £                      | 632                      |                                  | 867                                |                                                      | 2                       |       | 0        |        | 2       | 0,00   |
| 07.2025    |                  | ¥                      | 31.337                   |                                  | 217                                |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
| 07.2025    |                  | PLN                    | 51                       |                                  | 14                                 |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
| 07.2025    |                  | SGD                    | 1.026                    |                                  | 804                                |                                                      | 0                       |       | (1)      |        | (1)     | 0,00   |
| 07.2025    |                  | \$                     | 1.961                    | €                                | 1.675                              |                                                      | 4                       |       | 0        |        | 4       | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                        | 4.369                    | £                                | 3.185                              |                                                      | 0                       |       | (4)      |        | (4)     | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                        | 277                      | ¥                                | 40.069                             |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                        | 393                      | NOK                              | 3.965                              |                                                      | 0                       |       | (1)      |        | (1)     | 0,00   |
| 08.2025    |                  | CNH                    | 46.604                   | \$                               | 6.510                              |                                                      | 0                       |       | (21)     |        | (21)    | 0,00   |
| RBC<br>SCX | 08.2025          | NOK                    | 3.964                    |                                  | 393                                |                                                      | 1                       |       | 0        |        | 1       | 0,00   |
|            | 08.2025          | \$                     | 217                      | ¥                                | 31.222                             |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 10.2025          | BRL                    | 58.200                   | \$                               | 9.496                              |                                                      | 0                       |       | (925)    |        | (925)   | (0,01) |
|            | 07.2025          | CAD                    | 458                      |                                  | 333                                |                                                      | 0                       |       | (3)      |        | (3)     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 2.349                    |                                  | 1.707                              |                                                      | 0                       |       | (14)     |        | (14)    | 0,00   |
|            | 07.2025          | ILS                    | 5                        |                                  | 2                                  |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 07.2025          | ¥                      | 964.418                  |                                  | 6.712                              |                                                      | 35                      |       | 0        |        | 35      | 0,00   |
|            | 07.2025          | SGD                    | 812                      |                                  | 629                                |                                                      | 0                       |       | (8)      |        | (8)     | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD                    | 12.433                   |                                  | 427                                |                                                      | 0                       |       | (1)      |        | (1)     | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                     | 9.552                    | IDR                              | 155.648.339                        |                                                      | 34                      |       | 0        |        | 34      | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 1.742                    | NZD                              | 2.881                              |                                                      | 7                       |       | 0        |        | 7       | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 30.717                   | TWD                              | 913.390                            |                                                      | 727                     |       | 0        |        | 727     | 0,01   |
| SOG        | 07.2025          |                        | 23.187                   | ZAR                              | 411.981                            |                                                      | 0                       |       | (41)     |        | (41)    | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH                    | 144.077                  | \$                               | 20.139                             |                                                      | 0                       |       | (50)     |        | (50)    | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD                    | 120.109                  |                                  | 3.681                              |                                                      | 0                       |       | (494)    |        | (494)   | (0,01) |
|            | 08.2025          | \$                     | 5.184                    | CNH                              | 37.789                             |                                                      | 111                     |       | 0        |        | 111     | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 3.754                    | INR                              | 322.250                            |                                                      | 0                       |       | (5)      |        | (5)     | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 40                       | ¥                                | 5.697                              |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 629                      | SGD                              | 810                                |                                                      | 8                       |       | 0        |        | 8       | 0,00   |
|            | 07.2025          | ¥                      | 668.561                  | \$                               | 4.632                              |                                                      | 3                       |       | 0        |        | 3       | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.618                    | €                                | 1.404                              |                                                      | 33                      |       | 0        |        | 33      | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 41                       | NOK                              | 413                                |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 08.2025          | NOK                    | 413                      | \$                               | 41                                 |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 08.2025          | \$                     | 8                        | HUF                              | 2.859                              |                                                      | 1                       |       | 0        |        | 1       | 0,00   |
| SSB        | 08.2025          |                        | 22                       | INR                              | 1.857                              |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 4.632                    | ¥                                | 666.107                            |                                                      | 0                       |       | (3)      |        | (3)     | 0,00   |
|            | 07.2025          | £                      | 262.611                  | \$                               | 355.580                            |                                                      | 0                       |       | (4.290)  |        | (4.290) | (0,04) |
|            | 07.2025          | PEN                    | 25.336                   |                                  | 6.876                              |                                                      | 0                       |       | (260)    |        | (260)   | 0,00   |
| UAG        | 08.2025          | CAD                    | 647                      |                                  | 475                                |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 10.2025          | \$                     | 658                      | PEN                              | 2.426                              |                                                      | 23                      |       | 0        |        | 23      | 0,00   |
|            | 07.2025          | ILS                    | 53                       | \$                               | 15                                 |                                                      | 0                       |       | (1)      |        | (1)     | 0,00   |
|            | 07.2025          | KRW                    | 471.659                  |                                  | 348                                |                                                      | 0                       |       | (1)      |        | (1)     | 0,00   |
| WST        | 07.2025          | NOK                    | 14.579                   |                                  | 1.436                              |                                                      | 0                       |       | (5)      |        | (5)     | 0,00   |
|            | 07.2025          | THB                    | 21.961                   |                                  | 661                                |                                                      | 0                       |       | (15)     |        | (15)    | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                     | 181                      | ¥                                | 26.144                             |                                                      | 0                       |       | 0        |        | 0       | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 348                      | KRW                              | 471.887                            |                                                      | 1                       |       | 0        |        | 1       | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 804                      | CNH                              | 5.833                              |                                                      | 14                      |       | 0        |        | 14      | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 688                      | TRY                              | 30.375                             |                                                      | 49                      |       | 0        |        | 49      | 0,00   |
|            | 09.2025          |                        | 117                      | MXN                              | 2.266                              |                                                      | 2                       |       | 0        |        | 2       | 0,00   |
|            | 12.2025          |                        | 27.895                   |                                  | 540.021                            |                                                      | 170                     |       | 0        |        | 170     | 0,00   |
|            | 07.2025          | €                      | 19.393                   | \$                               | 21.909                             |                                                      | 0                       |       | (856)    |        | (856)   | (0,01) |
|            | 07.2025          | ¥                      | 7.681.999                |                                  | 53.344                             |                                                      | 161                     |       | 0        |        | 161     | 0,00   |
|            | 07.2025          | NZD                    | 783                      |                                  | 467                                |                                                      | 0                       |       | (8)      |        | (8)     | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.901.262                | €                                | 1.621.338                          |                                                      | 1.945                   |       | 0        |        | 1.945   | 0,02   |
|            | 08.2025          | €                      | 1.621.338                | \$                               | 1.905.413                          |                                                      | 0                       |       | (1.946)  |        | (1.946) | (0,02) |
| 08.2025    | \$               | 53.344                 | ¥                        | 7.653.727                        |                                    | 0                                                    |                         | (160) |          | (160)  | 0,00    |        |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 17.021                             | \$                                                   | (98.201)                | \$    | (81.180) | (0,83) |         |        |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                 | \$ 15.628             | \$ 0                          | \$ (90)                         | \$ (90)                                       | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | AUD 10.158            | 90                            | 0                               | 90                                            | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | AUD                 | \$ 65                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | AUD 158               | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | AUD                 | \$ 58                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | AUD 9.958             | 168                           | 0                               | 168                                           | 0,01                 |
| CBK        | 07.2025          | AUD                 | \$ 149                | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | AUD 3                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          |                     | 9.304                 | 165                           | 0                               | 165                                           | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | AUD                 | \$ 15.536             | 0                             | (24)                            | (24)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | AUD 10.000            | 157                           | 0                               | 157                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 10.164                | 24                            | 0                               | 24                                            | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | AUD                 | \$ 14.703             | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | AUD 9.642             | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | AUD                 | \$ 167                | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | AUD 430               | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 609                        | \$ (118)                        | \$ 491                                        | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD                 | \$ 52.424             | \$ 10                         | \$ 0                            | \$ 10                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | CAD 38.429            | 0                             | (9)                             | (9)                                           | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          |                     | 111.019               | 998                           | 0                               | 998                                           | 0,01                 |
| CBK        | 07.2025          |                     | 119.690               | 1.566                         | 0                               | 1.566                                         | 0,02                 |
| GLM        | 07.2025          |                     | 4                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          |                     | 2.156                 | 15                            | 0                               | 15                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CAD                 | \$ 93.541             | 0                             | (504)                           | (504)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | CAD 119.567           | 785                           | 0                               | 785                                           | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 68.049                | 505                           | 0                               | 505                                           | 0,01                 |
| MYI        | 07.2025          | CAD                 | \$ 106.325            | 0                             | (326)                           | (326)                                         | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          |                     | 108.413               | 0                             | (476)                           | (476)                                         | (0,01)               |
| SCX        | 07.2025          | \$                  | CAD 225               | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | CAD                 | \$ 93.535             | 0                             | (13)                            | (13)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | CAD 68.536            | 14                            | 0                               | 14                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 3.895                      | \$ (1.328)                      | \$ 2.567                                      | 0,03                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                 | \$ 6.899              | \$ 0                          | \$ (29)                         | \$ (29)                                       | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | CHF 8.638             | 29                            | 0                               | 29                                            | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | CHF                 | \$ 26                 | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CHF 326               | 10                            | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | CHF                 | \$ 29                 | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CHF 115               | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | CHF                 | \$ 6.861              | 0                             | (49)                            | (49)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CHF 8.198             | 283                           | 0                               | 283                                           | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 8.570                 | 49                            | 0                               | 49                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CHF                 | \$ 18                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CHF 8.196             | 265                           | 0                               | 265                                           | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          |                     | 44                    | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          |                     | 7.725                 | 234                           | 0                               | 234                                           | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | CHF                 | \$ 138                | 0                             | (4)                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 874                        | \$ (84)                         | \$ 790                                        | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                   | \$ 728.980            | \$ 0                          | \$ (2.165)                      | \$ (2.165)                                    | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | € 855.418             | 2.161                         | 0                               | 2.161                                         | 0,02                 |
| BOA        | 07.2025          |                     | 904.063               | 29.260                        | 0                               | 29.260                                        | 0,30                 |
| BPS        | 07.2025          | €                   | \$ 2.902              | 0                             | (79)                            | (79)                                          | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     | 1.835                 | 0                             | (59)                            | (59)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | € 911.702             | 30.607                        | 0                               | 30.607                                        | 0,31                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK        | 07.2025          | € 6.793                | \$ 7.827                 | \$ 0                             | \$ (147)                           | \$ (147)                                             | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 2.392               | € 2.072                  | 41                               | 0                                  | 41                                                   | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | € 801.498              | \$ 929.818               | 0                                | (11.019)                           | (11.019)                                             | (0,11)                  |
|            | 08.2025          | \$ 929.818             | € 799.741                | 11.006                           | 0                                  | 11.006                                               | 0,11                    |
| MBC        | 07.2025          | € 11.257               | \$ 12.958                | 0                                | (256)                              | (256)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.370               | € 2.903                  | 37                               | 0                                  | 37                                                   | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | € 181                  | \$ 207                   | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          | 794.809                | 932.032                  | 0                                | (953)                              | (953)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 840.877             | € 744.323                | 32.845                           | 0                                  | 32.845                                               | 0,34                    |
|            | 08.2025          | 934.067                | 794.809                  | 954                              | 0                                  | 954                                                  | 0,01                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 106.911                       | \$ (14.684)                        | \$ 92.227                                            | 0,95                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 208.055              | \$ 285.493               | \$ 385                           | \$ 0                               | \$ 385                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 285.533             | £ 208.055                | 0                                | (384)                              | (384)                                                | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | £ 226.975              | \$ 308.823               | 0                                | (2.212)                            | (2.212)                                              | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 296.563             | £ 219.644                | 4.426                            | 0                                  | 4.426                                                | 0,04                    |
| CBK        | 08.2025          | 308.651                | 226.817                  | 2.212                            | 0                                  | 2.212                                                | 0,02                    |
|            | 07.2025          | £ 21                   | \$ 28                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | \$ 528                 | £ 388                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 313.631                | 232.805                  | 5.394                            | 0                                  | 5.394                                                | 0,05                    |
| MBC        | 07.2025          | £ 25.152               | \$ 34.088                | 0                                | (379)                              | (379)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 723                 | £ 526                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | £ 224.760              | \$ 308.190               | 191                              | 0                                  | 191                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 313.718             | £ 231.694                | 3.784                            | 0                                  | 3.784                                                | 0,04                    |
| UAG        | 08.2025          | 308.230                | 224.760                  | 0                                | (186)                              | (186)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 95                   | \$ 128                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 16.396                        | \$ (3.165)                         | \$ 13.231                                            | 0,13                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Administrative JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC        | 07.2025          | \$ 629                 | ¥ 90.529                 | \$ 0                             | \$ (3)                             | \$ (3)                                               | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | 7                      | 1.022                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 589                    | 84.734                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | ¥ 94.491               | \$ 652                   | 1                                | (3)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 283                 | ¥ 40.922                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 08.2025          | 652                    | 94.143                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 80.405               | \$ 557                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | \$ 683                 | ¥ 98.214                 | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 555                    | 79.861                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 103.567              | \$ 717                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 717                 | ¥ 103.187                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 3                             | \$ (12)                            | \$ (9)                                               | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional MXN (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 07.2025          | \$ 23.481              | MXN 457.338              | \$ 727                           | \$ 0                               | \$ 727                                               | 0,01                    |
| BRC        | 07.2025          | MXN 448.445            | \$ 23.362                | 0                                | (376)                              | (376)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 23.796              | MXN 458.386              | 383                              | 0                                  | 383                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | 1.347                  | 26.019                   | 30                               | 0                                  | 30                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MXN 460.831            | \$ 24.024                | 0                                | (369)                              | (369)                                                | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | \$ 23.687              | MXN 461.111              | 721                              | 0                                  | 721                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          | 23.933                 | 460.831                  | 375                              | 0                                  | 375                                                  | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | MXN 459.661            | \$ 23.911                | 0                                | (420)                              | (420)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 21.392              | MXN 416.046              | 631                              | 0                                  | 631                                                  | 0,01                    |
| UAG        | 08.2025          | 23.822                 | 459.661                  | 425                              | 0                                  | 425                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 437                    | 8.422                    | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 3.301                         | \$ (1.165)                         | \$ 2.136                                             | 0,02                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BRC        | 07.2025          | \$                  | 11 SEK                | 108                           | \$ 0                            | \$ 0                                          | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | SEK                 | 67.357                | \$ 7.107                      | 39                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 105                   | SEK 1.000                     | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 7.107                 | 67.211                        | 0                               | (39)                                          | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          |                     | 6.895                 | 66.044                        | 34                              | 0                                             | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          |                     | 6.468                 | 62.158                        | 54                              | 0                                             | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          |                     | 6.895                 | 66.255                        | 57                              | 0                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 184                        | \$ (39)                         | \$ 145                                        | 0,00                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD                 | 18.762                | \$ 14.652                     | \$ 0                            | \$ (79)                                       | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 12.501                | SGD 16.114                    | 150                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 14.652                | 18.718                        | 81                              | 0                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     | 2.902                 | 3.733                         | 29                              | 0                                             | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | SGD                 | 226                   | \$ 176                        | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.171                 | SGD 1.500                     | 7                               | 0                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | SGD                 | 41.519                | \$ 32.554                     | 0                               | (45)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 40.039                | SGD 51.519                    | 411                             | 0                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 32.554                | 41.420                        | 48                              | 0                                             | 0,00                 |
| GLM        | 07.2025          | SGD                 | 18.397                | \$ 14.433                     | 0                               | (12)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 14.433                | SGD 18.353                    | 13                              | 0                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | SGD                 | 19.000                | \$ 14.839                     | 0                               | (79)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 38.226                | SGD 49.102                    | 326                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 14.839                | 18.956                        | 82                              | 0                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | SGD                 | 48.175                | \$ 37.257                     | 0                               | (567)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 29.471                | SGD 37.805                    | 212                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 36.123                | 46.606                        | 562                             | 0                                             | 0,01                 |
| MYI        | 07.2025          | SGD                 | 387                   | \$ 302                        | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.362                 | SGD 1.749                     | 11                              | 0                                             | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | SGD                 | 7.946                 | \$ 6.160                      | 0                               | (78)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 6.160                 | SGD 7.928                     | 80                              | 0                                             | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          |                     | 447                   | 570                           | 1                               | 0                                             | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          |                     | 140                   | 180                           | 1                               | 0                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 2.014                      | \$ (864)                        | \$ 1.150                                      | 0,01                 |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 30.954 0,32

| BESCHREIBUNG                               | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|--------------------------------------------|-------------|-------------------|----------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |             |                   |                      |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 10.400   | \$ 1.248          | 0,01                 |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |             | \$ 1.248          | 0,01                 |
| Summe Anlagen                              |             | \$ 10.910.570     | 112,01               |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |             | \$ (1.169.570)    | (12,01)              |
| Nettovermögen                              |             | \$ 9.741.000      | 100,00               |

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

- \* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## (j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,50 %):

| Emittentenbeschreibung                                        | Kaufdatum               | Kosten    | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------|-------------------------|
| Altice France S.A. 11,500 % fällig am 01.02.2027              | 20.12.2023 - 15.11.2024 | \$ 6.821  | \$ 7.471  | 0,08                    |
| Corestate Capital Holding S.A.                                | 22.08.2023              | 0         | 0         | 0,00                    |
| DrillCo Holding Lux S.A.                                      | 08.06.2023              | 8.869     | 9.090     | 0,09                    |
| Intelsat Emergence S.A.                                       | 24.02.2020 - 29.10.2021 | 16.083    | 6.366     | 0,07                    |
| Pantheon Senior Debt Secondaries 6,317 % fällig am 26.03.2026 | 18.03.2025              | 3.000     | 3.000     | 0,03                    |
| Project Alfa 4,256 % fällig am 27.02.2026                     | 28.02.2025              | 1.769     | 1.996     | 0,02                    |
| Spirit Aviation Holdings, Inc. - Exp. 11.03.2035              | 17.03.2025              | 398       | 227       | 0,00                    |
|                                                               |                         | \$ 36.940 | \$ 28.150 | 0,29                    |

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 77.923 USD (31. Dezember 2024: 65.347 USD) und Barmittel in Höhe von 1.111 USD (31. Dezember 2024: 1.722 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 4.432 USD) und Barmittel in Höhe von 285 USD (30. Juni 2025: 232 USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 192.944 USD (31. Dezember 2024: 177.353 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 33.310 USD (31. Dezember 2024: 37.150 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert     |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 39                                                                    | \$ 9.432.167                                                    | \$ 213.870                                                   | \$ 9.646.076  |
| Investmentfonds                     | 939.058                                                                  | 0                                                               | 0                                                            | 939.058       |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                        | 234.518                                                         | 0                                                            | 234.518       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (175)                                                                    | 89.845                                                          | 0                                                            | 89.670        |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                        | 1.248                                                           | 0                                                            | 1.248         |
| Summen                              | \$ 938.922                                                               | \$ 9.757.778                                                    | \$ 213.870                                                   | \$ 10.910.570 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                     | \$ 7.859.043                                                    | \$ 156.801                                                   | \$ 8.015.844 |
| Investmentfonds                     | 598.688                                                                  | 270.241                                                         | 0                                                            | 868.929      |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                        | 968.508                                                         | 0                                                            | 968.508      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (3.557)                                                                  | (4.021)                                                         | 355                                                          | (7.223)      |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                        | 1.301                                                           | 0                                                            | 1.301        |
| Summen                              | \$ 595.131                                                               | \$ 9.095.072                                                    | \$ 157.156                                                   | \$ 9.847.359 |

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

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

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 1,500 %    | 29.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (986)     | \$ (988)                                       | (0,01)                  |
| BRC        | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (6.679)    | (7.846)                                        | (0,08)                  |
|            | 1,600      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.083)      | (1.272)                                        | (0,01)                  |
|            | 3,750      | 23.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (5.434)   | (5.439)                                        | (0,05)                  |
|            | 4,150      | 02.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (6.525)      | (6.571)                                        | (0,07)                  |
|            | 4,150      | 09.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.608)      | (1.618)                                        | (0,02)                  |
|            | 4,200      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | (6.996)      | (7.153)                                        | (0,07)                  |
|            | 4,300      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | (2.442)      | (2.498)                                        | (0,02)                  |
| JPS        | 4,300      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (9.651)      | (9.660)                                        | (0,10)                  |
| MYI        | 2,000      | 14.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.197)      | (1.200)                                        | (0,01)                  |
|            | 3,250      | 19.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.583)      | (1.589)                                        | (0,02)                  |
|            | 3,250      | 23.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (827)        | (830)                                          | (0,01)                  |
|            | 3,250      | 05.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (634)        | (635)                                          | (0,01)                  |
|            | 3,600      | 25.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (533)        | (534)                                          | (0,01)                  |
|            | 3,750      | 05.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.843)      | (1.848)                                        | (0,02)                  |
|            | 4,200      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | (171)        | (175)                                          | 0,00                    |
| NOM        | 4,100      | 26.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.253)      | (1.254)                                        | (0,01)                  |
|            | 4,200      | 21.02.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (738)        | (739)                                          | (0,01)                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund (Forts.)

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus |                      |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|-----------------------|----------------------|
|                                    |            |                  |                    |              | Pensionsgeschäften    | % des Nettovermögens |
| SCX                                | 4,200 %    | 26.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (10.218)  | \$ (10.224)           | (0,10)               |
|                                    | 4,300      | 26.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (3.745)      | (3.748)               | (0,04)               |
|                                    | 4,150      | 16.01.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (7.252)      | (7.391)               | (0,08)               |
|                                    | 4,250      | 29.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.813)      | (1.820)               | (0,02)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (75.032)           | (0,77)               |

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (133)                         | \$ 270                             | \$ 137                          | \$ (577)                         | \$ 480                             | \$ (97)                         |
| BOA        | 29.090                           | (27.590)                           | 1.500                           | (1.301)                          | 1.260                              | (41)                            |
| BPS        | (1.869)                          | 1.650                              | (219)                           | (3.135)                          | 3.220                              | 85                              |
| BRC        | (26.624)                         | 23.860                             | (2.764)                         | (1.163)                          | 1.190                              | 27                              |
| BSH        | 20                               | 30                                 | 50                              | 50                               | 0                                  | 50                              |
| CBK        | (4.658)                          | 5.110                              | 452                             | 1.207                            | (1.130)                            | 77                              |
| DUB        | 559                              | (510)                              | 49                              | (17.996)                         | 15.810                             | (2.186)                         |
| FAR        | (839)                            | 180                                | (659)                           | (138)                            | 0                                  | (138)                           |
| GLM        | (267)                            | 310                                | 43                              | (691)                            | 770                                | 79                              |
| GST        | 397                              | (300)                              | 97                              | 181                              | (240)                              | (59)                            |
| JPM        | 4.131                            | (3.740)                            | 391                             | (23)                             | 0                                  | (23)                            |
| MBC        | (320)                            | 560                                | 240                             | (15.930)                         | 12.350                             | (3.580)                         |
| MYC        | (276)                            | 80                                 | (196)                           | (231)                            | 350                                | 119                             |
| MYI        | (486)                            | 440                                | (46)                            | 643                              | (820)                              | (177)                           |
| RBC        | (247)                            | 0                                  | (247)                           | (1.394)                          | 1.270                              | (124)                           |
| RYL        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | 8                                | 0                                  | 8                               |
| SCX        | 942                              | (1.200)                            | (258)                           | 9.098                            | (6.950)                            | 2.148                           |
| SOG        | 34                               | 0                                  | 34                              | (330)                            | 120                                | (210)                           |
| SSB        | (736)                            | 820                                | 84                              | 155                              | 0                                  | 155                             |
| TOR        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (415)                            | 330                                | (85)                            |
| UAG        | 254                              | (290)                              | (36)                            | (183)                            | 0                                  | (183)                           |
| WST        | 31.982                           | (30.500)                           | 1.482                           | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |

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

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 38,63             | 38,24             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 34,11             | 30,05             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,08              | 0,10              |
| Investmentfonds                                                        | 7,09              | 7,46              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 1,77              | 8,31              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,24              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,30              | 0,41              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,15              | 0,39              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,01              | 0,00              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 16,62             | 15,04             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------|-------------------|-------------------|
| Angola                | 0,15              | 0,17              |
| Argentinien           | 0,88              | 0,98              |
| Australien            | 0,83              | 0,27              |
| Österreich            | 0,12              | 0,04              |
| Aserbaidschan         | 0,12              | 0,10              |
| Belgien               | 0,06              | k. A.             |
| Bermuda               | 1,00              | 1,11              |
| Brasilien             | 0,60              | 0,59              |
| Bulgarien             | 0,21              | 0,14              |
| Kamerun               | 0,13              | 0,14              |
| Kanada                | 1,01              | 0,91              |
| Kaimaninseln          | 2,00              | 2,06              |
| Chile                 | 0,78              | 0,65              |
| China                 | 0,00              | 0,00              |
| Kolumbien             | 0,75              | 0,75              |
| Costa Rica            | 0,05              | 0,06              |
| Zypern                | 0,11              | 0,10              |
| Tschechische Republik | 0,13              | 0,12              |
| Dänemark              | 0,21              | 0,15              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Dominikanische Republik                                                                | 0,40              | 0,34              |
| Ecuador                                                                                | 0,44              | 0,38              |
| Ägypten                                                                                | 0,95              | 0,58              |
| El Salvador                                                                            | 0,17              | 0,28              |
| Finnland                                                                               | 0,06              | 0,06              |
| Frankreich                                                                             | 2,32              | 1,78              |
| Gabun                                                                                  | 0,12              | k. A.             |
| Deutschland                                                                            | 1,27              | 1,24              |
| Ghana                                                                                  | 0,32              | 0,22              |
| Guatemala                                                                              | 0,22              | 0,19              |
| Guernsey, Kanalinseln                                                                  | 0,05              | k. A.             |
| Hongkong                                                                               | 0,13              | 0,13              |
| Ungarn                                                                                 | 0,73              | 0,61              |
| Indonesien                                                                             | 0,93              | 0,89              |
| International                                                                          | 0,11              | 0,10              |
| Irland                                                                                 | 6,95              | 6,55              |
| Insel Man                                                                              | 0,02              | 0,02              |
| Israel                                                                                 | 0,49              | 0,34              |
| Italien                                                                                | 2,09              | 2,60              |
| Elfenbeinküste                                                                         | 0,25              | 0,18              |
| Japan                                                                                  | 0,48              | 0,34              |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 0,29              | 0,41              |
| Jordanien                                                                              | 0,04              | 0,05              |
| Kasachstan                                                                             | 0,13              | 0,14              |
| Kenia                                                                                  | 0,21              | 0,17              |
| Libanon                                                                                | 0,07              | k. A.             |
| Liberia                                                                                | 0,10              | 0,07              |
| Luxemburg                                                                              | 1,27              | 1,50              |
| Mazedonien                                                                             | 0,06              | 0,08              |
| Mexiko                                                                                 | 2,67              | 2,65              |
| Mongolei                                                                               | 0,13              | 0,20              |
| Marokko                                                                                | 0,10              | k. A.             |
| Multinational                                                                          | 0,15              | 0,04              |
| Niederlande                                                                            | 1,53              | 1,71              |
| Nigeria                                                                                | 0,53              | 0,54              |
| Norwegen                                                                               | 0,02              | 0,02              |
| Oman                                                                                   | 0,23              | 0,25              |
| Pakistan                                                                               | 0,25              | 0,26              |
| Panama                                                                                 | 0,77              | 0,86              |
| Paraguay                                                                               | 0,21              | 0,23              |
| Peru                                                                                   | 0,94              | 0,85              |
| Philippinen                                                                            | 0,02              | 0,02              |
| Polen                                                                                  | 0,56              | 0,23              |
| Portugal                                                                               | 0,19              | 0,19              |
| Rumänien                                                                               | 0,64              | 0,56              |
| Russland                                                                               | 0,02              | 0,02              |
| Saudi-Arabien                                                                          | 1,11              | 0,72              |
| Senegal                                                                                | 0,19              | 0,24              |
| Serbien                                                                                | 0,24              | 0,24              |
| Singapur                                                                               | 0,24              | 0,26              |
| Südafrika                                                                              | 1,03              | 0,79              |
| Spanien                                                                                | 1,06              | 0,84              |
| Sri Lanka                                                                              | 0,18              | 0,20              |
| Supranational                                                                          | 0,72              | 0,72              |
| Schweden                                                                               | 0,02              | 0,02              |
| Schweiz                                                                                | 0,33              | 0,35              |
| Türkei                                                                                 | 0,91              | 1,01              |
| Ukraine                                                                                | 0,36              | 0,53              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 0,35              | 0,56              |
| Großbritannien                                                                         | 5,05              | 4,34              |
| USA                                                                                    | 48,02             | 43,72             |
| Usbekistan                                                                             | 0,06              | 0,06              |
| Venezuela                                                                              | 0,25              | 0,05              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,14              | 0,38              |
| Investmentfonds                                                                        | 9,64              | 9,89              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 2,41              | 11,03             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,30              | (0,23)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,04              | 0,04              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,19              | 0,05              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,07              | 0,43              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,00              | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | (0,02)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,83)            | 0,51              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,16              | (0,84)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,01              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (12,01)           | (12,10)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund

| BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|--------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>      |                |                          |                          |       |
| <b>ANGOLA</b>                        |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |                |                          |                          |       |
| Angola Government International Bond |                |                          |                          |       |
| 8,000 % fällig am 26.11.2029         | \$ 300         | \$ 273                   | 0,08                     |       |
| 9,125 % fällig am 26.11.2049         | 400            | 310                      | 0,10                     |       |
| Summe Angola                         |                | 583                      | 0,18                     |       |

|                                         |       |       |      |  |
|-----------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>ARGENTINIEN</b>                      |       |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |       |       |      |  |
| Argentina Government International Bond |       |       |      |  |
| 3,500 % fällig am 09.07.2041            | 4.722 | 2.939 | 0,89 |  |

|                                             |           |       |      |  |
|---------------------------------------------|-----------|-------|------|--|
| <b>AUSTRALIEN</b>                           |           |       |      |  |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>     |           |       |      |  |
| Latitude Australia Credit Card Master Trust |           |       |      |  |
| 0,000 % fällig am 23.11.2037 (a)            | AUD 2.500 | 1.636 | 0,50 |  |

|                                         |        |       |      |  |
|-----------------------------------------|--------|-------|------|--|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |       |      |  |
| GTA Finance Co. Pty. Ltd.               |        |       |      |  |
| 5,400 % fällig am 04.12.2029            | 620    | 417   | 0,13 |  |
| Santos Finance Ltd.                     |        |       |      |  |
| 6,875 % fällig am 19.09.2033            | \$ 500 | 546   | 0,16 |  |
| Woodside Finance Ltd.                   |        |       |      |  |
| 5,100 % fällig am 12.09.2034            | 400    | 388   | 0,12 |  |
|                                         |        | 1.351 | 0,41 |  |
| Summe Australien                        |        | 2.987 | 0,91 |  |

|                                              |     |     |      |  |
|----------------------------------------------|-----|-----|------|--|
| <b>ASERBAIDSDCHAN</b>                        |     |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |     |     |      |  |
| SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC |     |     |      |  |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026                 | 400 | 397 | 0,12 |  |
| Southern Gas Corridor CJSC                   |     |     |      |  |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026                 | 400 | 406 | 0,12 |  |
| Summe Aserbaidsschan                         |     | 803 | 0,24 |  |

|                                         |       |     |      |  |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|--|
| <b>BELGIEN</b>                          |       |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |  |
| Manuchar Group SARL                     |       |     |      |  |
| 6,943 % fällig am 07.07.2032 (a)        | € 300 | 345 | 0,10 |  |

|                                         |        |       |      |  |
|-----------------------------------------|--------|-------|------|--|
| <b>BERMUDA</b>                          |        |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |       |      |  |
| Aircastle Ltd.                          |        |       |      |  |
| 2,850 % fällig am 26.01.2028            | \$ 500 | 476   | 0,14 |  |
| Seadrill Finance Ltd.                   |        |       |      |  |
| 8,375 % fällig am 01.08.2030            | 300    | 306   | 0,09 |  |
| Valaris Ltd.                            |        |       |      |  |
| 8,375 % fällig am 30.04.2030            | 500    | 513   | 0,16 |  |
| Summe Bermuda                           |        | 1.295 | 0,39 |  |

|                                         |     |       |      |  |
|-----------------------------------------|-----|-------|------|--|
| <b>BRASILIEN</b>                        |     |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |       |      |  |
| Banco BTG Pactual S.A.                  |     |       |      |  |
| 6,250 % fällig am 08.04.2029            | 800 | 823   | 0,25 |  |
| Banco do Brasil S.A.                    |     |       |      |  |
| 6,000 % fällig am 18.03.2031            | 400 | 405   | 0,12 |  |
| Embraer Netherlands Finance BV          |     |       |      |  |
| 5,980 % fällig am 11.02.2035            | 275 | 284   | 0,09 |  |
| Itau Unibanco Holding S.A.              |     |       |      |  |
| 6,000 % fällig am 27.02.2030            | 600 | 616   | 0,19 |  |
|                                         |     | 2.128 | 0,65 |  |

|                                      |     |       |      |  |
|--------------------------------------|-----|-------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |     |       |      |  |
| Brazil Government International Bond |     |       |      |  |
| 7,125 % fällig am 13.05.2054         | 350 | 336   | 0,10 |  |
| Summe Brasilien                      |     | 2.464 | 0,75 |  |

|                                        |       |     |      |  |
|----------------------------------------|-------|-----|------|--|
| <b>BULGARIEN</b>                       |       |     |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |       |     |      |  |
| Bulgaria Government International Bond |       |     |      |  |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038           | € 300 | 359 | 0,11 |  |

|                              |                |                          |                          |       |
|------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
| 5,000 % fällig am 05.03.2037 | \$ 400         | \$ 392                   | 0,12                     |       |
| Summe Bulgarien              |                | 751                      | 0,23                     |       |

|                                                    |       |     |      |  |
|----------------------------------------------------|-------|-----|------|--|
| <b>KAMERUN</b>                                     |       |     |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |       |     |      |  |
| Republic of Cameroon Government International Bond |       |     |      |  |
| 5,950 % fällig am 07.07.2032                       | € 450 | 414 | 0,13 |  |

|                                         |        |     |      |  |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|--|
| <b>KANADA</b>                           |        |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |  |
| Air Canada Pass-Through Trust           |        |     |      |  |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030            | \$ 330 | 334 | 0,10 |  |
| B.C. Ltd.                               |        |     |      |  |
| 10,000 % fällig am 15.04.2032           | 100    | 101 | 0,03 |  |

|                                 |        |       |      |  |
|---------------------------------|--------|-------|------|--|
| B.C. Unlimited Liability Co.    |        |       |      |  |
| 4,000 % fällig am 15.10.2030    | 350    | 327   | 0,10 |  |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028    | 700    | 687   | 0,21 |  |
| 5,625 % fällig am 15.09.2029    | 550    | 558   | 0,17 |  |
| CGI, Inc.                       |        |       |      |  |
| 4,950 % fällig am 14.03.2030    | 400    | 404   | 0,12 |  |
| CI Financial Corp.              |        |       |      |  |
| 7,500 % fällig am 30.05.2029    | 300    | 317   | 0,10 |  |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. |        |       |      |  |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028    | € 300  | 350   | 0,10 |  |
| geeasy Ltd.                     |        |       |      |  |
| 9,250 % fällig am 01.12.2028    | \$ 400 | 423   | 0,13 |  |
| Open Text Corp.                 |        |       |      |  |
| 3,875 % fällig am 15.02.2028    | 700    | 680   | 0,21 |  |
|                                 |        | 4.181 | 1,27 |  |

|                                           |     |       |      |  |
|-------------------------------------------|-----|-------|------|--|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |     |       |      |  |
| GFL Environmental, Inc.                   |     |       |      |  |
| 6,824 % fällig am 03.03.2032              | 300 | 301   | 0,09 |  |
| Summe Kanada                              |     | 4.482 | 1,36 |  |

|                                                            |       |       |      |  |
|------------------------------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>KAIMANINSELN</b>                                        |       |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                    |       |       |      |  |
| AS Mileage Plan IP Ltd.                                    |       |       |      |  |
| 5,021 % fällig am 20.10.2029                               | 300   | 297   | 0,09 |  |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                               |       |       |      |  |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027                               | 327   | 311   | 0,09 |  |
| Gaci First Investment Co.                                  |       |       |      |  |
| 5,125 % fällig am 14.02.2053                               | 800   | 686   | 0,21 |  |
| 5,250 % fällig am 29.01.2030                               | 600   | 613   | 0,18 |  |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                  |       |       |      |  |
| 11,250 % fällig am 16.04.2025 ^                            | 500   | 23    | 0,01 |  |
| 11,650 % fällig am 01.06.2026 ^                            | 400   | 18    | 0,01 |  |
| Lima Metro Line Finance Ltd.                               |       |       |      |  |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034                               | 358   | 363   | 0,11 |  |
| Seagate HDD Cayman                                         |       |       |      |  |
| 9,625 % fällig am 01.12.2032                               | 460   | 519   | 0,16 |  |
| Spirit Loyalty Cayman Ltd. (11,000 % bar oder 4,000 % PIK) |       |       |      |  |
| 11,000 % fällig am 12.03.2030 (b)                          | 189   | 129   | 0,04 |  |
| Trafford Centre Finance Ltd.                               |       |       |      |  |
| 5,126 % fällig am 28.07.2038                               | £ 300 | 382   | 0,11 |  |
| Summe Kaimaninseln                                         |       | 3.341 | 1,01 |  |

|                                         |        |     |      |  |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|--|
| <b>CHILE</b>                            |        |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |  |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. |        |     |      |  |
| 5,500 % fällig am 10.09.2034            | \$ 300 | 292 | 0,09 |  |

|                                     |        |       |      |  |
|-------------------------------------|--------|-------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>             |        |       |      |  |
| Chile Government International Bond |        |       |      |  |
| 3,750 % fällig am 14.01.2032        | € 500  | 599   | 0,18 |  |
| 3,875 % fällig am 09.07.2031        | 400    | 483   | 0,14 |  |
| 4,850 % fällig am 22.01.2029        | \$ 675 | 686   | 0,21 |  |
|                                     |        | 1.768 | 0,53 |  |
| Summe Chile                         |        | 2.060 | 0,62 |  |

|                                         |                |                          |                          |       |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
| <b>CHINA</b>                            |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                          |       |
| Yango Justice International Ltd.        |                |                          |                          |       |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^          | \$ 2.600       | \$ 4                     | 0,00                     |       |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^          | 1.900          | 10                       | 0,01                     |       |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^          | 1.900          | 10                       | 0,00                     |       |
| Summe China                             |                | 24                       | 0,01                     |       |

|                                         |     |     |      |  |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|--|
| <b>KOLUMBIEN</b>                        |     |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |  |
| Ecopetrol S.A.                          |     |     |      |  |
| 8,875 % fällig am 13.01.2033            | 500 | 516 | 0,16 |  |

|                                        |       |       |      |  |
|----------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |       |       |      |  |
| Colombia Government International Bond |       |       |      |  |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045           | 1.650 | 1.117 | 0,34 |  |
| 8,000 % fällig am 14.11.2035           | 400   | 403   | 0,12 |  |
| 8,500 % fällig am 25.04.2035           | 300   | 312   | 0,09 |  |
|                                        |       | 1.832 | 0,55 |  |
| Summe Kolumbien                        |       | 2.348 | 0,71 |  |

|                                          |     |     |      |  |
|------------------------------------------|-----|-----|------|--|
| <b>COSTA RICA</b>                        |     |     |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                  |     |     |      |  |
| Costa Rica Government International Bond |     |     |      |  |
| 7,300 % fällig am 13.11.2054             | 300 | 311 | 0,09 |  |

|                                         |       |     |      |  |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|--|
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>            |       |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |  |
| EPH Financing International A/S         |       |     |      |  |
| 4,625 % fällig am 02.07.2032 (a)        | € 300 | 355 | 0,11 |  |
| 5,875 % fällig am 30.11.2029            | 300   | 376 | 0,11 |  |
| Summe Tschechische Republik             |       | 731 | 0,22 |  |

|                                         |     |     |      |  |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|--|
| <b>DÄNEMARK</b>                         |     |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |  |
| TDC Net A/S                             |     |     |      |  |
| 5,056 % fällig am 31.05.2028            | 800 | 980 | 0,30 |  |

|                                                  |          |       |      |  |
|--------------------------------------------------|----------|-------|------|--|
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                   |          |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |          |       |      |  |
| Dominican Republic Government International Bond |          |       |      |  |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048                     | \$ 1.175 | 1.115 | 0,34 |  |

|                                       |       |       |      |  |
|---------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>ECUADOR</b>                        |       |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |       |       |      |  |
| Ecuador Government International Bond |       |       |      |  |
| 0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)      | 1.416 | 1.032 | 0,31 |  |
| 6,900 % fällig am 31.07.2030          | 812   | 707   | 0,22 |  |
| Summe Ecuador                         |       | 1.739 | 0,53 |  |

|                                     |            |       |      |  |
|-------------------------------------|------------|-------|------|--|
| <b>ÄGYPTEN</b>                      |            |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>             |            |       |      |  |
| Egypt Government International Bond |            |       |      |  |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031        | € 850      | 928   | 0,28 |  |
| 7,500 % fällig am 16.02.2061        | \$ 1.450   | 1.058 | 0,32 |  |
| 8,625 % fällig am 04.02.2030        | 400        | 405   | 0,12 |  |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028       | EGP 41.100 | 818   | 0,25 |  |
| Summe Ägypten                       |            | 3.209 | 0,97 |  |

|                                           |        |     |      |  |
|-------------------------------------------|--------|-----|------|--|
| <b>EL SALVADOR</b>                        |        |     |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |        |     |      |  |
| El Salvador Government International Bond |        |     |      |  |
| 7,650 % fällig am 15.06.2035              | \$ 125 | 121 | 0,04 |  |
| 9,250 % fällig am 17.04.2030              | 175    | 186 | 0,06 |  |
| 9,650 % fällig am 21.11.2054              | 200    | 206 | 0,06 |  |
| Summe El Salvador                         |        | 513 | 0,16 |  |

|                                         |       |     |      |  |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|--|
| <b>FINNLAND</b>                         |       |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |  |
| Balder Finland Oyj                      |       |     |      |  |
| 1,375 % fällig am 24.05.2030            | € 200 | 211 | 0,06 |  |

| BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>FRANKREICH</b>                                   |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                          |       |
| Altice France S.A.                                  |                |                          |                          |       |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029                        | € 375          | \$ 370                   | 0,11                     |       |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029                        | 600            | 593                      | 0,18                     |       |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028                        | \$ 400         | 337                      | 0,10                     |       |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027                        | 200            | 180                      | 0,05                     |       |
| Altrad Investment Authority S.A.S.                  |                |                          |                          |       |
| 4,429 % fällig am 23.06.2032                        | € 300          | 353                      | 0,11                     |       |
| BNP Paribas S.A.                                    |                |                          |                          |       |
| 1,904 % fällig am 30.09.2028                        | \$ 475         | 448                      | 0,13                     |       |
| 5,786 % fällig am 13.01.2033                        | 300            | 312                      | 0,09                     |       |
| BPCE S.A.                                           |                |                          |                          |       |
| 5,936 % fällig am 30.05.2035                        | 600            | 615                      | 0,19                     |       |
| CMA CGM S.A.                                        |                |                          |                          |       |
| 5,000 % fällig am 15.01.2031                        | € 400          | 470                      | 0,14                     |       |
| Electricite de France S.A.                          |                |                          |                          |       |
| 4,000 % fällig am 07.05.2037                        | 200            | 234                      | 0,07                     |       |
| 6,000 % fällig am 22.04.2064                        | \$ 100         | 95                       | 0,03                     |       |
| 9,125 % fällig am 15.03.2033 (g)                    | 900            | 1.017                    | 0,31                     |       |
| ELO SACA                                            |                |                          |                          |       |
| 4,875 % fällig am 08.12.2028                        | € 300          | 320                      | 0,10                     |       |
| Eramet S.A.                                         |                |                          |                          |       |
| 6,500 % fällig am 30.11.2029 (k)                    | 400            | 469                      | 0,14                     |       |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU         |                |                          |                          |       |
| 3,375 % fällig am 21.04.2029                        | 600            | 714                      | 0,22                     |       |
| Opal Bidco S.A.S.                                   |                |                          |                          |       |
| 5,500 % fällig am 31.03.2032                        | 300            | 360                      | 0,11                     |       |
| Renault S.A.                                        |                |                          |                          |       |
| 2,375 % fällig am 25.05.2026                        | 300            | 351                      | 0,11                     |       |
| TDF Infrastructure SASU                             |                |                          |                          |       |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029                        | 500            | 551                      | 0,17                     |       |
| Ubisoft Entertainment S.A.                          |                |                          |                          |       |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027                        | 400            | 424                      | 0,13                     |       |
| Viridien                                            |                |                          |                          |       |
| 8,500 % fällig am 15.10.2030                        | 600            | 701                      | 0,21                     |       |
| Summe Frankreich                                    |                | 8.914                    | 2,70                     |       |
| <b>GABUN</b>                                        |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                          |       |
| Gabon Government International Bond                 |                |                          |                          |       |
| 9,500 % fällig am 18.02.2029                        | \$ 425         | 389                      | 0,12                     |       |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                  |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                          |       |
| Cerdia Finanz GmbH                                  |                |                          |                          |       |
| 9,375 % fällig am 03.10.2031                        | 300            | 312                      | 0,09                     |       |
| Cheplapharm Arzneimittel GmbH                       |                |                          |                          |       |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028                        | 200            | 193                      | 0,06                     |       |
| Deutsche Bank AG                                    |                |                          |                          |       |
| 5,882 % fällig am 08.07.2031                        | 500            | 513                      | 0,16                     |       |
| IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % bar oder 7,500 % PIK) |                |                          |                          |       |
| 6,750 % fällig am 15.11.2029 (b) €                  | 300            | 369                      | 0,11                     |       |
| Volkswagen Financial Services AG                    |                |                          |                          |       |
| 3,625 % fällig am 19.05.2029                        | 500            | 595                      | 0,18                     |       |
| ZF Finance GmbH                                     |                |                          |                          |       |
| 2,750 % fällig am 25.05.2027                        | 1.200          | 1.352                    | 0,41                     |       |
|                                                     |                | 3.334                    | 1,01                     |       |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>           |                |                          |                          |       |
| SCUR-Alpha 1503 GmbH                                |                |                          |                          |       |
| 9,780 % fällig am 29.03.2030                        | \$ 489         | 463                      | 0,14                     |       |
| TK Elevator Midco GmbH                              |                |                          |                          |       |
| 7,237 % fällig am 30.04.2030                        | 300            | 301                      | 0,09                     |       |
|                                                     |                | 764                      | 0,23                     |       |
| Summe Deutschland                                   |                | 4.098                    | 1,24                     |       |
| <b>GHANA</b>                                        |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                          |       |
| Ghana Government International Bond                 |                |                          |                          |       |
| 0,000 % fällig am 03.07.2026 (d)                    | 31             | 30                       | 0,01                     |       |
| 0,000 % fällig am 03.01.2030 (d)                    | 70             | 59                       | 0,02                     |       |
| 5,000 % fällig am 03.07.2029                        | 615            | 578                      | 0,17                     |       |
| 5,000 % fällig am 03.07.2035                        | 452            | 353                      | 0,11                     |       |
| Summe Ghana                                         |                | 1.020                    | 0,31                     |       |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>GUATEMALA</b>                           |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                          |       |
| Guatemala Government International Bond    |                |                          |                          |       |
| 7,050 % fällig am 04.10.2032               | \$ 800         | \$ 852                   | 0,26                     |       |
| <b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>               |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                          |       |
| Sirius Real Estate Ltd.                    |                |                          |                          |       |
| 4,000 % fällig am 22.01.2032               | € 400          | 466                      | 0,14                     |       |
| <b>HONGKONG</b>                            |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                          |       |
| Fortune Star BVI Ltd.                      |                |                          |                          |       |
| 3,950 % fällig am 02.10.2026               | 600            | 683                      | 0,21                     |       |
| <b>UNGARN</b>                              |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                          |       |
| Hungary Government International Bond      |                |                          |                          |       |
| 4,000 % fällig am 25.07.2029               | 475            | 573                      | 0,17                     |       |
| 4,875 % fällig am 22.03.2040               | 300            | 345                      | 0,11                     |       |
| 5,375 % fällig am 26.09.2030               | \$ 600         | 606                      | 0,18                     |       |
| 5,375 % fällig am 12.09.2033               | € 350          | 443                      | 0,14                     |       |
| Magyar Export-Import Bank                  |                |                          |                          |       |
| 6,000 % fällig am 16.05.2029               | 500            | 634                      | 0,19                     |       |
| Summe Ungarn                               |                | 2.601                    | 0,79                     |       |
| <b>INDONESIEN</b>                          |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                          |       |
| Pertamina Persero PT                       |                |                          |                          |       |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048               | \$ 1.250       | 1.284                    | 0,39                     |       |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan |                |                          |                          |       |
| Listrik Negara                             |                |                          |                          |       |
| 1,875 % fällig am 05.11.2031               | € 325          | 333                      | 0,10                     |       |
| 6,150 % fällig am 21.05.2048               | \$ 1.000       | 975                      | 0,30                     |       |
| Summe Indonesien                           |                | 2.592                    | 0,79                     |       |
| <b>INTERNATIONAL</b>                       |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                          |       |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC       |                |                          |                          |       |
| 9,750 % fällig am 10.10.2025               | £ 22           | 28                       | 0,01                     |       |
| <b>IRLAND</b>                              |                |                          |                          |       |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>    |                |                          |                          |       |
| Anchorage Capital Europe CLO DAC           |                |                          |                          |       |
| 3,499 % fällig am 15.10.2038               | € 700          | 821                      | 0,25                     |       |
| Aurium CLO DAC                             |                |                          |                          |       |
| 2,944 % fällig am 22.06.2034               | 2.000          | 2.342                    | 0,71                     |       |
| 2,982 % fällig am 16.01.2031               | 287            | 337                      | 0,10                     |       |
| Bain Capital Euro CLO DAC                  |                |                          |                          |       |
| 2,976 % fällig am 20.01.2032               | 1.106          | 1.296                    | 0,39                     |       |
| Barings Euro CLO DAC                       |                |                          |                          |       |
| 3,138 % fällig am 25.07.2035               | 1.000          | 1.171                    | 0,35                     |       |
| Blackrock European CLO DAC                 |                |                          |                          |       |
| 3,243 % fällig am 17.07.2034               | 900            | 1.054                    | 0,32                     |       |
| Cumulus Static CLO DAC                     |                |                          |                          |       |
| 3,343 % fällig am 15.11.2033               | 1.755          | 2.065                    | 0,63                     |       |
| Harvest CLO DAC                            |                |                          |                          |       |
| 3,129 % fällig am 15.01.2032               | 2.349          | 2.756                    | 0,84                     |       |
| Rockford Tower Europe CLO DAC              |                |                          |                          |       |
| 3,561 % fällig am 24.04.2037               | 2.000          | 2.349                    | 0,71                     |       |
| SCF Rahoituspalvelut DAC                   |                |                          |                          |       |
| 2,479 % fällig am 25.06.2034               | 243            | 285                      | 0,09                     |       |
| Sculptor European CLO DAC                  |                |                          |                          |       |
| 3,055 % fällig am 14.01.2032               | 645            | 756                      | 0,23                     |       |
| Toro European CLO DAC                      |                |                          |                          |       |
| 2,953 % fällig am 15.02.2034               | 740            | 866                      | 0,26                     |       |
| 3,185 % fällig am 12.01.2032               | 285            | 335                      | 0,10                     |       |
| Voya Euro CLO DAC                          |                |                          |                          |       |
| 3,249 % fällig am 15.10.2034               | 500            | 586                      | 0,18                     |       |
|                                            |                | 17.019                   | 5,16                     |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                          |       |
| CIMA Finance DAC                           |                |                          |                          |       |
| 2,950 % fällig am 05.09.2029               | \$ 213         | 196                      | 0,06                     |       |

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>IRIDIUM CAPITAL PLC</b>                |                |                          |                          |       |
| 9,250 % fällig am 18.06.2029              | € 900          | \$ 1.146                 | 0,35                     |       |
|                                           |                | 1.342                    | 0,41                     |       |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                          |       |
| Republic of Panama                        |                |                          |                          |       |
| 4,804 % fällig am 01.04.2027              | 1.500          | 1.769                    | 0,54                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                          |       |
| Avenir Issuer Ireland DAC                 |                |                          |                          |       |
| 6,000 % fällig am 25.10.2027              | \$ 509         | 478                      | 0,14                     |       |
| Summe Irland                              |                | 20.608                   | 6,25                     |       |
| <b>INSEL MAN</b>                          |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                          |       |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC            |                |                          |                          |       |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030              | 200            | 187                      | 0,06                     |       |
| <b>ISRAEL</b>                             |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                          |       |
| Israel Government International Bond      |                |                          |                          |       |
| 5,000 % fällig am 30.10.2026              | € 400          | 483                      | 0,15                     |       |
| 5,375 % fällig am 12.03.2029              | \$ 400         | 408                      | 0,12                     |       |
| 5,625 % fällig am 19.02.2035              | 250            | 255                      | 0,08                     |       |
| Summe Israel                              |                | 1.146                    | 0,35                     |       |
| <b>ITALIEN</b>                            |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                          |       |
| Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC          |                |                          |                          |       |
| 7,500 % fällig am 15.02.2032              | 300            | 304                      | 0,09                     |       |
| Eni SpA                                   |                |                          |                          |       |
| 5,950 % fällig am 15.05.2054              | 400            | 387                      | 0,12                     |       |
| Intesa Sanpaolo SpA                       |                |                          |                          |       |
| 5,500 % fällig am 01.03.2028 (g)(i)       | € 750          | 901                      | 0,28                     |       |
| Mundys SpA                                |                |                          |                          |       |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028              | 1.400          | 1.590                    | 0,48                     |       |
| Nexi SpA                                  |                |                          |                          |       |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029              | 825            | 923                      | 0,28                     |       |
| TeamSystem SpA                            |                |                          |                          |       |
| 5,000 % fällig am 01.07.2031 (a)          | 400            | 470                      | 0,14                     |       |
| Telecom Italia SpA                        |                |                          |                          |       |
| 7,875 % fällig am 31.07.2028              | 275            | 363                      | 0,11                     |       |
| UniCredit SpA                             |                |                          |                          |       |
| 7,296 % fällig am 02.04.2034              | \$ 625         | 661                      | 0,20                     |       |
| Summe Italien                             |                | 5.599                    | 1,70                     |       |
| <b>ELFENBEINKÜSTE</b>                     |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                          |       |
| Ivory Coast Government International Bond |                |                          |                          |       |
| 5,750 % fällig am 31.12.2032              | 1.073          | 1.025                    | 0,31                     |       |
| 7,625 % fällig am 30.01.2033              | 450            | 445                      | 0,14                     |       |
| Summe Elfenbeinküste                      |                | 1.470                    | 0,45                     |       |
| <b>JAPAN</b>                              |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                          |       |
| Nissan Motor Co. Ltd.                     |                |                          |                          |       |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027              | 400            | 384                      | 0,11                     |       |
| SoftBank Group Corp.                      |                |                          |                          |       |
| 5,375 % fällig am 08.01.2029              | € 300          | 359                      | 0,11                     |       |
| Summe Japan                               |                | 743                      | 0,22                     |       |
| <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                          |       |
| AA Bond Co. Ltd.                          |                |                          |                          |       |
| 5,500 % fällig am 31.07.2050              | £ 575          | 792                      | 0,24                     |       |
| <b>KASACHSTAN</b>                         |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                          |       |
| KazMunayGas National Co. JSC              |                |                          |                          |       |
| 5,375 % fällig am 24.04.2030              | \$ 200         | 202                      | 0,06                     |       |
| 6,375 % fällig am 24.10.2048              | 400            | 370                      | 0,11                     |       |
| Summe Kasachstan                          |                | 572                      | 0,17                     |       |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|
| <b>KENIA</b>                                    |                |                          |                          |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                         |                |                          |                          |
| Republic of Kenya Government International Bond |                |                          |                          |
| 9,500 % fällig am 05.03.2036                    | \$ 200         | \$ 189                   | 0,06                     |
| 9,750 % fällig am 16.02.2031                    | 500            | 508                      | 0,15                     |
| Summe Kenia                                     |                | 697                      | 0,21                     |

|                                       |     |     |      |
|---------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>LIBANON</b>                        |     |     |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |     |     |      |
| Lebanon Government International Bond |     |     |      |
| 6,000 % fällig am 27.01.2023 ^        | 425 | 80  | 0,03 |
| 6,100 % fällig am 04.10.2022 ^        | 350 | 66  | 0,02 |
| 6,850 % fällig am 23.03.2027 ^        | 425 | 80  | 0,02 |
| Summe Libanon                         |     | 226 | 0,07 |

|                                         |     |     |      |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>LIBERIA</b>                          |     |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.            |     |     |      |
| 5,500 % fällig am 01.04.2028            | 400 | 405 | 0,12 |
| 5,625 % fällig am 30.09.2031            | 400 | 403 | 0,12 |
| Summe Liberia                           |     | 808 | 0,24 |

|                                       |         |       |      |
|---------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>AKTIEN</b>                         |         |       |      |
| <b>LUXEMBURG</b>                      |         |       |      |
| <b>STAMMAKTIONEN</b>                  |         |       |      |
| Adler Group S.A. (c)                  | 212.207 | 0     | 0,00 |
| Corestate Capital Holding S.A. (c)(j) | 210.984 | 0     | 0,00 |
| DrillCo Holding Lux S.A. (j)          | 61.666  | 1.264 | 0,39 |
| Foresea Holding S.A. 'A'              | 130     | 2     | 0,00 |
| Intelsat Emergence S.A. (j)           | 14.429  | 498   | 0,15 |
|                                       |         | 1.764 | 0,54 |

|                                                                 |         |       |      |
|-----------------------------------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                         |         |       |      |
| Banco Votorantim S.A.                                           |         |       |      |
| 5,875 % fällig am 08.04.2028                                    | \$ 275  | 279   | 0,08 |
| Chile Electricity Lux MPC SARL                                  |         |       |      |
| 5,580 % fällig am 20.10.2035                                    | 293     | 294   | 0,09 |
| 6,010 % fällig am 20.01.2033                                    | 465     | 482   | 0,14 |
| ContourGlobal Power Holdings S.A.                               |         |       |      |
| 6,750 % fällig am 28.02.2030                                    | 450     | 464   | 0,14 |
| Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % bar oder 11,000 % PIK) |         |       |      |
| 10,000 % fällig am 31.12.2026 (b)                               | € 116   | 123   | 0,04 |
| FORESEA Holding S.A.                                            |         |       |      |
| 7,500 % fällig am 15.06.2030                                    | \$ 638  | 606   | 0,18 |
| Greensaif Pipelines Bidco SARL                                  |         |       |      |
| 6,103 % fällig am 23.08.2042                                    | 400     | 401   | 0,12 |
| 6,129 % fällig am 23.02.2038                                    | 275     | 284   | 0,09 |
| Intelsat Jackson Holdings S.A.                                  |         |       |      |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030                                    | 472     | 483   | 0,15 |
| Raizen Fuels Finance S.A.                                       |         |       |      |
| 6,250 % fällig am 08.07.2032 (a)                                | 500     | 497   | 0,15 |
| Tierra Mojada Luxembourg SARL                                   |         |       |      |
| 5,750 % fällig am 01.12.2040                                    | 423     | 400   | 0,12 |
| Titanium Bondco SARL (6,250 % PIK)                              |         |       |      |
| 6,250 % fällig am 14.01.2031 (b)                                | € 1.201 | 416   | 0,13 |
|                                                                 |         | 4.729 | 1,43 |

|                                           |       |       |      |
|-------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |       |       |      |
| Albion Financing SARL                     |       |       |      |
| 5,236 % fällig am 16.08.2029              | 1.000 | 1.173 | 0,36 |
| Summe Luxemburg                           |       | 7.666 | 2,33 |

|                                                   |        |       |      |
|---------------------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>MEXIKO</b>                                     |        |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |        |       |      |
| Banco Actinver S.A. Institucion de Banca Multiple |        |       |      |
| 7,250 % fällig am 31.01.2041                      | \$ 298 | 303   | 0,09 |
| Petroleos Mexicanos                               |        |       |      |
| 5,625 % fällig am 23.01.2046                      | 1.416  | 940   | 0,29 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047                      | 2.025  | 1.468 | 0,45 |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050                      | 934    | 735   | 0,22 |
|                                                   |        | 3.446 | 1,05 |

|                                      |            |        |      |
|--------------------------------------|------------|--------|------|
| <b>MEXIKO</b>                        |            |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |            |        |      |
| Mexico Government International Bond |            |        |      |
| 3,771 % fällig am 24.05.2061         | \$ 1.600   | \$ 949 | 0,29 |
| 4,000 % fällig am 24.08.2034 (f)     | MXN 17.682 | 871    | 0,26 |
| 4,490 % fällig am 25.05.2032         | € 400      | 476    | 0,14 |
| 4,500 % fällig am 31.01.2050         | \$ 350     | 255    | 0,08 |
| 5,850 % fällig am 02.07.2032 (a)     | 1.851      | 1.876  | 0,57 |
| 6,000 % fällig am 07.05.2036         | 1.300      | 1.286  | 0,39 |
| 6,875 % fällig am 13.05.2037         | 400        | 418    | 0,13 |
|                                      |            | 6.131  | 1,86 |
| Summe Mexiko                         |            | 9.577  | 2,91 |

|                                         |     |     |      |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>MAROKKO</b>                          |     |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |
| OCP S.A.                                |     |     |      |
| 6,700 % fällig am 01.03.2036            | 275 | 277 | 0,08 |

|                                         |     |     |      |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>MULTINATIONAL</b>                    |     |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |
| JetBlue Airways Corp.                   |     |     |      |
| 9,875 % fällig am 20.09.2031            | 625 | 608 | 0,19 |
| Toucan FinCo Ltd.                       |     |     |      |
| 9,500 % fällig am 15.05.2030            | 300 | 307 | 0,09 |
| Summe multinational                     |     | 915 | 0,28 |

|                                         |        |       |      |
|-----------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>NIEDERLANDE</b>                      |        |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |       |      |
| ASR Nederland NV                        |        |       |      |
| 7,000 % fällig am 07.12.2043            | € 100  | 137   | 0,04 |
| Digital Dutch Finco BV                  |        |       |      |
| 3,875 % fällig am 15.07.2034            | 500    | 580   | 0,18 |
| Flora Food Management BV                |        |       |      |
| 6,875 % fällig am 02.07.2029            | 300    | 358   | 0,11 |
| IPD BV                                  |        |       |      |
| 5,350 % fällig am 15.06.2031            | 450    | 529   | 0,16 |
| Sandoz Finance BV                       |        |       |      |
| 4,220 % fällig am 17.04.2030            | 400    | 495   | 0,15 |
| Universal Music Group NV                |        |       |      |
| 3,750 % fällig am 30.06.2032            | 300    | 361   | 0,11 |
| Ureco Finance NV                        |        |       |      |
| 3,625 % fällig am 18.06.2035            | 300    | 350   | 0,11 |
| Wintershall Dea Finance BV              |        |       |      |
| 4,357 % fällig am 03.10.2032            | 400    | 471   | 0,14 |
| Yinson Bergenia Production BV           |        |       |      |
| 8,498 % fällig am 31.01.2045 (a)        | \$ 400 | 405   | 0,12 |
| Yinson Boronia Production BV            |        |       |      |
| 8,947 % fällig am 31.07.2042            | 496    | 528   | 0,16 |
| ZF Europe Finance BV                    |        |       |      |
| 2,000 % fällig am 23.02.2026            | € 100  | 116   | 0,03 |
|                                         |        | 4.330 | 1,31 |

|                                           |        |     |      |
|-------------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |        |     |      |
| Veon Amsterdam                            |        |     |      |
| 8,531 % - 10,750 % fällig am 25.03.2027   | \$ 250 | 250 | 0,08 |

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>        |       |       |      |
| Domi BV                      |       |       |      |
| 2,655 % fällig am 15.06.2056 | € 424 | 497   | 0,15 |
| Summe Niederlande            |       | 5.077 | 1,54 |

|                                       |          |       |      |
|---------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>NIGERIA</b>                        |          |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |          |       |      |
| Nigeria Government International Bond |          |       |      |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032          | \$ 1.150 | 1.093 | 0,33 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>NORWEGEN</b>                         |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| Var Energi ASA                          |       |     |      |
| 3,875 % fällig am 12.03.2031            | € 450 | 531 | 0,16 |

|                                        |        |        |      |
|----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>OMAN</b>                            |        |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |        |        |      |
| Oman Government International Bond     |        |        |      |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048           | \$ 700 | \$ 724 | 0,22 |
| <b>PAKISTAN</b>                        |        |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |        |        |      |
| Pakistan Government International Bond |        |        |      |
| 6,000 % fällig am 08.04.2026           | 400    | 395    | 0,12 |
| 7,375 % fällig am 08.04.2031           | 200    | 178    | 0,05 |
| Summe Pakistan                         |        | 573    | 0,17 |

|                                         |     |     |      |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>PANAMA</b>                           |     |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |
| Carnival Corp.                          |     |     |      |
| 5,875 % fällig am 15.06.2031            | 450 | 459 | 0,14 |

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |       |       |      |
| Panama Government International Bond |       |       |      |
| 2,252 % fällig am 29.09.2032         | 200   | 153   | 0,05 |
| 6,400 % fällig am 14.02.2035         | 600   | 586   | 0,18 |
| 6,853 % fällig am 28.03.2054         | 1.050 | 964   | 0,29 |
|                                      |       | 1.703 | 0,52 |
| Summe Panama                         |       | 2.162 | 0,66 |

|                                              |           |       |      |
|----------------------------------------------|-----------|-------|------|
| <b>PERU</b>                                  |           |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |           |       |      |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |           |       |      |
| 10,100 % fällig am 15.12.2043                | PEN 3.900 | 1.168 | 0,35 |

|                                    |           |       |      |
|------------------------------------|-----------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |           |       |      |
| Peru Government International Bond |           |       |      |
| 5,500 % fällig am 30.03.2036       | \$ 1.000  | 1.002 | 0,30 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032       | PEN 2.600 | 758   | 0,23 |
| 8,750 % fällig am 21.11.2033       | \$ 475    | 581   | 0,18 |
|                                    |           | 2.341 | 0,71 |
| Summe Peru                         |           | 3.509 | 1,06 |

|                                         |     |     |      |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>POLEN</b>                            |     |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |
| ORLEN S.A.                              |     |     |      |
| 6,000 % fällig am 30.01.2035            | 200 | 205 | 0,06 |

|                                      |        |       |      |
|--------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |        |       |      |
| Bank Gospodarstwa Krajowego          |        |       |      |
| 4,000 % fällig am 13.03.2032         | € 600  | 726   | 0,22 |
| 5,750 % fällig am 09.07.2034         | \$ 400 | 412   | 0,13 |
| Poland Government International Bond |        |       |      |
| 4,875 % fällig am 12.02.2030         | 300    | 306   | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 18.03.2054         | 275    | 256   | 0,08 |
|                                      |        | 1.700 | 0,52 |
| Summe Polen                          |        | 1.905 | 0,58 |

|                                       |       |       |      |
|---------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>RUMÄNIEN</b>                       |       |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |       |       |      |
| Romania Government International Bond |       |       |      |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033          | € 400 | 361   | 0,11 |
| 5,000 % fällig am 27.09.2026          | 600   | 724   | 0,22 |
| 5,250 % fällig am 30.05.2032          | 100   | 116   | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 22.03.2031          | 600   | 707   | 0,21 |
| 6,375 % fällig am 18.09.2033          | 300   | 363   | 0,11 |
| Summe Rumänien                        |       | 2.271 | 0,69 |

|                                            |          |       |      |
|--------------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>SAUDI-ARABIEN</b>                       |          |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |          |       |      |
| Saudi Arabia Government International Bond |          |       |      |
| 3,375 % fällig am 05.03.2032               | 800      | 936   | 0,29 |
| 3,450 % fällig am 02.02.2061               | \$ 1.400 | 870   | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 26.10.2046               | 625      | 516   | 0,16 |
| 4,875 % fällig am 18.07.2033               | 725      | 728   | 0,22 |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031               | 1.400    | 1.453 | 0,44 |
| Summe Saudi-Arabien                        |          | 4.503 | 1,37 |

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| <b>SENEGAL</b>                                |                |                                 |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                                 |                                   |
| Senegal Government International Bond         |                |                                 |                                   |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028                  | € 200          | \$ 186                          | 0,05                              |
| 5,375 % fällig am 08.06.2037                  | 400            | 292                             | 0,09                              |
| 7,750 % fällig am 10.06.2031                  | \$ 400         | 294                             | 0,09                              |
| Summe Senegal                                 |                | 772                             | 0,23                              |
| <b>SERBIEN</b>                                |                |                                 |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                                 |                                   |
| Serbia Government International Bond          |                |                                 |                                   |
| 6,500 % fällig am 26.09.2033 (k)              | 1.000          | 1.054                           | 0,32                              |
| <b>SINGAPUR</b>                               |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                                 |                                   |
| Yinson Production Financial Services Pte Ltd. |                |                                 |                                   |
| 9,625 % fällig am 03.05.2029                  | 300            | 312                             | 0,09                              |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                              |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                                 |                                   |
| Sasol Financing USA LLC                       |                |                                 |                                   |
| 6,500 % fällig am 27.09.2028                  | 600            | 571                             | 0,17                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>     |                |                                 |                                   |
| Transnet SOC Ltd.                             |                |                                 |                                   |
| 11,558 % fällig am 02.03.2028                 | ZAR 16.286     | 909                             | 0,28                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                                 |                                   |
| South Africa Government International Bond    |                |                                 |                                   |
| 5,650 % fällig am 27.09.2047                  | \$ 550         | 412                             | 0,13                              |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030                  | ZAR 4.200      | 232                             | 0,07                              |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035                  | 26.500         | 1.393                           | 0,42                              |
|                                               |                | 2.037                           | 0,62                              |
| Summe Südafrika                               |                | 3.517                           | 1,07                              |
| <b>SPANIEN</b>                                |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                                 |                                   |
| Amadeus IT Group S.A.                         |                |                                 |                                   |
| 3,375 % fällig am 25.03.2030                  | € 300          | 357                             | 0,11                              |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.          |                |                                 |                                   |
| 6,000 % fällig am 15.01.2026 (g)(i)           | 800            | 952                             | 0,29                              |
| CaixaBank S.A.                                |                |                                 |                                   |
| 6,037 % fällig am 15.06.2035                  | \$ 300         | 314                             | 0,09                              |
| Cellnex Finance Co. S.A.                      |                |                                 |                                   |
| 3,875 % fällig am 07.07.2041                  | 700            | 553                             | 0,17                              |
| Summe Spanien                                 |                | 2.176                           | 0,66                              |
| <b>SRI LANKA</b>                              |                |                                 |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                                 |                                   |
| Sri Lanka Government International Bond       |                |                                 |                                   |
| 3,100 % fällig am 15.01.2030                  | 96             | 86                              | 0,03                              |
| 3,350 % fällig am 15.03.2033                  | 188            | 152                             | 0,04                              |
| 3,600 % fällig am 15.06.2035                  | 127            | 87                              | 0,03                              |
| 3,600 % fällig am 15.05.2036                  | 88             | 72                              | 0,02                              |
| 3,600 % fällig am 15.02.2038                  | 176            | 143                             | 0,04                              |
| 4,000 % fällig am 15.04.2028                  | 92             | 87                              | 0,03                              |
| Summe Sri Lanka                               |                | 627                             | 0,19                              |
| <b>SUPRANATIONAL</b>                          |                |                                 |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                                 |                                   |
| Europäische Union                             |                |                                 |                                   |
| 3,000 % fällig am 04.12.2034                  | € 2.100        | 2.470                           | 0,75                              |
| 3,375 % fällig am 04.10.2039                  | 900            | 1.046                           | 0,32                              |
| Summe Supranational                           |                | 3.516                           | 1,07                              |
| <b>SCHWEIZ</b>                                |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                                 |                                   |
| UBS Group AG                                  |                |                                 |                                   |
| 2,125 % fällig am 15.11.2029                  | £ 300          | 380                             | 0,12                              |
| 5,617 % fällig am 13.09.2030                  | \$ 800         | 831                             | 0,25                              |
| Summe Schweiz                                 |                | 1.211                           | 0,37                              |

| BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| <b>TÜRKEI</b>                            |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                                 |                                   |
| Türkiye Varlik Fonu Yonetimi A/S         |                |                                 |                                   |
| 8,250 % fällig am 14.02.2029             | \$ 300         | \$ 314                          | 0,09                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                  |                |                                 |                                   |
| Turkey Government International Bond     |                |                                 |                                   |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043             | 1.200          | 848                             | 0,26                              |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047             | 1.550          | 1.165                           | 0,35                              |
| 47,469 % fällig am 06.09.2028            | TRY 12.000     | 290                             | 0,09                              |
|                                          |                | 2.303                           | 0,70                              |
| Summe Türkei                             |                | 2.617                           | 0,79                              |
| <b>UKRAINE</b>                           |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                                 |                                   |
| NPC Ukregenergo                          |                |                                 |                                   |
| 6,875 % fällig am 09.11.2028             | \$ 200         | 163                             | 0,05                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                  |                |                                 |                                   |
| Ukraine Government International Bond    |                |                                 |                                   |
| 0,000 % fällig am 01.02.2030             | 98             | 47                              | 0,01                              |
| 0,000 % fällig am 01.02.2034             | 366            | 142                             | 0,04                              |
| 0,000 % fällig am 01.02.2035             | 125            | 59                              | 0,02                              |
| 1,750 % fällig am 01.02.2029             | 60             | 37                              | 0,01                              |
| 1,750 % fällig am 01.02.2034             | 484            | 252                             | 0,08                              |
| 1,750 % fällig am 01.02.2035             | 618            | 317                             | 0,10                              |
| 1,750 % fällig am 01.02.2036             | 632            | 316                             | 0,09                              |
|                                          |                | 1.170                           | 0,35                              |
| Summe Ukraine                            |                | 1.333                           | 0,40                              |
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>      |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                                 |                                   |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC |                |                                 |                                   |
| 4,375 % fällig am 02.10.2031             | 400            | 395                             | 0,12                              |
| 5,500 % fällig am 08.05.2034             | 600            | 624                             | 0,19                              |
| DAE Sukuk Dfc Ltd.                       |                |                                 |                                   |
| 3,750 % fällig am 15.02.2026             | 900            | 894                             | 0,27                              |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate       |                | 1.913                           | 0,58                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                   |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                                 |                                   |
| Amber Finco PLC                          |                |                                 |                                   |
| 6,625 % fällig am 15.07.2029             | € 200          | 246                             | 0,08                              |
| Barclays PLC                             |                |                                 |                                   |
| 5,690 % fällig am 12.03.2030             | \$ 475         | 492                             | 0,15                              |
| Belron UK Finance PLC                    |                |                                 |                                   |
| 5,750 % fällig am 15.10.2029             | 100            | 101                             | 0,03                              |
| Boparan Finance PLC                      |                |                                 |                                   |
| 9,375 % fällig am 07.11.2029             | £ 300          | 427                             | 0,13                              |
| British Telecommunications PLC           |                |                                 |                                   |
| 3,750 % fällig am 03.01.2035             | € 350          | 409                             | 0,12                              |
| Greene King Finance PLC                  |                |                                 |                                   |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034             | £ 226          | 308                             | 0,09                              |
| HSBC Holdings PLC                        |                |                                 |                                   |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030             | \$ 350         | 341                             | 0,10                              |
| Imperial Brands Finance PLC              |                |                                 |                                   |
| 3,875 % fällig am 12.02.2034             | € 400          | 462                             | 0,14                              |
| INEOS Finance PLC                        |                |                                 |                                   |
| 5,625 % fällig am 15.08.2030             | 150            | 172                             | 0,05                              |
| Informa PLC                              |                |                                 |                                   |
| 3,375 % fällig am 09.06.2031             | 300            | 350                             | 0,11                              |
| John Lewis PLC                           |                |                                 |                                   |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034             | £ 275          | 307                             | 0,09                              |
| Marex Group PLC                          |                |                                 |                                   |
| 5,829 % fällig am 08.05.2028             | \$ 300         | 304                             | 0,09                              |
| Market Bidco Finco PLC                   |                |                                 |                                   |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027             | € 500          | 585                             | 0,18                              |
| Mitchells & Butlers Finance PLC          |                |                                 |                                   |
| 4,808 % fällig am 15.12.2030             | £ 129          | 175                             | 0,05                              |
| 5,111 % fällig am 15.12.2030             | \$ 515         | 497                             | 0,15                              |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032             | £ 332          | 454                             | 0,14                              |
| NatWest Group PLC                        |                |                                 |                                   |
| 6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i)      | \$ 1.050       | 1.051                           | 0,32                              |

| BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b>                       |                |                                 |                                   |
| 0,000 % fällig am 05.04.2032 (d)                                            | \$ 578         | \$ 411                          | 0,13                              |
| Rolls-Royce PLC                                                             |                |                                 |                                   |
| 4,625 % fällig am 16.02.2026                                                | € 650          | 770                             | 0,23                              |
| Santander UK Group Holdings PLC                                             |                |                                 |                                   |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028                                                | \$ 750         | 735                             | 0,22                              |
| SSE PLC                                                                     |                |                                 |                                   |
| 3,500 % fällig am 18.03.2032                                                | € 375          | 446                             | 0,14                              |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC                                        |                |                                 |                                   |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027                                                | £ 22           | 32                              | 0,01                              |
| Thames Water Utilities Finance PLC                                          |                |                                 |                                   |
| 4,375 % fällig am 18.01.2033                                                | € 500          | 384                             | 0,12                              |
| Thames Water Utilities Ltd.                                                 |                |                                 |                                   |
| 0,000 % fällig am 22.03.2027 (d)                                            | £ 3            | 4                               | 0,00                              |
| Virgin Media Secured Finance PLC                                            |                |                                 |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030                                                | 1.400          | 1.760                           | 0,53                              |
| Vmed O2 UK Financing PLC                                                    |                |                                 |                                   |
| 4,000 % fällig am 31.01.2029                                                | 400            | 511                             | 0,16                              |
|                                                                             |                | 11.734                          | 3,56                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                   |                |                                 |                                   |
| INEOS Quattro Holdings U.K. Ltd.                                            |                |                                 |                                   |
| 8,677 % fällig am 02.04.2029                                                | \$ 298         | 279                             | 0,09                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                       |                |                                 |                                   |
| Curzon Mortgages PLC                                                        |                |                                 |                                   |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                                                | £ 1.862        | 2.560                           | 0,77                              |
| Stratton Mortgage Funding PLC                                               |                |                                 |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.06.2049                                                | 575            | 789                             | 0,24                              |
| Trinity Square PLC                                                          |                |                                 |                                   |
| 5,217 % fällig am 15.07.2059                                                | 403            | 554                             | 0,17                              |
|                                                                             |                | 3.903                           | 1,18                              |
| Summe Großbritannien                                                        |                | 15.916                          | 4,83                              |
| <b>USA</b>                                                                  |                |                                 |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                     |                |                                 |                                   |
| Aames Mortgage Investment Trust                                             |                |                                 |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.10.2035                                                | \$ 48          | 47                              | 0,01                              |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                 |                |                                 |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.02.2036                                                | 20             | 20                              | 0,01                              |
| 5,174 % fällig am 25.02.2037                                                | 2.252          | 927                             | 0,28                              |
| Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                                 |                                   |
| 5,139 % fällig am 25.11.2035                                                | 29             | 28                              | 0,01                              |
| 7,809 % fällig am 25.11.2032                                                | 348            | 366                             | 0,11                              |
| Argent Securities Trust                                                     |                |                                 |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.05.2036                                                | 542            | 131                             | 0,04                              |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                  |                |                                 |                                   |
| 5,439 % fällig am 25.06.2035                                                | 130            | 127                             | 0,04                              |
| 6,234 % fällig am 25.07.2034                                                | 20             | 22                              | 0,01                              |
| Carrington Mortgage Loan Trust                                              |                |                                 |                                   |
| 4,694 % fällig am 25.02.2037                                                | 541            | 523                             | 0,16                              |
| 5,484 % fällig am 25.05.2035                                                | 175            | 170                             | 0,05                              |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                           |                |                                 |                                   |
| 3,387 % fällig am 25.03.2036                                                | 26             | 26                              | 0,01                              |
| 4,794 % fällig am 25.11.2047                                                | 461            | 440                             | 0,13                              |
| 4,914 % fällig am 25.02.2037                                                | 1.600          | 1.525                           | 0,46                              |
| 4,994 % fällig am 25.04.2034                                                | 176            | 166                             | 0,05                              |
| 5,274 % fällig am 25.10.2047                                                | 1.349          | 1.323                           | 0,40                              |
| 5,484 % fällig am 25.11.2034                                                | 2              | 3                               | 0,00                              |
| 5,534 % fällig am 25.05.2047                                                | 674            | 561                             | 0,17                              |
| 6,009 % fällig am 25.11.2034                                                | 89             | 89                              | 0,03                              |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                        |                |                                 |                                   |
| 4,562 % fällig am 25.01.2032                                                | 2              | 2                               | 0,00                              |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                            |                |                                 |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.05.2037                                                | 253            | 249                             | 0,08                              |
| First Franklin Mortgage Loan Trust                                          |                |                                 |                                   |
| 5,709 % fällig am 25.07.2034                                                | 47             | 46                              | 0,01                              |
| Fremont Home Loan Trust                                                     |                |                                 |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.04.2036                                                | 261            | 239                             | 0,07                              |
| 5,364 % fällig am 25.06.2035                                                | 700            | 652                             | 0,20                              |
| GSAA Home Equity Trust                                                      |                |                                 |                                   |
| 4,554 % fällig am 25.11.2036                                                | 72             | 18                              | 0,01                              |
| GSAMP Trust                                                                 |                |                                 |                                   |
| 4,524 % fällig am 25.01.2037                                                | 38             | 23                              | 0,01                              |
| 4,534 % fällig am 25.12.2046                                                | 22             | 11                              | 0,00                              |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,914 % fällig am 25.06.2036                                       | \$ 175         | \$                       | 97 0,03                           | Alliant Holdings Intermediate LLC                | \$ 300         | \$ 306                   | 0,09                              | Charter Communications Operating LLC                   | \$ 1.225       | \$ 785                   | 0,24                              |
| 4,914 % fällig am 25.08.2036                                       | 505            | 411                      | 0,12                              | 6,500 % fällig am 01.10.2031                     | 300            | 311                      | 0,09                              | 3,850 % fällig am 01.04.2061                           |                |                          |                                   |
| 5,169 % fällig am 25.09.2035                                       | 53             | 52                       | 0,02                              | 7,000 % fällig am 15.01.2031                     | 300            | 311                      | 0,09                              | Chord Energy Corp.                                     |                |                          |                                   |
| Home Equity Asset Trust                                            |                |                          |                                   | Ally Financial, Inc.                             |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.03.2033                           | 300            | 307                      | 0,09                              |
| 5,529 % fällig am 25.05.2035                                       | 20             | 20                       | 0,01                              | 5,543 % fällig am 17.01.2031                     | 300            | 304                      | 0,09                              | Citigroup, Inc.                                        |                |                          |                                   |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 01.11.2031                     | 350            | 396                      | 0,12                              | 5,449 % fällig am 11.06.2035                           | 200            | 204                      | 0,06                              |
| 4,219 % fällig am 25.07.2036                                       | 58             | 58                       | 0,02                              | AMC Networks, Inc.                               |                |                          |                                   | Citizens Financial Group, Inc.                         |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                       | 594            | 276                      | 0,08                              | 4,250 % fällig am 15.02.2029                     | 100            | 80                       | 0,02                              | 5,253 % fällig am 05.03.2031                           | 300            | 304                      | 0,09                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                                       | 400            | 389                      | 0,12                              | American Airlines Pass-Through Trust             |                |                          |                                   | Cloud Software Group, Inc.                             |                |                          |                                   |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                                     |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 15.04.2030                     | 60             | 57                       | 0,02                              | 8,250 % fällig am 30.06.2032                           | 350            | 373                      | 0,11                              |
| 4,974 % fällig am 25.05.2046                                       | 524            | 157                      | 0,05                              | 3,150 % fällig am 15.08.2033                     | 73             | 67                       | 0,02                              | Clue Opco LLC                                          |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.02.2036                                       | 828            | 714                      | 0,22                              | 3,200 % fällig am 15.12.2029                     | 486            | 466                      | 0,14                              | 9,500 % fällig am 15.10.2031                           | 75             | 80                       | 0,02                              |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                                |                |                          |                                   | 3,350 % fällig am 15.04.2031                     | 186            | 178                      | 0,05                              | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.                  |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.08.2036                                       | 3.484          | 1.022                    | 0,31                              | 3,375 % fällig am 01.11.2028                     | 300            | 292                      | 0,09                              | 6,750 % fällig am 15.04.2032                           | 400            | 411                      | 0,13                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2036                                       | 822            | 767                      | 0,23                              | 3,575 % fällig am 15.07.2029                     | 238            | 231                      | 0,07                              | 6,875 % fällig am 15.01.2030                           | 350            | 358                      | 0,11                              |
| 5,184 % fällig am 25.12.2034                                       | 830            | 834                      | 0,25                              | 3,650 % fällig am 15.12.2029                     | 61             | 58                       | 0,02                              | Cogent Communications Group LLC                        |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.02.2034                                       | 379            | 387                      | 0,12                              | 3,650 % fällig am 15.08.2030                     | 185            | 179                      | 0,05                              | 6,500 % fällig am 01.07.2032                           | 300            | 296                      | 0,09                              |
| 5,334 % fällig am 25.04.2034                                       | 64             | 63                       | 0,02                              | 3,700 % fällig am 01.04.2028                     | 46             | 45                       | 0,01                              | Community Health Systems, Inc.                         |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                             |                |                          |                                   | American Builders & Contractors Supply Co., Inc. |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.05.2030                           | 375            | 333                      | 0,10                              |
| 4,574 % fällig am 25.05.2037                                       | 171            | 132                      | 0,04                              | 3,875 % fällig am 15.11.2029                     | 300            | 284                      | 0,09                              | 5,625 % fällig am 15.03.2027                           | 250            | 246                      | 0,07                              |
| 4,754 % fällig am 25.09.2036                                       | 223            | 96                       | 0,03                              | American Express Co.                             |                |                          |                                   | Coty, Inc.                                             |                |                          |                                   |
| 5,139 % fällig am 25.01.2035                                       | 290            | 287                      | 0,09                              | 5,667 % fällig am 25.04.2036                     | 300            | 311                      | 0,09                              | 6,625 % fällig am 15.07.2030                           | 700            | 717                      | 0,22                              |
| 8,234 % fällig am 25.02.2047                                       | 97             | 80                       | 0,02                              | American Tower Corp.                             |                |                          |                                   | CQP Holdco LP                                          |                |                          |                                   |
| New Century Home Equity Loan Trust                                 |                |                          |                                   | 5,900 % fällig am 15.11.2033                     | 500            | 528                      | 0,16                              | 5,500 % fällig am 15.06.2031                           | 1.000          | 989                      | 0,30                              |
| 7,434 % fällig am 25.01.2033                                       | 127            | 109                      | 0,03                              | Amgen, Inc.                                      |                |                          |                                   | Credit Acceptance Corp.                                |                |                          |                                   |
| Option One Mortgage Loan Trust                                     |                |                          |                                   | 5,650 % fällig am 02.03.2053                     | 275            | 269                      | 0,08                              | 6,625 % fällig am 15.03.2030                           | 400            | 406                      | 0,12                              |
| 4,874 % fällig am 25.01.2037                                       | 225            | 132                      | 0,04                              | AppLovin Corp.                                   |                |                          |                                   | Crown Castle, Inc.                                     |                |                          |                                   |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 01.12.2029                     | 450            | 456                      | 0,14                              | 2,250 % fällig am 15.01.2031                           | 800            | 696                      | 0,21                              |
| 6,234 % fällig am 25.12.2034                                       | 338            | 337                      | 0,10                              | Ares Strategic Income Fund                       |                |                          |                                   | DCL BidCo LLC                                          |                |                          |                                   |
| Renaissance Home Equity Loan Trust                                 |                |                          |                                   | 6,200 % fällig am 21.03.2032                     | 300            | 301                      | 0,09                              | 7,750 % fällig am 15.11.2029                           | 300            | 304                      | 0,09                              |
| 5,340 % fällig am 25.01.2037                                       | 1.336          | 411                      | 0,12                              | Arthur J Gallagher & Co.                         |                |                          |                                   | EchoStar Corp.                                         |                |                          |                                   |
| Residential Asset Securities Corp. Trust                           |                |                          |                                   | 4,850 % fällig am 15.12.2029                     | 400            | 406                      | 0,12                              | 10,750 % fällig am 30.11.2029                          | 175            | 180                      | 0,05                              |
| 5,139 % fällig am 25.09.2035                                       | 518            | 497                      | 0,15                              | Ashtead Capital, Inc.                            |                |                          |                                   | Edison International                                   |                |                          |                                   |
| 5,319 % fällig am 25.01.2034                                       | 5              | 5                        | 0,00                              | 5,800 % fällig am 15.04.2034                     | 400            | 410                      | 0,12                              | 5,450 % fällig am 15.06.2029                           | 100            | 99                       | 0,03                              |
| Saxon Asset Securities Trust                                       |                |                          |                                   | AT&T, Inc.                                       |                |                          |                                   | Elevance Health, Inc.                                  |                |                          |                                   |
| 4,899 % fällig am 25.03.2036                                       | 198            | 193                      | 0,06                              | 3,800 % fällig am 01.12.2057                     | 575            | 403                      | 0,12                              | 4,750 % fällig am 15.02.2033                           | 600            | 596                      | 0,18                              |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                     |                |                          |                                   | Avantor Funding, Inc.                            |                |                          |                                   | Encore Capital Group, Inc.                             |                |                          |                                   |
| 4,614 % fällig am 25.07.2036                                       | 83             | 27                       | 0,01                              | 2,625 % fällig am 01.11.2025                     | € 310          | 364                      | 0,11                              | 9,250 % fällig am 01.04.2029                           | 400            | 426                      | 0,13                              |
| 5,109 % fällig am 25.01.2035                                       | 16             | 15                       | 0,00                              | Aviation Capital Group LLC                       |                |                          |                                   | Energy Transfer LP                                     |                |                          |                                   |
| Soundview Home Loan Trust                                          |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.11.2027                     | \$ 400         | 390                      | 0,12                              | 7,500 % fällig am 01.07.2038                           | 1.325          | 1.518                    | 0,46                              |
| 4,899 % fällig am 25.06.2036                                       | 4.836          | 4.321                    | 1,31                              | Axalta Coating Systems LLC                       |                |                          |                                   | EQT Corp.                                              |                |                          |                                   |
| Structured Asset Investment Loan Trust                             |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 15.02.2029                     | 500            | 474                      | 0,14                              | 3,625 % fällig am 15.05.2031                           | 400            | 371                      | 0,11                              |
| 4,814 % fällig am 25.03.2036                                       | 22             | 22                       | 0,01                              | Axon Enterprise, Inc.                            |                |                          |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC                              |                |                          |                                   |
| 5,064 % fällig am 25.11.2035                                       | 178            | 175                      | 0,05                              | 6,125 % fällig am 15.03.2030                     | 600            | 618                      | 0,19                              | 5,850 % fällig am 17.05.2027                           | 500            | 504                      | 0,15                              |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust              |                |                          |                                   | Bank of America Corp.                            |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 07.11.2029                           | 600            | 602                      | 0,18                              |
| 5,124 % fällig am 25.09.2035                                       | 153            | 146                      | 0,04                              | 3,261 % fällig am 28.01.2031                     | € 700          | 828                      | 0,25                              | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC |                |                          |                                   |
| 6,434 % fällig am 25.08.2037                                       | 17             | 17                       | 0,01                              | 4,571 % fällig am 27.04.2033                     | \$ 1.000       | 984                      | 0,30                              | 5,875 % fällig am 15.04.2033                           | 400            | 395                      | 0,12                              |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust                          |                |                          |                                   | 5,288 % fällig am 25.04.2034                     | 250            | 255                      | 0,08                              | 7,000 % fällig am 01.05.2031                           | 425            | 440                      | 0,13                              |
| 4,734 % fällig am 25.01.2037                                       | 147            | 127                      | 0,04                              | Bayer U.S. Finance LLC                           |                |                          |                                   | Freedom Mortgage Corp.                                 |                |                          |                                   |
|                                                                    |                | 20.110                   | 6,10                              | 4,375 % fällig am 15.12.2028                     | 600            | 595                      | 0,18                              | 6,625 % fällig am 15.01.2027                           | 1.100          | 1.103                    | 0,34                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Block, Inc.                                      |                |                          |                                   | Frontier Communications Holdings LLC                   |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.05.2032                     | 675            | 697                      | 0,21                              | 5,875 % fällig am 15.10.2027                           | 100            | 100                      | 0,03                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Boeing Co.                                       |                |                          |                                   | Genesis Energy LP                                      |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 01.08.2059                     | 500            | 342                      | 0,10                              | 8,250 % fällig am 15.01.2029                           | 200            | 209                      | 0,06                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | 5,705 % fällig am 01.05.2040                     | 500            | 494                      | 0,15                              | Global Atlantic Fin Co.                                |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 6,298 % fällig am 01.05.2029                     | 400            | 423                      | 0,13                              | 4,400 % fällig am 15.10.2029                           | 500            | 486                      | 0,15                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Boost Newco Borrower LLC                         |                |                          |                                   | Global Medical Response, Inc. (9,500 % PIK)            |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 15.01.2031                     | 500            | 531                      | 0,16                              | 9,500 % fällig am 31.10.2028 (b)                       | 227            | 228                      | 0,07                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Booz Allen Hamilton, Inc.                        |                |                          |                                   | GLP Capital LP                                         |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 01.09.2028                     | 500            | 485                      | 0,15                              | 5,625 % fällig am 15.09.2034                           | 475            | 474                      | 0,14                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | British Airways Pass-Through Trust               |                |                          |                                   | Goat Holdco LLC                                        |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.05.2034                     | 178            | 171                      | 0,05                              | 6,750 % fällig am 01.02.2032                           | 300            | 305                      | 0,09                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Broadcom, Inc.                                   |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                              |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 3,187 % fällig am 15.11.2036                     | 1.015          | 842                      | 0,26                              | 2,615 % fällig am 22.04.2032                           | 325            | 289                      | 0,09                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Brown & Brown, Inc.                              |                |                          |                                   | 5,330 % fällig am 23.07.2035                           | 600            | 605                      | 0,18                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 23.06.2030                     | 200            | 202                      | 0,06                              | 5,727 % fällig am 25.04.2030                           | 100            | 104                      | 0,03                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Builders FirstSource, Inc.                       |                |                          |                                   | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc.            |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 01.02.2032                     | 750            | 695                      | 0,21                              | 6,375 % fällig am 01.07.2034                           | 325            | 325                      | 0,10                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Cantor Fitzgerald LP                             |                |                          |                                   | HAT Holdings LLC                                       |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 7,200 % fällig am 12.12.2028                     | 400            | 425                      | 0,13                              | 8,000 % fällig am 15.06.2027                           | 500            | 522                      | 0,16                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Carvana Co. (13,000 % PIK)                       |                |                          |                                   | HCA, Inc.                                              |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 13,000 % fällig am 01.06.2030 (b)                | 325            | 342                      | 0,10                              | 5,500 % fällig am 01.06.2033                           | 675            | 691                      | 0,21                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | CDW LLC                                          |                |                          |                                   | Hilton Grand Vacations Borrower LLC                    |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 5,100 % fällig am 01.03.2030                     | 450            | 453                      | 0,14                              | 4,875 % fällig am 01.07.2031                           | 100            | 92                       | 0,03                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | Centene Corp.                                    |                |                          |                                   | Host Hotels & Resorts LP                               |                |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 01.08.2031                     | 725            | 622                      | 0,19                              | 5,500 % fällig am 15.04.2035                           | 300            | 297                      | 0,09                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.12.2029                     | 300            | 292                      | 0,09                              |                                                        |                |                          |                                   |

### AKTIEN

|                           |       |    |      |
|---------------------------|-------|----|------|
| <b>STAMMAKTION</b>        |       |    |      |
| <b>ENERGIE</b>            |       |    |      |
| New Fortress Energy, Inc. |       |    |      |
| 'A' (c)                   | 3.551 | 12 | 0,00 |

### INDUSTRIEWERTE

|                                    |     |    |      |
|------------------------------------|-----|----|------|
| Spirit Aviation Holdings, Inc. (c) | 371 | 2  | 0,00 |
|                                    |     | 14 | 0,00 |

### PARI

|                                     |        |     |      |
|-------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b> |        |     |      |
| Rivian Automotive, Inc.             |        |     |      |
| 4,625 % fällig am 15.03.2029        | \$ 800 | 815 | 0,25 |

### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                    |     |     |      |
|------------------------------------|-----|-----|------|
| AEP Transmission Co. LLC           |     |     |      |
| 5,150 % fällig am 01.04.2034       | 450 | 456 | 0,14 |
| AES Corp.                          |     |     |      |
| 5,800 % fällig am 15.03.2032       | 600 | 609 | 0,19 |
| Aethon United BR LP                |     |     |      |
| 7,500 % fällig am 01.10.2029       | 300 | 315 | 0,10 |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust |     |     |      |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029       | 388 | 389 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Howard Midstream Energy Partners LLC | \$ 250         | \$ 263                   | 0,08                              | PennyMac Financial Services, Inc.        | \$ 225         | \$ 233                   | 0,07                              | Venture Global Calcasieu Pass LLC               | \$ 750         | \$ 774                   | 0,24                              |
| 7,375 % fällig am 15.07.2032         |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 15.11.2030             |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 15.01.2030                    |                |                          |                                   |
| IHG Finance LLC                      | € 300          | 354                      | 0,11                              | Permian Resources Operating LLC          | 200            | 202                      | 0,06                              | Venture Global LNG, Inc.                        | 850            | 860                      | 0,26                              |
| 3,625 % fällig am 27.09.2031         |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.02.2033             |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 15.01.2030                    |                |                          |                                   |
| Ingevity Corp.                       | \$ 350         | 334                      | 0,10                              | PRA Group, Inc.                          | 375            | 385                      | 0,12                              | 8,125 % fällig am 01.06.2028                    | 1.375          | 1.422                    | 0,43                              |
| 3,875 % fällig am 01.11.2028         |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am 01.02.2028             |                |                          |                                   | Verizon Communications, Inc.                    | 750            | 647                      | 0,20                              |
| IQVIA, Inc.                          | 800            | 822                      | 0,25                              | Prime Healthcare Services, Inc.          | 200            | 199                      | 0,06                              | 2,355 % fällig am 15.03.2032                    |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 01.06.2032         |                |                          |                                   | 9,375 % fällig am 01.09.2029             |                |                          |                                   | VFH Parent LLC                                  | 200            | 210                      | 0,06                              |
| Jane Street Group                    | 325            | 334                      | 0,10                              | Prime Security Services Borrower LLC     | 750            | 727                      | 0,22                              | 7,500 % fällig am 15.06.2031                    |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 01.05.2033         |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 31.08.2027             |                |                          |                                   | VICI Properties LP                              | 250            | 242                      | 0,07                              |
| 7,125 % fällig am 30.04.2031         | 650            | 684                      | 0,21                              | Puget Energy, Inc.                       | 350            | 352                      | 0,11                              | 3,875 % fällig am 15.02.2029                    |                |                          |                                   |
| JPMorgan Chase & Co.                 | 1.000          | 990                      | 0,30                              | 5,725 % fällig am 15.03.2035             |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.01.2028                    | 250            | 249                      | 0,08                              |
| 4,586 % fällig am 26.04.2033         |                |                          |                                   | Quikrete Holdings, Inc.                  | 300            | 310                      | 0,09                              | Walgreens Boots Alliance, Inc.                  | £ 300          | 407                      | 0,12                              |
| 4,603 % fällig am 22.10.2030         | 300            | 301                      | 0,09                              | 6,750 % fällig am 01.03.2033             |                |                          |                                   | 3,600 % fällig am 20.11.2025                    | \$ 300         | 318                      | 0,10                              |
| 5,294 % fällig am 22.07.2035         | 625            | 636                      | 0,19                              | QXO Building Products, Inc.              | 300            | 310                      | 0,09                              | 8,125 % fällig am 15.08.2029                    |                |                          |                                   |
| Kinder Morgan Energy Partners LP     | 400            | 424                      | 0,13                              | 6,750 % fällig am 30.04.2032             |                |                          |                                   | Warnmedia Holdings, Inc.                        | 100            | 85                       | 0,03                              |
| 6,500 % fällig am 01.02.2037         | 200            | 222                      | 0,07                              | Raven Acquisition Holdings LLC           | 600            | 601                      | 0,18                              | 4,279 % fällig am 15.03.2032                    |                |                          |                                   |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038         |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.11.2031             |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 15.03.2042                    | 100            | 68                       | 0,02                              |
| Kraken Oil & Gas Partners LLC        | 400            | 393                      | 0,12                              | Realty Income Corp.                      | 450            | 451                      | 0,14                              | Wayfair LLC                                     | 300            | 301                      | 0,09                              |
| 7,625 % fällig am 15.08.2029         |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 15.04.2035             |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 31.10.2029                    |                |                          |                                   |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP | 400            | 403                      | 0,12                              | Rio Oil Finance Trust                    | 334            | 348                      | 0,11                              | Wells Fargo & Co.                               | 850            | 878                      | 0,27                              |
| 5,500 % fällig am 01.08.2030 (a)     |                |                          |                                   | 8,200 % fällig am 06.04.2028             |                |                          |                                   | 5,574 % fällig am 25.07.2029                    |                |                          |                                   |
| Las Vegas Sands Corp.                | 600            | 592                      | 0,18                              | Rocket Cos., Inc.                        | 300            | 306                      | 0,09                              | Windstream Services LLC                         | 525            | 550                      | 0,17                              |
| 3,500 % fällig am 18.08.2026         | 300            | 286                      | 0,09                              | 6,125 % fällig am 01.08.2030             |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 01.10.2031                    |                |                          |                                   |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029         |                |                          |                                   | Rockies Express Pipeline LLC             | 200            | 196                      | 0,06                              | WMG Acquisition Corp.                           | 725            | 658                      | 0,20                              |
| LifePoint Health, Inc.               | 425            | 469                      | 0,14                              | 4,950 % fällig am 15.07.2029             |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 15.02.2031                    |                |                          |                                   |
| 11,000 % fällig am 15.10.2030        |                |                          |                                   | Rollins, Inc.                            | 300            | 301                      | 0,09                              | Wynn Resorts Finance LLC                        | 400            | 403                      | 0,12                              |
| Marvell Technology, Inc.             | 300            | 302                      | 0,09                              | 5,250 % fällig am 24.02.2035             |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 15.03.2033                    | 300            | 320                      | 0,10                              |
| 5,450 % fällig am 15.07.2035         |                |                          |                                   | Sammons Financial Group, Inc.            | 500            | 537                      | 0,16                              | 7,125 % fällig am 15.02.2031                    |                |                          |                                   |
| Matador Resources Co.                | 500            | 498                      | 0,15                              | 6,875 % fällig am 15.04.2034             |                |                          |                                   |                                                 | 80.972         | 24,57                    |                                   |
| 6,250 % fällig am 15.04.2033         |                |                          |                                   | Schlumberger Holdings Corp.              | 400            | 396                      | 0,12                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>       |                |                          |                                   |
| Medline Borrower LP                  | 500            | 480                      | 0,15                              | 5,000 % fällig am 01.06.2034             |                |                          |                                   | Amentum Government Services Holdings LLC        | 284            | 284                      | 0,09                              |
| 3,875 % fällig am 01.04.2029         |                |                          |                                   | Selective Insurance Group, Inc.          | 300            | 307                      | 0,09                              | 6,577 % fällig am 29.09.2031                    |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley                       | 500            | 480                      | 0,15                              | 5,900 % fällig am 15.04.2035             |                |                          |                                   | Cotiviti Corp.                                  | 767            | 765                      | 0,23                              |
| 3,622 % fällig am 01.04.2031         | 400            | 407                      | 0,12                              | Shift4 Payments LLC                      | 300            | 312                      | 0,10                              | 7,074 % fällig am 01.05.2031                    |                |                          |                                   |
| 5,042 % fällig am 19.07.2030         | 700            | 712                      | 0,22                              | 6,750 % fällig am 15.08.2032             |                |                          |                                   | DirectTV Financing LLC                          | 346            | 344                      | 0,10                              |
| 5,250 % fällig am 21.04.2034         |                |                          |                                   | Sitio Royalties Operating Partnership LP | 450            | 471                      | 0,14                              | 9,791 % fällig am 02.08.2029                    |                |                          |                                   |
| MPH Acquisition Holdings LLC         | 54             | 44                       | 0,01                              | 7,875 % fällig am 01.11.2028             |                |                          |                                   | Endure Digital, Inc.                            | 597            | 460                      | 0,14                              |
| 5,750 % fällig am 31.12.2030         | 28             | 28                       | 0,01                              | SLM Corp.                                | 675            | 709                      | 0,22                              | 7,927 % fällig am 10.02.2028                    |                |                          |                                   |
| 11,500 % fällig am 31.12.2030        |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 31.01.2030             |                |                          |                                   | Fortress Intermediate, Inc.                     | 397            | 398                      | 0,12                              |
| National Grid North America, Inc.    | € 300          | 352                      | 0,11                              | Southern California Edison Co.           | 300            | 292                      | 0,09                              | 7,827 % fällig am 27.06.2031                    |                |                          |                                   |
| 3,150 % fällig am 03.06.2030         | 400            | 478                      | 0,15                              | 1,200 % fällig am 01.02.2026             |                |                          |                                   | Global Medical Response, Inc. (9,079 % Cash und |                |                          |                                   |
| 3,631 % fällig am 03.09.2031         |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.04.2047             |                |                          |                                   | 0,750 % PIK)                                    |                |                          |                                   |
| Nationstar Mortgage Holdings, Inc.   | \$ 250         | 260                      | 0,08                              | Spirit AeroSystems, Inc.                 | 100            | 106                      | 0,03                              | 0,750 % - 9,079 % fällig                        |                |                          |                                   |
| 7,125 % fällig am 01.02.2032         |                |                          |                                   | 9,375 % fällig am 30.11.2029             | 400            | 442                      | 0,13                              | am 31.10.2028 (b)                               | 92             | 92                       | 0,03                              |
| Newell Brands, Inc.                  | 300            | 316                      | 0,10                              | 9,750 % fällig am 15.11.2030             |                |                          |                                   | Kaseya, Inc.                                    | 299            | 301                      | 0,09                              |
| 8,500 % fällig am 01.06.2028         |                |                          |                                   | Spirit Airlines Pass-Through Trust       | 437            | 388                      | 0,12                              | 7,577 % fällig am 20.03.2032                    |                |                          |                                   |
| Newmark Group, Inc.                  | 400            | 423                      | 0,13                              | 3,375 % fällig am 15.08.2031             |                |                          |                                   | Level 3 Financing, Inc.                         | 500            | 506                      | 0,15                              |
| 7,500 % fällig am 12.01.2029         |                |                          |                                   | Standard Industries, Inc.                | € 875          | 1.018                    | 0,31                              | 8,577 % fällig am 27.03.2032                    |                |                          |                                   |
| NGPL PipeCo LLC                      | 600            | 686                      | 0,21                              | 2,250 % fällig am 21.11.2026             |                |                          |                                   | LifePoint Health, Inc.                          | 299            | 296                      | 0,09                              |
| 7,768 % fällig am 15.12.2037         |                |                          |                                   | Stellantis Finance U.S., Inc.            | \$ 300         | 303                      | 0,09                              | 8,006 % fällig am 19.05.2031                    |                |                          |                                   |
| Noble Finance LLC                    | 500            | 510                      | 0,16                              | 5,750 % fällig am 18.03.2030             |                |                          |                                   | Modena Buyer LLC                                | 143            | 138                      | 0,04                              |
| 8,000 % fällig am 15.04.2030         |                |                          |                                   | Stonepeak Nile Parent LLC                | 300            | 318                      | 0,10                              | 8,780 % fällig am 01.07.2031                    |                |                          |                                   |
| Occidental Petroleum Corp.           | 750            | 841                      | 0,26                              | 7,250 % fällig am 15.03.2032             |                |                          |                                   | MPH Acquisition Holdings LLC                    | 18             | 18                       | 0,01                              |
| 7,875 % fällig am 15.09.2031         |                |                          |                                   | Store Capital LLC                        | 375            | 380                      | 0,12                              | 8,030 % fällig am 31.12.2030                    |                |                          |                                   |
| Oncor Electric Delivery Co. LLC      | € 300          | 352                      | 0,11                              | 5,400 % fällig am 30.04.2030             |                |                          |                                   | Novelis Corp.                                   | 399            | 400                      | 0,12                              |
| 3,625 % fällig am 15.06.2034         |                |                          |                                   | Systems Energy Resources, Inc.           | 400            | 395                      | 0,12                              | 6,296 % fällig am 11.03.2032                    |                |                          |                                   |
| OneMain Finance Corp.                | \$ 300         | 308                      | 0,09                              | 5,300 % fällig am 15.12.2034             |                |                          |                                   | Primo Brands Corp.                              | 494            | 496                      | 0,15                              |
| 6,625 % fällig am 15.05.2029         | 250            | 261                      | 0,08                              | T-Mobile USA, Inc.                       | 400            | 358                      | 0,11                              | 6,546 % fällig am 31.03.2028                    |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 15.05.2031         | 500            | 525                      | 0,16                              | 2,550 % fällig am 15.02.2031             |                |                          |                                   | QualityTech LP                                  | 300            | 301                      | 0,09                              |
| 9,000 % fällig am 15.01.2029         |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 15.01.2035             |                |                          |                                   | 7,813 % fällig am 30.10.2031                    |                |                          |                                   |
| ONEOK, Inc.                          | 400            | 409                      | 0,12                              | TopBuild Corp.                           | 100            | 95                       | 0,03                              | Quikrete Holdings, Inc.                         | 298            | 299                      | 0,09                              |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029         |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 15.03.2029             | 325            | 302                      | 0,09                              | 6,577 % fällig am 19.03.2029                    |                |                          |                                   |
| Oracle Corp.                         | 300            | 291                      | 0,09                              | 4,125 % fällig am 15.02.2032             |                |                          |                                   | 6,577 % fällig am 10.02.2032                    |                |                          |                                   |
| 4,700 % fällig am 27.09.2034         |                |                          |                                   | TransDigm, Inc.                          | 300            | 302                      | 0,09                              | Rockpoint Gas Storage Partners LP               | 298            | 299                      | 0,09                              |
| Organon & Co.                        | € 925          | 1.061                    | 0,32                              | 6,000 % fällig am 15.01.2033             |                |                          |                                   | 7,296 % fällig am 18.09.2031                    |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 30.04.2028         |                |                          |                                   | Uber Technologies, Inc.                  | 300            | 295                      | 0,09                              | Standard Industries, Inc.                       | 182            | 182                      | 0,06                              |
| Pacific Gas & Electric Co.           | \$ 1.800       | 1.289                    | 0,39                              | 4,800 % fällig am 15.09.2034             |                |                          |                                   | 6,071 % fällig am 22.09.2028                    |                |                          |                                   |
| 3,300 % fällig am 01.08.2040         | 200            | 194                      | 0,06                              | UKG, Inc.                                | 1.000          | 1.038                    | 0,32                              | Station Casinos LLC                             | 395            | 396                      | 0,12                              |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028         | 200            | 159                      | 0,05                              | 6,875 % fällig am 01.02.2031             |                |                          |                                   | 6,327 % fällig am 14.03.2031                    |                |                          |                                   |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043         | 300            | 298                      | 0,09                              | United Airlines Pass-Through Trust       | 75             | 70                       | 0,02                              | Stepstone Group Midco GmbH                      | 500            | 486                      | 0,15                              |
| 4,650 % fällig am 01.08.2028         |                |                          |                                   | 2,900 % fällig am 01.11.2029             | 113            | 110                      | 0,03                              | 8,608 % - 8,651 % fällig                        |                |                          |                                   |
| Panther Escrow Issuer LLC            | 700            | 728                      | 0,22                              | 3,450 % fällig am 01.06.2029             | 121            | 116                      | 0,04                              | am 19.12.2031                                   |                |                          |                                   |
| 7,125 % fällig am 01.06.2031         |                |                          |                                   | 3,450 % fällig am 07.01.2030             | 204            | 193                      | 0,06                              | Triton Water Holdings, Inc.                     | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Paramount Global                     | 300            | 274                      | 0,08                              | 3,500 % fällig am 01.09.2031             |                |                          |                                   | TBD % fällig am 31.03.2028                      |                |                          |                                   |
| 4,200 % fällig am 19.05.2032         |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                        | PARI<br>(000S)    | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Twitter, Inc.<br>10,927 % fällig am<br>26.10.2029                                    | \$ 497         | \$ 487                   | 0,15                              | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust<br>5,094 % fällig am 25.11.2029                        | \$ 1           | \$ 0                     | 0,00                              | <b>USBEKISTAN</b>                                                                   |                   |                          |                                   |
| U.S. Renal Care, Inc.<br>9,441 % fällig am 20.06.2028                                | 298            | 283                      | 0,09                              | 5,205 % fällig am 25.05.2036                                                                  | 3              | 2                        | 0,00                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                             |                   |                          |                                   |
|                                                                                      |                | 7.530                    | 2,29                              | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust<br>4,664 % fällig am 25.03.2036                            | 27             | 15                       | 0,00                              | Republic of Uzbekistan International Bond<br>5,375 % fällig am<br>29.05.2027        | € 300             | \$ 361                   | 0,11                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                                |                |                          |                                   | Residential Accredit Loans, Inc. Trust<br>4,834 % fällig am 25.05.2047                        | 52             | 48                       | 0,02                              | <b>VENEZUELA</b>                                                                    |                   |                          |                                   |
| Banc of America Alternative Loan Trust<br>4,834 % fällig am 25.01.2037               | 63             | 52                       | 0,02                              | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust<br>4,874 % fällig am 25.06.2037                | 149            | 137                      | 0,04                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                             |                   |                          |                                   |
| Banc of America Funding Trust<br>5,078 % fällig am 20.01.2047                        | 32             | 28                       | 0,01                              | Structured Asset Mortgage Investments Trust<br>4,834 % fällig am 25.05.2036                   | 372            | 305                      | 0,09                              | Petroleos de Venezuela S.A.<br>5,375 % fällig am<br>12.04.2027 ^                    | \$ 555            | 70                       | 0,02                              |
| BCAP LLC Trust<br>6,250 % fällig am 26.08.2036                                       | 1.881          | 743                      | 0,23                              | SunTrust Alternative Loan Trust<br>5,084 % fällig am 25.12.2035                               | 1              | 1                        | 0,00                              | 5,500 % fällig am<br>12.04.2038 ^                                                   | 745               | 94                       | 0,03                              |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust<br>6,530 % fällig am 25.02.2036          | 76             | 68                       | 0,02                              | Thornburg Mortgage Securities Trust<br>5,684 % fällig am 25.06.2037                           | 8              | 7                        | 0,00                              | 6,000 % fällig am<br>16.05.2024 ^                                                   | 1.600             | 204                      | 0,06                              |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>4,118 % fällig am 25.10.2046                  | 16             | 14                       | 0,00                              | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>5,599 % fällig am 25.11.2042                 | 4              | 4                        | 0,00                              |                                                                                     |                   | 368                      | 0,11                              |
| 7,230 % fällig am 25.10.2035                                                         | 44             | 46                       | 0,01                              | Washington Mutual Mortgage Pass-Through<br>Certificates Trust<br>3,928 % fällig am 25.09.2036 | 119            | 32                       | 0,01                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                             |                   |                          |                                   |
| Countrywide Alternative Loan Trust<br>4,834 % fällig am 25.07.2036                   | 3              | 1                        | 0,00                              |                                                                                               |                | 4.540                    | 1,38                              | Venezuela Government International Bond<br>6,000 % fällig am<br>09.12.2020 ^        | 241               | 34                       | 0,01                              |
| 4,852 % fällig am 20.05.2046                                                         | 240            | 213                      | 0,07                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                                                  |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am<br>31.03.2038 ^                                                   | 550               | 97                       | 0,03                              |
| 4,934 % fällig am 25.04.2036                                                         | 504            | 172                      | 0,05                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>4,000 % fällig am 01.07.2055                         | 3.000          | 2.790                    | 0,85                              | 7,750 % fällig am<br>13.10.2019 ^                                                   | 1.900             | 283                      | 0,09                              |
| 5,879 % fällig am 25.01.2036                                                         | 8              | 8                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 01.08.2055                                                                  | 4.100          | 3.920                    | 1,19                              |                                                                                     |                   | 414                      | 0,13                              |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036                                                         | 130            | 65                       | 0,02                              | 5,000 % fällig am 01.08.2055                                                                  | 6.000          | 5.877                    | 1,78                              | Summe Venezuela                                                                     |                   | 782                      | 0,24                              |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037                                                         | 850            | 322                      | 0,10                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                                                                  | 14.100         | 14.316                   | 4,34                              | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                                                     |                   |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037                                                         | 188            | 94                       | 0,03                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055                                                                  | 17.900         | 18.457                   | 5,60                              | <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>                                                       |                   |                          |                                   |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust<br>4,252 % fällig am 25.03.2037    | 7              | 6                        | 0,00                              |                                                                                               |                | 45.360                   | 13,76                             | 23,286 % fällig am<br>04.11.2025 (d)(e)                                             | NGN 45.000        | 27                       | 0,01                              |
| 4,974 % fällig am 25.04.2046                                                         | 1.715          | 493                      | 0,15                              | <b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>                                                                  |                |                          |                                   | Summe kurzfristige Instrumente                                                      |                   | 27                       | 0,01                              |
| 5,359 % fällig am 25.04.2046                                                         | 17             | 5                        | 0,00                              | U.S. Treasury Bonds<br>3,875 % fällig am 15.05.2043                                           | 4.100          | 3.663                    | 1,11                              | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>                                               | <b>\$ 338.550</b> | <b>102,71</b>            |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036                                                         | 333            | 148                      | 0,05                              | 4,125 % fällig am 15.08.2044                                                                  | 1.900          | 1.741                    | 0,53                              | <b>AKTIEN</b>                                                                       |                   |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037                                                         | 65             | 22                       | 0,01                              | 4,375 % fällig am 15.08.2043                                                                  | 2.900          | 2.765                    | 0,84                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                                                              |                   |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036                                                         | 98             | 29                       | 0,01                              | 4,625 % fällig am 15.05.2044                                                                  | 3.000          | 2.943                    | 0,89                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                            |                   |                          |                                   |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.<br>6,500 % fällig am 25.04.2033 | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,750 % fällig am 15.11.2043                                                                  | 3.000          | 2.998                    | 0,91                              | PIMCO Funds: Global<br>Investors Series plc -<br>US Short-Term Fund (h)             | 1.837.591         | 18.780                   | 5,70                              |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates<br>3,500 % fällig am 26.04.2038          | 68             | 67                       | 0,02                              |                                                                                               |                | 14.110                   | 4,28                              | PIMCO Select Funds plc -<br>PIMCO US Dollar Short-<br>Term Floating NAV<br>Fund (h) | 698.116           | 6.962                    | 2,11                              |
| 5,760 % fällig am 27.09.2035                                                         | 65             | 55                       | 0,02                              | <b>OPTIONSSCHEINE</b>                                                                         |                |                          |                                   |                                                                                     |                   | 25.742                   | 7,81                              |
| First Horizon Mortgage Pass-Through Trust<br>6,973 % fällig am 25.09.2035            | 10             | 10                       | 0,00                              | Spirit Aviation Holdings, Inc. -<br>Exp. 11.03.2035 (j)                                       | 2.128          | 11                       | 0,00                              | <b>Summe Investmentfonds</b>                                                        | <b>\$ 25.742</b>  | <b>7,81</b>              |                                   |
| HarborView Mortgage Loan Trust<br>4,872 % fällig am 19.05.2035                       | 125            | 120                      | 0,04                              | Spirit Aviation Holdings, Inc. -<br>Exp. 11.03.2035                                           | 7.050          | 35                       | 0,01                              |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| 4,912 % fällig am 19.06.2035                                                         | 2              | 2                        | 0,00                              |                                                                                               |                | 46                       | 0,01                              |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| 4,972 % fällig am 20.10.2045                                                         | 223            | 206                      | 0,06                              | Summe USA                                                                                     |                | 173.497                  | 52,64                             |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| 5,052 % fällig am 19.11.2035                                                         | 3              | 2                        | 0,00                              |                                                                                               |                |                          |                                   |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| IndyMac Mortgage Loan Trust<br>3,203 % fällig am 25.06.2037                          | 10             | 8                        | 0,00                              |                                                                                               |                |                          |                                   |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| 4,170 % fällig am 25.12.2036                                                         | 2              | 1                        | 0,00                              |                                                                                               |                |                          |                                   |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.07.2047                                                         | 48             | 31                       | 0,01                              |                                                                                               |                |                          |                                   |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| Lehman Mortgage Trust<br>6,000 % fällig am 25.09.2037                                | 62             | 61                       | 0,02                              |                                                                                               |                |                          |                                   |                                                                                     |                   |                          |                                   |
| Luminent Mortgage Trust<br>4,834 % fällig am 25.10.2046                              | 555            | 507                      | 0,15                              |                                                                                               |                |                          |                                   |                                                                                     |                   |                          |                                   |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Euro-Bobl September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 33                   | \$ (21)                                         | (0,01)                  |
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 9                    | (1)                                             | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 1                    | (1)                                             | 0,00                    |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Long  | 09.2025     | 6                    | (16)                                            | 0,00                    |
| Euro-Oat September Futures                                     | Short | 09.2025     | 8                    | 5                                               | 0,00                    |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 41                   | (9)                                             | 0,00                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 174                  | 143                                             | 0,04                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 167                  | 174                                             | 0,05                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 233                  | 529                                             | 0,16                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 33                   | 84                                              | 0,03                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025     | 13                   | 29                                              | 0,01                    |
|                                                                |       |             |                      | \$ 916                                          | 0,28                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                      | \$ 916                                          | 0,28                    |



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

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

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

| Referenzeinheit              | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| AT&T, Inc.                   | 1,000 %                        | 20.06.2028       | \$ 300                    | \$ 6                                            | 0,00                    |
| Boeing Co.                   | 1,000                          | 20.12.2026       | 500                       | 3                                               | 0,00                    |
| Carnival Corp.               | 1,000                          | 20.12.2028       | 400                       | 91                                              | 0,03                    |
| Glencore Finance Europe Ltd. | 5,000                          | 20.06.2031       | € 500                     | 5                                               | 0,00                    |
|                              |                                |                  |                           | <b>\$ 105</b>                                   | <b>0,03</b>             |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-43 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.12.2029       | \$ 6.800                  | \$ 19                                           | 0,01                    |
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000                          | 20.06.2030       | 10.800                    | 311                                             | 0,09                    |
| CDX.IG-43 5-Year Index | 1,000                          | 20.12.2029       | 2.200                     | 3                                               | 0,00                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 24.300                    | 162                                             | 0,05                    |
|                        |                                |                  |                           | <b>\$ 495</b>                                   | <b>0,15</b>             |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 5.600    | \$ 83                                           | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500           | 19.03.2035       | 900        | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 19.03.2027       | 3.200      | (21)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 19.03.2055       | 500        | 21                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 1,000           | 15.06.2027       | \$ 33.300  | (2.070)                                         | (0,63)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 1,000           | 16.12.2030       | 22.300     | 2.936                                           | 0,89                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 21.06.2028       | 64.500     | (1.274)                                         | (0,39)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2030       | 42.300     | (362)                                           | (0,11)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 19.03.2035       | 46.900     | (1.403)                                         | (0,43)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2055       | 5.600      | (100)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 20.06.2054       | 23.900     | 351                                             | 0,11                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2029       | 5.000      | 93                                              | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,842           | 04.03.2030       | 400        | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,870           | 05.03.2035       | 100        | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,874           | 05.03.2035       | 200        | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,884           | 25.03.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,890           | 03.03.2035       | 100        | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,899           | 11.03.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,900           | 15.02.2035       | 7.652      | (137)                                           | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,905           | 12.03.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,908           | 04.03.2035       | 200        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,930           | 24.03.2035       | 400        | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,975           | 21.03.2035       | 200        | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000           | 26.02.2035       | 100        | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,291          | 02.01.2029       | BRL 8.200  | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,320          | 02.01.2029       | 900        | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,926          | 04.01.2027       | 1.600      | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927          | 04.01.2027       | 12.400     | (6)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2025       | CAD 1.100  | 11                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month AUD-BBR-BBSV                | 4,750           | 20.12.2033       | AUD 7.000  | 66                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR                  | 3,365           | 28.11.2029       | CZK 17.800 | 14                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,000           | 17.09.2027       | € 15.000   | (70)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2030       | 16.400     | (233)                                           | (0,07)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2035       | 900        | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2055       | 3.390      | 131                                             | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,350           | 29.04.2030       | 200        | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,400           | 09.04.2030       | 200        | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,450           | 05.05.2035       | 100        | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520           | 09.04.2035       | 100        | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,550           | 16.04.2035       | 100        | 1                                               | 0,00                    |
|                                             |                                     |                 |                  |            | <b>\$ (2.005)</b>                               | <b>(0,61)</b>           |
|                                             |                                     |                 |                  |            | <b>\$ (1.405)</b>                               | <b>(0,43)</b>           |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

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

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

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850 %       | 16.07.2025    | 400                       | \$ (1)  | \$ 0      | 0,00                 |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900         | 16.07.2025    | 800                       | (1)     | 0         | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 1,000         | 16.07.2025    | 400                       | 0       | 0         | 0,00                 |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850         | 16.07.2025    | 400                       | (1)     | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900         | 16.07.2025    | 400                       | 0       | 0         | 0,00                 |
|            |                                  |                     |               |               |                           | \$ (3)  | \$ 0      | 0,00                 |

### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750    | 11.08.2025    | 200                       | \$ (6)  | \$ 0      | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750        | 11.08.2025    | 200                       | (5)     | (1)       | 0,00                 |
|            |                           |               |               |                           | \$ (11) | \$ (1)    | 0,00                 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,555 %       | 24.07.2025    | 600                       | \$ (2)  | \$ (2)    | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,905         | 24.07.2025    | 600                       | (2)     | (1)       | 0,00                 |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,564         | 24.07.2025    | 600                       | (2)     | (2)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,605         | 23.07.2025    | 600                       | (2)     | (3)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,914         | 24.07.2025    | 600                       | (2)     | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,955         | 23.07.2025    | 600                       | (2)     | (1)       | 0,00                 |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,583         | 23.07.2025    | 600                       | (2)     | (3)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,933         | 23.07.2025    | 600                       | (2)     | (1)       | 0,00                 |
|            |                                       |                         |                                   |               |               |                           | \$ (16) | \$ (14)   | 0,00                 |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond       | 1,000 %                     | 20.12.2028       | \$ 400                    | \$ (8)                                 | \$ 7                                      | \$ (1)    | 0,00                 |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                       | 20.06.2028       | 500                       | (44)                                   | 42                                        | (2)       | 0,00                 |
| BPS        | Brazil Government International Bond       | 1,000                       | 20.12.2028       | 1.300                     | (25)                                   | 23                                        | (2)       | 0,00                 |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                       | 20.06.2026       | 200                       | 1                                      | 0                                         | 1         | 0,00                 |
| BRC        | Indonesia Government International Bond    | 1,000                       | 20.06.2031       | 2.200                     | (94)                                   | 106                                       | 12        | 0,00                 |
| CBK        | Israel Government International Bond       | 1,000                       | 20.06.2027       | 500                       | (3)                                    | 7                                         | 4         | 0,00                 |
| GST        | ADLER Real Estate AG                       | 5,000                       | 20.12.2026       | € 700                     | (4)                                    | 32                                        | 28        | 0,01                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 3,750                       | 24.12.2025       | \$ 500                    | 0                                      | 1                                         | 1         | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 4,850                       | 07.05.2026       | 480                       | 0                                      | 6                                         | 6         | 0,00                 |
|            | SoftBank Group Corp.                       | 1,000                       | 20.06.2026       | 600                       | (5)                                    | 2                                         | (3)       | 0,00                 |
| MYC        | South Africa Government International Bond | 1,000                       | 20.06.2028       | 2.200                     | (128)                                  | 119                                       | (9)       | 0,00                 |
|            |                                            |                             |                  |                           | \$ (310)                               | \$ 345                                    | \$ 35     | 0,01                 |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### DEVIENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                 | \$                    | 518                           | \$ (4)                          | \$ (4)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 1.310                 | 1.525                         | (13)                            | (13)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 259                   | 398                           | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 47                  | NZD                   | 77                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | \$                    | 259                           | (2)                             | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 4.285                 | 595                           | (5)                             | (5)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NZD                 | 77                    | 47                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 1.228                 | € 1.047                       | 3                               | 3                                              | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | € 54.595               | \$ 62.077                | \$ 0                             | \$ (2.009)                         | \$ (2.009)                                           | (0,61)                  |
|            | 07.2025          | IDR 6.704.541          | 411                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS 27                 | 8                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 270.925            | 199                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 16                 | 12                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 543                 | CHF 445                  | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 41                     | KRW 55.933               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 73                 | \$ 2                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 567                 | CNH 4.056                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 12                     | SGD 16                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | BRL 8.141              | \$ 1.450                 | 0                                | (42)                               | (42)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNY 8.455              | 1.178                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 8                    | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR 10.928.638         | 670                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR 165.555            | 1.930                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB 188                | 6                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY 8.375              | 205                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 11.236             | 346                      | 0                                | (41)                               | (41)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 971                 | BRL 5.329                | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 317                    | IDR 5.171.490            | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 920                    | KRW 1.245.480            | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 420                    | THB 13.745               | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.810                  | TWD 53.804               | 40                               | 0                                  | 40                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CNH 490                | \$ 69                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CZK 77                 | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 11.953             | 367                      | 0                                | (49)                               | (49)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$ 576                 | CNH 4.107                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 113                    | INR 9.863                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 563                    | TWD 16.710               | 18                               | 0                                  | 18                                                   | 0,01                    |
|            | 06.2026          | 16                     | KWD 5                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 05.2030          | KWD 163                | \$ 560                   | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | € 1.016                | 1.163                    | 0                                | (29)                               | (29)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW 17.505             | 13                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK 131                | 13                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB 1.304              | 40                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY 16.697             | 410                      | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 9.991               | £ 7.343                  | 72                               | 0                                  | 72                                                   | 0,02                    |
|            | 07.2025          | 8                      | ¥ 1.184                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 9                      | PLN 34                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.087                  | TRY 44.390               | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
| BSH<br>CBK | 07.2025          | 955                    | ZAR 16.973               | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR 35.575             | \$ 1.968                 | 0                                | (31)                               | (31)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CZK 756                | 34                       | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £ 7.343                | 9.992                    | 0                                | (73)                               | (73)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$ 41                  | INR 3.520                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN 694                | \$ 194                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 2.483                  | 678                      | 0                                | (20)                               | (20)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | € 1.949                | 2.262                    | 0                                | (26)                               | (26)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥ 25.500               | 179                      | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 950.496            | 693                      | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | THB 9.845              | 296                      | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 20.176             | 620                      | 0                                | (74)                               | (74)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | 781                    | AUD 1.199                | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.290                  | CAD 1.766                | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.180                  | CNY 8.458                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 136                    | EGP 7.398                | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 448                    | € 392                    | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 220                    | IDR 3.590.260            | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 40                     | THB 1.335                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 542                    | TWD 16.083               | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 1.188              | \$ 165                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 26.721             | 820                      | 0                                | (109)                              | (109)                                                | (0,03)                  |
|            | 08.2025          | \$ 1.939               | CNH 13.864               | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 8                      | EGP 451                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 925                    | INR 79.683               | 3                                | (1)                                | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN 3.914              | \$ 1.059                 | 0                                | (42)                               | (42)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 46                  | EGP 2.519                | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 65.541                 | € 56.496                 | 778                              | 0                                  | 778                                                  | 0,24                    |
|            | 07.2025          | 13                     | KZT 6.971                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 56.372               | \$ 65.541                | 0                                | (777)                              | (777)                                                | (0,24)                  |
|            | 08.2025          | \$ 394                 | INR 33.984               | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 09.2025          | MXN 4.955              | \$ 257                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 41                  | KZT 21.931               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 1                   | MXN 15                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025          | 88                     | KZT 47.084               | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD 1.597              | \$ 1.031                 | 0                                | (16)                               | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF 490                | 595                      | 0                                | (21)                               | (21)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH 1.898              | 264                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN 146                | 40                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 19                 | 15                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| GLM        | 07.2025          | \$                     | 1.393 BRL                | 7.921                            | \$ 58                              | \$ 0                                                 | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 56 CHF                   | 45                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 240 ¥                    | 34.739                           | 1                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 45 \$                    | 56                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 517                      | 72                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 20.426                   | 141                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 188                      | 16.276                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 10 SGD                   | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | BRL                    | 1.252                    | 223                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 12.725                   | 654                              | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 5.342                    | 969                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 5                        | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 2.477                    | 76                               | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 52                       | 851.626                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 11 EGP                   | 621                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 08.2025          |                        | 4 SGD                    | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 969 BRL                  | 5.424                            | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 3.595                    | 498                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 465                      | 627                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 59.296                   | 43                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 77                       | 46                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 264                      | 71                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 277                      | 216                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 13.055                   | 401                              | 0                                  | (48)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 40                       | 223                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 203 BRL                  | 3.303.094                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 98 PLN                   | 369                              | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 107 TWD                  | 3.183                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 10.087                   | 564                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 3.929                    | 545                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 08.2025          | TWD                    | 14.660                   | 450                              | 0                                  | (60)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 584                      | 4.174                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 127 CNH                  | 11.000                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 8 SGD                    | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 1.766                    | 1.286                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 1.724                    | 239                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 918                      | 714                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 4.942                    | 149                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 7.026                    | 216                              | 0                                  | (26)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.397                    | 1.205                            | 18                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 44 IDR                   | 715.091                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.211 ¥                  | 321.900                          | 17                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 70 PLN                   | 264                              | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.005 SGD                | 1.292                            | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 60 THB                   | 2.001                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          |                        | 186 TWD                  | 5.893                            | 17                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 3.176                    | 441                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 12.993                   | 402                              | 0                                  | (50)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 126                      | 173                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 0 EGP                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 214 SGD                  | 276                              | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 13                       | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 10.572                   | 73                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 415                      | 354                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 139                      | 101                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 44 ¥                     | 6.489                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 123 NOK                  | 1.236                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 527                      | 74                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 6.465                    | 44                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 08.2025          |                        | 1.236                    | 123                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 73                       | 10.533                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 30.803                   | 214                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 55                       | 43                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 296                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 24                       | 1.330                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 243 IDR                  | 3.960.639                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.067 TWD                | 31.742                           | 25                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 2.360                    | 330                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 3.901                    | 120                              | 0                                  | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 168                      | 1.222                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 133 INR                  | 11.402                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 14 ¥                     | 1.995                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 43 SGD                   | 55                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 22                       | 26                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | ¥                      | 296.721                  | 2.056                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 13                       | 129                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 129                      | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 1                        | 66                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2.056 ¥                  | 295.632                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 6.878                    | 9.313                            | 0                                  | (112)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 17.468                   | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 1.234                    | 122                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 789                      | 24                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 13                       | 17.477                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 32 TRY                   | 1.413                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025          |                        | 995 MXN                  | 19.266                           | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 1.235                         | \$ (3.837)                         | \$ (2.602)                                           | (0,79)                  |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu<br>erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 31.825               | \$ 37.263                   | \$ 0                             | \$ (94)                            | \$ (94)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | \$ 32.201              | € 28.341                    | 1.066                            | 0                                  | 1.066                                                | 0,32                    |
|            | 08.2025          | 37.345                 | 31.825                      | 94                               | 0                                  | 94                                                   | 0,03                    |
| BOA        | 07.2025          | 35.758                 | 31.448                      | 1.157                            | 0                                  | 1.157                                                | 0,35                    |
| BPS        | 07.2025          | € 80                   | \$ 90                       | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 26                  | € 22                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | 37.275                 | 32.812                      | 1.241                            | 0                                  | 1.241                                                | 0,38                    |
| CBK        | 07.2025          | € 238                  | \$ 278                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 249                 | € 218                       | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | € 31.885               | \$ 36.990                   | 0                                | (438)                              | (438)                                                | (0,13)                  |
|            | 08.2025          | \$ 36.990              | € 31.816                    | 438                              | 0                                  | 438                                                  | 0,13                    |
| MBC        | 07.2025          | € 146                  | \$ 168                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 557                 | € 482                       | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                             | \$ 4.012                         | \$ (540)                           | \$ 3.472                                             | 1,05                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu<br>erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD                              | 07.2025          | £ 25.884               | \$ 35.518                   | \$ 48                            | \$ 0                               | \$ 48                                                | 0,01                    |
|                                  | 08.2025          | \$ 35.523              | £ 25.884                    | 0                                | (48)                               | (48)                                                 | (0,01)                  |
| BRC                              | 07.2025          | £ 27.982               | \$ 38.072                   | 0                                | (273)                              | (273)                                                | (0,08)                  |
|                                  | 07.2025          | \$ 33.848              | £ 25.069                    | 506                              | 0                                  | 506                                                  | 0,15                    |
|                                  | 08.2025          | 37.952                 | 27.890                      | 272                              | 0                                  | 272                                                  | 0,08                    |
| CBK                              | 07.2025          | 274                    | 203                         | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | 37.063                 | 27.512                      | 637                              | 0                                  | 637                                                  | 0,19                    |
| MBC                              | 07.2025          | £ 153                  | \$ 208                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 2.027               | £ 1.496                     | 23                               | 0                                  | 23                                                   | 0,01                    |
| SSB                              | 07.2025          | £ 27.638               | \$ 37.897                   | 24                               | 0                                  | 24                                                   | 0,01                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 37.070              | £ 27.377                    | 447                              | 0                                  | 447                                                  | 0,14                    |
|                                  | 08.2025          | 37.902                 | 27.638                      | 0                                | (23)                               | (23)                                                 | (0,01)                  |
|                                  |                  |                        |                             | \$ 1.961                         | \$ (346)                           | \$ 1.615                                             | 0,49                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                             |                                  |                                    | \$ 2.505                                             | 0,76                    |

| BESCHREIBUNG                                                                       | PARI (000S) | MARKTWERT<br>(000S) | % DES<br>NETTOVERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------------|-------------|---------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b>                                         |             |                     |                              |
| ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC<br>2,700 % fällig am 11.06.2023 ^ | € 2.800     | \$ 493              | 0,15                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                          |             | \$ 493              | 0,15                         |
| Summe Anlagen                                                                      |             | \$ 366.801          | 111,28                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                        |             | \$ (37.197)         | (11,28)                      |
| Nettovermögen                                                                      |             | \$ 329.604          | 100,00                       |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

(j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,72 %):

| Emittentenbeschreibung                           | Kaufdatum               | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------|-------------------------|----------|-----------|----------------------|
| Corestate Capital Holding S.A.                   | 22.08.2023              | \$ 0     | \$ 0      | 0,00                 |
| DrillCo Holding Lux S.A.                         | 08.06.2023              | 1.233    | 1.264     | 0,39                 |
| Intelsat Emergence S.A.                          | 24.02.2020 - 01.05.2020 | 1.289    | 498       | 0,15                 |
| Spirit Aviation Holdings, Inc. - Exp. 11.03.2035 | 17.03.2025              | 19       | 11        | 0,00                 |
|                                                  |                         | \$ 2.541 | \$ 1.773  | 0,54                 |

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 879 USD (31. Dezember 2024: 514 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 12.190 USD (31. Dezember 2024: 11.918 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 580 USD (31. Dezember 2024: 1.490 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 2                                                               | \$ 332.668                                                | \$ 5.880                                               | \$ 338.550        |
| Investmentfonds                     | 25.742                                                             | 0                                                         | 0                                                      | 25.742            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (14)                                                               | 2.030                                                     | 0                                                      | 2.016             |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                  | 493                                                       | 0                                                      | 493               |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 25.730</b>                                                   | <b>\$ 335.191</b>                                         | <b>\$ 5.880</b>                                        | <b>\$ 366.801</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                               | \$ 283.018                                                | \$ 3.291                                               | \$ 286.309        |
| Investmentfonds               | 29.652                                                             | 0                                                         | 0                                                      | 29.652            |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                  | 2.600                                                     | 0                                                      | 2.600             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (131)                                                              | 7.094                                                     | 1                                                      | 6.964             |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 29.521</b>                                                   | <b>\$ 292.712</b>                                         | <b>\$ 3.292</b>                                        | <b>\$ 325.525</b> |

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

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

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

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BRC                                       | 1,500 %    | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (308)      | \$ (362)                                 | (0,11)               |
|                                           | 4,200      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (527)     | (539)                                    | (0,16)               |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                    |              | <b>\$ (901)</b>                          | <b>(0,27)</b>        |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.047                         | \$ (900)                           | \$ 147                          | \$ (12)                          | \$ 0                               | \$ (12)                         |
| BOA        | (845)                            | 580                                | (265)                           | (4)                              | 0                                  | (4)                             |
| BPS        | (51)                             | 0                                  | (51)                            | (20)                             | 0                                  | (20)                            |
| BRC        | 1.699                            | (1.680)                            | 19                              | (114)                            | 0                                  | (114)                           |
| BSH        | (20)                             | 0                                  | (20)                            | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| CBK        | (205)                            | 0                                  | (205)                           | 70                               | 0                                  | 70                              |
| DUB        | 1                                | 0                                  | 1                               | (641)                            | 590                                | (51)                            |
| FAR        | 1                                | 0                                  | 1                               | 73                               | 0                                  | 73                              |
| GLM        | (12)                             | 0                                  | (12)                            | 13                               | 0                                  | 13                              |
| GST        | 32                               | 0                                  | 32                              | 20                               | 0                                  | 20                              |
| JPM        | 512                              | (620)                              | (108)                           | 53                               | (30)                               | 23                              |
| MBC        | (3)                              | 0                                  | (3)                             | 102                              | 0                                  | 102                             |

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| MYC        | \$ (9)                              | \$ 0                                  | \$ (9)                          | \$ (24)                             | \$ 0                                  | \$ (24)                         |
| MYI        | 1                                   | (10)                                  | (9)                             | (4)                                 | (20)                                  | (24)                            |
| SCX        | 16                                  | 0                                     | 16                              | (1.024)                             | 900                                   | (124)                           |
| SOG        | (1)                                 | 0                                     | (1)                             | (11)                                | 0                                     | (11)                            |
| SSB        | 336                                 | (260)                                 | 76                              | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (10)                                | 0                                     | (10)                            |
| UAG        | 6                                   | 0                                     | 6                               | (7)                                 | 0                                     | (7)                             |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 37,74             | 38,08             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 32,77             | 32,17             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,26              | 0,38              |
| Investmentfonds                                                        | 5,38              | 7,31              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | k. A.             | 0,64              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,20              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,90              | 2,39              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,52              | 0,35              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,10              | k. A.             |
| Sonstige Aktiva                                                        | 21,13             | 18,68             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert   | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Angola                  | 0,18              | 0,20              |
| Argentinien             | 0,89              | 1,00              |
| Australien              | 0,91              | 0,44              |
| Aserbaidschan           | 0,24              | 0,27              |
| Belgien                 | 0,10              | k. A.             |
| Bermuda                 | 0,39              | 0,66              |
| Brasilien               | 0,75              | 0,57              |
| Bulgarien               | 0,23              | 0,13              |
| Kamerun                 | 0,13              | 0,13              |
| Kanada                  | 1,36              | 1,04              |
| Kaimaninseln            | 1,01              | 1,30              |
| Chile                   | 0,62              | 0,46              |
| China                   | 0,01              | 0,01              |
| Kolumbien               | 0,71              | 0,68              |
| Costa Rica              | 0,09              | 0,10              |
| Tschechische Republik   | 0,22              | 0,11              |
| Dänemark                | 0,30              | 0,29              |
| Dominikanische Republik | 0,34              | 0,38              |
| Ecuador                 | 0,53              | 0,46              |
| Ägypten                 | 0,97              | 0,60              |
| El Salvador             | 0,16              | 0,29              |
| Finnland                | 0,06              | 0,09              |
| Frankreich              | 2,70              | 1,89              |
| Gabun                   | 0,12              | k. A.             |
| Deutschland             | 1,24              | 1,01              |
| Ghana                   | 0,31              | 0,23              |
| Guatemala               | 0,26              | 0,28              |
| Guernsey, Kanalinseln   | 0,14              | k. A.             |
| Hongkong                | 0,21              | 0,20              |
| Ungarn                  | 0,79              | 0,68              |
| Indonesien              | 0,79              | 0,87              |
| International           | 0,01              | k. A.             |
| Irland                  | 6,25              | 5,78              |
| Insel Man               | 0,06              | 0,06              |
| Israel                  | 0,35              | 0,28              |
| Italien                 | 1,70              | 2,61              |
| Elfenbeinküste          | 0,45              | 0,51              |
| Japan                   | 0,22              | 0,27              |
| Jersey, Kanalinseln     | 0,24              | 0,45              |
| Kasachstan              | 0,17              | 0,19              |
| Kenia                   | 0,21              | 0,17              |
| Libanon                 | 0,07              | k. A.             |
| Liberia                 | 0,24              | 0,13              |
| Luxemburg               | 2,33              | 2,75              |
| Mazedonien              | k. A.             | 0,10              |
| Mexiko                  | 2,91              | 2,84              |
| Marokko                 | 0,08              | k. A.             |
| Multinational           | 0,28              | 0,11              |



| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Niederlande                                                                            | 1,54              | 1,81              |
| Nigeria                                                                                | 0,33              | 0,35              |
| Norwegen                                                                               | 0,16              | k. A.             |
| Oman                                                                                   | 0,22              | 0,24              |
| Pakistan                                                                               | 0,17              | 0,18              |
| Panama                                                                                 | 0,66              | 0,49              |
| Peru                                                                                   | 1,06              | 0,79              |
| Polen                                                                                  | 0,58              | 0,44              |
| Rumänien                                                                               | 0,69              | 0,78              |
| Saudi-Arabien                                                                          | 1,37              | 0,69              |
| Senegal                                                                                | 0,23              | 0,28              |
| Serbien                                                                                | 0,32              | 0,35              |
| Singapur                                                                               | 0,09              | 0,10              |
| Südafrika                                                                              | 1,07              | 0,78              |
| Spanien                                                                                | 0,66              | 0,57              |
| Sri Lanka                                                                              | 0,19              | 0,21              |
| Supranational                                                                          | 1,07              | 1,06              |
| Schweiz                                                                                | 0,37              | 0,39              |
| Türkei                                                                                 | 0,79              | 0,89              |
| Ukraine                                                                                | 0,40              | 0,57              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 0,58              | 0,72              |
| Großbritannien                                                                         | 4,83              | 4,10              |
| USA                                                                                    | 52,64             | 49,51             |
| Usbekistan                                                                             | 0,11              | 0,11              |
| Venezuela                                                                              | 0,24              | 0,22              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,01              | 0,30              |
| Investmentfonds                                                                        | 7,81              | 10,00             |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | k. A.             | 0,88              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,28              | (0,17)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,03              | 0,03              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,15              | 0,04              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,61)            | 2,97              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,00              | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | (0,02)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,79)            | 0,50              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,54              | (0,98)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,15              | k. A.             |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (11,28)           | (9,78)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|------------------------------------------------------|----------------|----------------|--------------------------|-------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                             |                |                |                          |       |
| ARGENTINIEN                                          |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Argentina Government International Bond              |                |                |                          |       |
| 3,500 % fällig am 09.07.2041                         | \$ 775         | \$ 482         | 0,92                     |       |
| AUSTRALIEN                                           |                |                |                          |       |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                     |                |                |                          |       |
| Latitude Australia Credit Card Master Trust          |                |                |                          |       |
| 0,000 % fällig am 23.11.2037 (a)                     | AUD 500        | 327            | 0,62                     |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                  |                |                |                          |       |
| 4,250 % fällig am 03.05.2030                         | € 125          | 153            | 0,29                     |       |
| Summe Australien                                     |                | 480            | 0,91                     |       |
| BRASILIEN                                            |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Banco BTG Pactual S.A.                               |                |                |                          |       |
| 2,750 % fällig am 11.01.2026                         | \$ 100         | 99             | 0,19                     |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Brazil Government International Bond                 |                |                |                          |       |
| 5,000 % fällig am 27.01.2045                         | 200            | 153            | 0,29                     |       |
| 6,125 % fällig am 22.01.2032                         | 200            | 204            | 0,39                     |       |
| 6,250 % fällig am 18.03.2031                         | 200            | 207            | 0,39                     |       |
|                                                      |                | 564            | 1,07                     |       |
| Summe Brasilien                                      |                | 663            | 1,26                     |       |
| BULGARIEN                                            |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Bulgaria Government International Bond               |                |                |                          |       |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038                         | € 50           | 60             | 0,11                     |       |
| 5,000 % fällig am 05.03.2037                         | \$ 76          | 74             | 0,14                     |       |
| Summe Bulgarien                                      |                | 134            | 0,25                     |       |
| KANADA                                               |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Air Canada Pass-Through Trust                        |                |                |                          |       |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030                         | 283            | 286            | 0,54                     |       |
| B.C. Unlimited Liability Co.                         |                |                |                          |       |
| 3,875 % fällig am 15.01.2028                         | 175            | 171            | 0,32                     |       |
| goeasy Ltd.                                          |                |                |                          |       |
| 7,625 % fällig am 01.07.2029                         | 100            | 103            | 0,20                     |       |
| Summe Kanada                                         |                | 560            | 1,06                     |       |
| KAIMANINSELN                                         |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                         |                |                |                          |       |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027                         | 75             | 72             | 0,14                     |       |
| Seagate HDD Cayman                                   |                |                |                          |       |
| 3,125 % fällig am 15.07.2029                         | 50             | 45             | 0,08                     |       |
| 5,750 % fällig am 01.12.2034                         | 200            | 198            | 0,38                     |       |
| Summe Kaimaninseln                                   |                | 315            | 0,60                     |       |
| CHILE                                                |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Chile Government International Bond                  |                |                |                          |       |
| 3,100 % fällig am 07.05.2041 (i)                     | 300            | 224            | 0,43                     |       |
| 4,850 % fällig am 22.01.2029                         | 100            | 101            | 0,19                     |       |
| Summe Chile                                          |                | 325            | 0,62                     |       |
| KOLUMBIEN                                            |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Colombia Government International Bond               |                |                |                          |       |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045                         | 200            | 136            | 0,26                     |       |
| 7,500 % fällig am 02.02.2034                         | 300            | 299            | 0,57                     |       |
| 8,000 % fällig am 14.11.2035                         | 200            | 201            | 0,38                     |       |
| Summe Kolumbien                                      |                | 636            | 1,21                     |       |
| COSTA RICA                                           |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Costa Rica Government International Bond             |                |                |                          |       |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043                         | 150            | 135            | 0,26                     |       |
| TSCHECHISCHE REPUBLIK                                |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| EPH Financing International A/S                      |                |                |                          |       |
| 5,875 % fällig am 30.11.2029                         | € 100          | \$ 126         | 0,24                     |       |
| DÄNEMARK                                             |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| TDC Net A/S                                          |                |                |                          |       |
| 5,618 % fällig am 06.02.2030                         | 300            | 375            | 0,71                     |       |
| DOMINIKANISCHE REPUBLIK                              |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Dominican Republic Government International Bond     |                |                |                          |       |
| 4,500 % fällig am 30.01.2030                         | \$ 100         | 95             | 0,18                     |       |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048                         | 200            | 190            | 0,36                     |       |
| 6,600 % fällig am 01.06.2036                         | 250            | 252            | 0,48                     |       |
| Summe Dominikanische Republik                        |                | 537            | 1,02                     |       |
| ECUADOR                                              |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Ecuador Government International Bond                |                |                |                          |       |
| 5,500 % fällig am 31.07.2035                         | 417            | 304            | 0,58                     |       |
| ÄGYPTEN                                              |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Egypt Government International Bond                  |                |                |                          |       |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031                         | € 400          | 437            | 0,83                     |       |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028                        | EGP 6.400      | 127            | 0,24                     |       |
| Summe Ägypten                                        |                | 564            | 1,07                     |       |
| EL SALVADOR                                          |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| El Salvador Government International Bond            |                |                |                          |       |
| 9,650 % fällig am 21.11.2054                         | \$ 125         | 129            | 0,24                     |       |
| FRANKREICH                                           |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Altice France S.A.                                   |                |                |                          |       |
| 11,500 % fällig am 01.02.2027 (h)                    | € 150          | 170            | 0,32                     |       |
| AXA S.A.                                             |                |                |                          |       |
| 5,500 % fällig am 11.07.2043                         | 100            | 129            | 0,24                     |       |
| BNP Paribas S.A.                                     |                |                |                          |       |
| 9,250 % fällig am 17.11.2027 (e)(g)                  | \$ 200         | 215            | 0,41                     |       |
| BPCE S.A.                                            |                |                |                          |       |
| 7,003 % fällig am 19.10.2034                         | 150            | 165            | 0,31                     |       |
| Credit Agricole S.A.                                 |                |                |                          |       |
| 3,750 % fällig am 23.01.2031                         | € 100          | 121            | 0,23                     |       |
| Electricite de France S.A.                           |                |                |                          |       |
| 4,625 % fällig am 07.05.2045                         | 100            | 115            | 0,22                     |       |
| 9,125 % fällig am 15.03.2033 (e)                     | \$ 125         | 141            | 0,27                     |       |
| Vilmorin & Cie S.A.                                  |                |                |                          |       |
| 1,375 % fällig am 26.03.2028                         | € 100          | 111            | 0,21                     |       |
| Summe Frankreich                                     |                | 1.167          | 2,21                     |       |
| DEUTSCHLAND                                          |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Amprion GmbH                                         |                |                |                          |       |
| 3,875 % fällig am 05.06.2036                         | 100            | 118            | 0,23                     |       |
| Commerzbank AG                                       |                |                |                          |       |
| 3,625 % fällig am 14.01.2032                         | 200            | 237            | 0,45                     |       |
| Deutsche Bank AG                                     |                |                |                          |       |
| 3,742 % fällig am 07.01.2033                         | \$ 200         | 180            | 0,34                     |       |
| DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH |                |                |                          |       |
| 4,875 % fällig am 21.08.2030                         | € 100          | 119            | 0,23                     |       |
| Eurogrid GmbH                                        |                |                |                          |       |
| 3,732 % fällig am 18.10.2035                         | 100            | 117            | 0,22                     |       |
| IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % bar oder 7,500 % PIK)  |                |                |                          |       |
| 6,750 % fällig am 15.11.2029 (b)                     | 100            | 123            | 0,23                     |       |
| ZF Finance GmbH                                      |                |                |                          |       |
| 2,000 % fällig am 06.05.2027                         | 100            | 111            | 0,21                     |       |
| Summe Deutschland                                    |                | 1.005          | 1,91                     |       |
| GHANA                                                |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Ghana Government International Bond                  |                |                |                          |       |
| 0,000 % fällig am 03.07.2026 (c)                     | \$ 8           | \$ 8           | 0,02                     |       |
| 0,000 % fällig am 03.01.2030 (c)                     | 20             | 17             | 0,03                     |       |
| 5,000 % fällig am 03.07.2029                         | 135            | 127            | 0,24                     |       |
| 5,000 % fällig am 03.07.2035                         | 122            | 95             | 0,18                     |       |
| Summe Ghana                                          |                | 247            | 0,47                     |       |
| UNGARN                                               |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Hungary Government International Bond                |                |                |                          |       |
| 2,125 % fällig am 22.09.2031                         | 200            | 167            | 0,32                     |       |
| 4,000 % fällig am 25.07.2029                         | € 125          | 151            | 0,28                     |       |
| 6,750 % fällig am 25.09.2052                         | \$ 200         | 204            | 0,39                     |       |
| Summe Ungarn                                         |                | 522            | 0,99                     |       |
| INDIEN                                               |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| ReNew Pvt Ltd.                                       |                |                |                          |       |
| 5,875 % fällig am 05.03.2027                         | 275            | 273            | 0,52                     |       |
| Shriram Finance Ltd.                                 |                |                |                          |       |
| 6,625 % fällig am 22.04.2027                         | 100            | 101            | 0,19                     |       |
| Summe Indien                                         |                | 374            | 0,71                     |       |
| INDONESIEN                                           |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia                   |                |                |                          |       |
| 4,700 % fällig am 06.06.2032                         | 500            | 502            | 0,95                     |       |
| IRLAND                                               |                |                |                          |       |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                     |                |                |                          |       |
| Cumulus Static CLO DAC                               |                |                |                          |       |
| 3,343 % fällig am 15.11.2033                         | € 439          | 516            | 0,98                     |       |
| Rockford Tower Europe CLO DAC                        |                |                |                          |       |
| 3,561 % fällig am 24.04.2037                         | 500            | 587            | 1,12                     |       |
| SCF Rahoituspalvelut DAC                             |                |                |                          |       |
| 2,479 % fällig am 25.06.2034                         | 162            | 191            | 0,36                     |       |
|                                                      |                | 1.294          | 2,46                     |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Bank of Ireland Group PLC                            |                |                |                          |       |
| 6,253 % fällig am 16.09.2026                         | \$ 200         | 200            | 0,38                     |       |
| Perrigo Finance Unlimited Co.                        |                |                |                          |       |
| 4,900 % fällig am 15.06.2030                         | 200            | 197            | 0,37                     |       |
| Smurfit Kappa Treasury ULC                           |                |                |                          |       |
| 5,200 % fällig am 15.01.2030                         | 200            | 204            | 0,39                     |       |
|                                                      |                | 601            | 1,14                     |       |
| Summe Irland                                         |                | 1.895          | 3,60                     |       |
| ITALIEN                                              |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Intesa Sanpaolo SpA                                  |                |                |                          |       |
| 3,625 % fällig am 16.10.2030                         | € 150          | 181            | 0,35                     |       |
| 8,248 % fällig am 21.11.2033                         | \$ 50          | 58             | 0,11                     |       |
| Nexi SpA                                             |                |                |                          |       |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029                         | € 100          | 112            | 0,21                     |       |
| Telecom Italia SpA                                   |                |                |                          |       |
| 7,875 % fällig am 31.07.2028                         | 100            | 132            | 0,25                     |       |
| Summe Italien                                        |                | 483            | 0,92                     |       |
| ELFENBEINKÜSTE                                       |                |                |                          |       |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                |                          |       |
| Ivory Coast Government International Bond            |                |                |                          |       |
| 6,125 % fällig am 15.06.2033                         | \$ 100         | 91             | 0,17                     |       |
| 7,625 % fällig am 30.01.2033                         | 200            | 198            | 0,38                     |       |
| Summe Elfenbeinküste                                 |                | 289            | 0,55                     |       |
| JAPAN                                                |                |                |                          |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                |                          |       |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.                 |                |                |                          |       |
| 5,475 % fällig am 22.02.2031                         | 200            | 208            | 0,39                     |       |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>BESCHREIBUNG</b>                                                             |                |                          |                                   |
| Mizuho Financial Group, Inc.<br>3,490 % fällig am 05.09.2027                    | € 200          | \$ 240                   | 0,46                              |
| Norinchukin Bank<br>5,094 % fällig am 16.10.2029                                | \$ 100         | 102                      | 0,19                              |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>2,472 % fällig am 14.01.2029           | 100            | 94                       | 0,18                              |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.<br>5,500 % fällig am 09.03.2028                 | 200            | 206                      | 0,39                              |
| Summe Japan                                                                     |                | 850                      | 1,61                              |
| <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Aston Martin Capital Holdings Ltd.<br>10,000 % fällig am 31.03.2029             | 50             | 47                       | 0,09                              |
| Heathrow Funding Ltd.<br>3,875 % fällig am 16.01.2038                           | € 150          | 174                      | 0,33                              |
| Summe Jersey, Kanalinseln                                                       |                | 221                      | 0,42                              |
| <b>KASACHSTAN</b>                                                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Kazakhstan Government International Bond<br>6,500 % fällig am 21.07.2045        | \$ 200         | 214                      | 0,41                              |
| <b>KENIA</b>                                                                    |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Republic of Kenya Government International Bond<br>9,500 % fällig am 05.03.2036 | 200            | 189                      | 0,36                              |
| <b>LIBERIA</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>4,250 % fällig am 01.07.2026                    | 350            | 348                      | 0,66                              |
| <b>LUXEMBURG</b>                                                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Logicor Financing SARL<br>1,625 % fällig am 17.01.2030                          | € 200          | 216                      | 0,41                              |
| P3 Group SARL<br>4,000 % fällig am 19.04.2032                                   | 100            | 118                      | 0,22                              |
| Summe Luxemburg                                                                 |                | 334                      | 0,63                              |
| <b>MEXIKO</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Mexico Government International Bond<br>4,875 % fällig am 19.05.2033            | \$ 200         | 189                      | 0,36                              |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110                                                    | 175            | 139                      | 0,26                              |
| 6,400 % fällig am 07.05.2054                                                    | 75             | 69                       | 0,13                              |
| Summe Mexiko                                                                    |                | 397                      | 0,75                              |
| <b>MAROKKO</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Morocco Government International Bond<br>3,000 % fällig am 15.12.2032           | 200            | 170                      | 0,32                              |
| <b>MULTINATIONAL</b>                                                            |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| American Airlines, Inc.<br>5,750 % fällig am 20.04.2029                         | 100            | 100                      | 0,19                              |
| JetBlue Airways Corp.<br>9,875 % fällig am 20.09.2031                           | 50             | 49                       | 0,09                              |
| NXP BV<br>5,350 % fällig am 01.03.2026                                          | 50             | 50                       | 0,10                              |
| Summe multinational                                                             |                | 199                      | 0,38                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Coöperatieve Rabobank UA<br>3,758 % fällig am 06.04.2033                        | 300            | 280                      | 0,53                              |
| Digital Dutch Finco BV<br>1,000 % fällig am 15.01.2032                          | € 200          | 200                      | 0,38                              |
| EnBW International Finance BV<br>3,750 % fällig am 20.11.2035                   | 150            | 177                      | 0,34                              |
| <b>BESCHREIBUNG</b>                                                             |                |                          |                                   |
| Enel Finance International NV<br>2,500 % fällig am 12.07.2031                   | \$ 350         | \$ 307                   | 0,58                              |
| <b>IPD BV</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| 5,350 % fällig am 15.06.2031                                                    | € 125          | 147                      | 0,28                              |
| JDE Peet's NV<br>2,250 % fällig am 24.09.2031                                   | \$ 50          | 43                       | 0,08                              |
| Sandoz Finance BV<br>3,250 % fällig am 12.09.2029                               | € 100          | 119                      | 0,23                              |
| Universal Music Group NV<br>4,000 % fällig am 13.06.2031                        | 100            | 122                      | 0,23                              |
| Wabtec Transportation Netherlands BV<br>1,250 % fällig am 03.12.2027            | 50             | 57                       | 0,11                              |
| Summe Niederlande                                                               |                | 1.452                    | 2,76                              |
| <b>NORWEGEN</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Norsk Hydro ASA<br>3,625 % fällig am 23.01.2032                                 | 100            | 118                      | 0,22                              |
| <b>OMAN</b>                                                                     |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Oman Government International Bond<br>6,750 % fällig am 17.01.2048              | \$ 200         | 207                      | 0,39                              |
| <b>PANAMA</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Carnival Corp.<br>4,000 % fällig am 01.08.2028                                  | 100            | 98                       | 0,18                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Panama Government International Bond<br>6,700 % fällig am 26.01.2036            | 575            | 573                      | 1,09                              |
| Summe Panama                                                                    |                | 671                      | 1,27                              |
| <b>PARAGUAY</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Paraguay Government International Bond<br>5,400 % fällig am 30.03.2050          | 100            | 86                       | 0,16                              |
| <b>PERU</b>                                                                     |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.<br>9,700 % fällig am 05.03.2045    | PEN 500        | 147                      | 0,28                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Peru Government International Bond<br>3,000 % fällig am 15.01.2034              | \$ 200         | 169                      | 0,32                              |
| 3,300 % fällig am 11.03.2041                                                    | 300            | 223                      | 0,42                              |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032                                                    | PEN 300        | 88                       | 0,17                              |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033                                                    | 500            | 154                      | 0,29                              |
|                                                                                 |                | 634                      | 1,20                              |
| Summe Peru                                                                      |                | 781                      | 1,48                              |
| <b>PHILIPPINEN</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Philippines Government International Bond<br>5,500 % fällig am 17.01.2048       | \$ 250         | 243                      | 0,46                              |
| <b>POLEN</b>                                                                    |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Poland Government International Bond<br>3,625 % fällig am 11.01.2034            | € 250          | 301                      | 0,57                              |
| 4,875 % fällig am 04.10.2033                                                    | \$ 125         | 124                      | 0,24                              |
| 5,500 % fällig am 18.03.2054                                                    | 200            | 186                      | 0,35                              |
| Summe Polen                                                                     |                | 611                      | 1,16                              |
| <b>RUMÄNIEN</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Romania Government International Bond<br>1,750 % fällig am 13.07.2030           | € 100          | 101                      | 0,19                              |
| 5,250 % fällig am 30.05.2032                                                    | 50             | 58                       | 0,11                              |
| 5,625 % fällig am 22.02.2036                                                    | 200            | 223                      | 0,42                              |
| 5,625 % fällig am 30.05.2037                                                    | 75             | 83                       | 0,16                              |
| <b>BESCHREIBUNG</b>                                                             |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 27.09.2029                                                    | € 75           | \$ 95                    | 0,18                              |
| Summe Rumänien                                                                  |                | 560                      | 1,06                              |
| <b>SENEGAL</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Senegal Government International Bond<br>4,750 % fällig am 13.03.2028           | 100            | 93                       | 0,17                              |
| 5,375 % fällig am 08.06.2037                                                    | 100            | 73                       | 0,14                              |
| Summe Senegal                                                                   |                | 166                      | 0,31                              |
| <b>SERBIEN</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Serbia Government International Bond<br>1,650 % fällig am 03.03.2033            | 200            | 193                      | 0,37                              |
| <b>SINGAPUR</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                         |                |                          |                                   |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.<br>5,781 % fällig am 11.04.2043        | \$ 230         | 230                      | 0,44                              |
| <b>SÜDAFRIKA</b>                                                                |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| South Africa Government International Bond<br>4,850 % fällig am 30.09.2029      | 260            | 251                      | 0,48                              |
| 5,650 % fällig am 27.09.2047                                                    | 60             | 45                       | 0,09                              |
| 5,750 % fällig am 30.09.2049                                                    | 240            | 181                      | 0,34                              |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030                                                    | ZAR 700        | 39                       | 0,07                              |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035                                                    | 4.200          | 220                      | 0,42                              |
| Summe Südafrika                                                                 |                | 736                      | 1,40                              |
| <b>SPANIEN</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Abertis Infraestructuras S.A.<br>3,375 % fällig am 27.11.2026                   | £ 100          | 134                      | 0,26                              |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>6,138 % fällig am 14.09.2028            | \$ 200         | 207                      | 0,39                              |
| CaixaBank S.A.<br>3,750 % fällig am 07.09.2029                                  | € 100          | 122                      | 0,23                              |
| 6,840 % fällig am 13.09.2034                                                    | \$ 100         | 110                      | 0,21                              |
| Grifols S.A.<br>2,250 % fällig am 15.11.2027                                    | € 50           | 58                       | 0,11                              |
| Summe Spanien                                                                   |                | 631                      | 1,20                              |
| <b>SRI LANKA</b>                                                                |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Sri Lanka Government International Bond<br>3,100 % fällig am 15.01.2030         | \$ 41          | 37                       | 0,07                              |
| 3,350 % fällig am 15.03.2033                                                    | 81             | 66                       | 0,12                              |
| 3,600 % fällig am 15.06.2035                                                    | 55             | 38                       | 0,07                              |
| 3,600 % fällig am 15.05.2036                                                    | 38             | 31                       | 0,06                              |
| 3,600 % fällig am 15.02.2038                                                    | 76             | 62                       | 0,12                              |
| 4,000 % fällig am 15.04.2028                                                    | 43             | 41                       | 0,08                              |
| Summe Sri Lanka                                                                 |                | 275                      | 0,52                              |
| <b>SUPRANATIONAL</b>                                                            |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                |                          |                                   |
| Europäische Union<br>3,375 % fällig am 04.10.2039                               | € 100          | 116                      | 0,22                              |
| <b>SCHWEDEN</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| EQT AB<br>0,875 % fällig am 14.05.2031                                          | 300            | 305                      | 0,58                              |
| <b>SCHWEIZ</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| UBS Group AG<br>3,091 % fällig am 14.05.2032                                    | \$ 250         | 227                      | 0,43                              |
| <b>TÜRKIE</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                         |                |                          |                                   |
| Türkiye Varlık Fonu Yonetimi A/S<br>8,250 % fällig am 14.02.2029                | 200            | 210                      | 0,40                              |

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   |
| Turkey Government International Bond           |                |                          |                                   | American Tower Corp.                                   |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 15.06.2027                       | \$ 100         | \$ 104                   | 0,20                              |
| 9,125 % fällig am 13.07.2030                   | \$ 400         | \$ 444                   | 0,84                              | 2,950 % fällig am 15.01.2051                           | \$ 200         | \$ 127                   | 0,24                              | HCA, Inc.                                          |                |                          |                                   |
| Summe Türkei                                   |                | 654                      | 1,24                              | 4,300 % fällig am 15.02.2030                           | 175            | 175                      | 0,33                              | 4,125 % fällig am 15.06.2029                       | 150            | 147                      | 0,28                              |
| <b>UKRAINE</b>                                 |                |                          |                                   | <b>UKRAINE</b>                                         |                |                          |                                   | Hilton Domestic Operating Co., Inc.                |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 15.02.2032                       | 200            | 181                      | 0,34                              |
| Ukraine Government International Bond          |                |                          |                                   | Avantor Funding, Inc.                                  |                |                          |                                   | Hologic, Inc.                                      |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 01.02.2030                   | 13             | 6                        | 0,01                              | 3,875 % fällig am 01.11.2029                           | 200            | 190                      | 0,36                              | 3,250 % fällig am 15.02.2029                       | 100            | 95                       | 0,18                              |
| 0,000 % fällig am 01.02.2034                   | 49             | 19                       | 0,03                              | Axalta Coating Systems LLC                             |                |                          |                                   | Host Hotels & Resorts LP                           |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 01.02.2035                   | 41             | 20                       | 0,04                              | 3,375 % fällig am 15.02.2029                           | 200            | 190                      | 0,36                              | 2,900 % fällig am 15.12.2031                       | 250            | 219                      | 0,42                              |
| 0,000 % fällig am 01.02.2036                   | 34             | 16                       | 0,03                              | Ball Corp.                                             |                |                          |                                   | IHG Finance LLC                                    |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 01.08.2041                   | 48             | 35                       | 0,07                              | 2,875 % fällig am 15.08.2030                           | 200            | 180                      | 0,34                              | 3,625 % fällig am 27.09.2031                       | € 100          | 118                      | 0,22                              |
| 1,750 % fällig am 01.02.2034                   | 79             | 41                       | 0,08                              | Bank of America Corp.                                  |                |                          |                                   | Ingevity Corp.                                     |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 01.02.2035                   | 84             | 43                       | 0,08                              | 5,288 % fällig am 25.04.2034                           | 50             | 51                       | 0,10                              | 3,875 % fällig am 01.11.2028                       | \$ 50          | 48                       | 0,09                              |
| 1,750 % fällig am 01.02.2036                   | 76             | 38                       | 0,07                              | 6,204 % fällig am 10.11.2028                           | 100            | 104                      | 0,20                              | IQVIA, Inc.                                        |                |                          |                                   |
| Summe Ukraine                                  |                | 218                      | 0,41                              | Bank of New York Mellon Corp.                          |                |                          |                                   | 2,250 % fällig am 15.01.2028                       | € 250          | 286                      | 0,54                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                         |                |                          |                                   | 4,706 % fällig am 01.02.2034                           | 50             | 49                       | 0,09                              | JPMorgan Chase & Co.                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | Block, Inc.                                            |                |                          |                                   | 2,580 % fällig am 22.04.2032                       | \$ 500         | 447                      | 0,85                              |
| Atlantica Sustainable Infrastructure Ltd.      |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.06.2031                           | 125            | 115                      | 0,22                              | Kilroy Realty LP                                   |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 15.06.2028                   | 250            | 239                      | 0,45                              | 6,500 % fällig am 15.05.2032                           | 125            | 129                      | 0,25                              | 2,650 % fällig am 15.11.2033                       | 200            | 157                      | 0,30                              |
| Barclays PLC                                   |                |                          |                                   | Brown & Brown, Inc.                                    |                |                          |                                   | Kraft Heinz Foods Co.                              |                |                          |                                   |
| 7,437 % fällig am 02.11.2033                   | 200            | 227                      | 0,43                              | 5,250 % fällig am 23.06.2032                           | 50             | 51                       | 0,10                              | 6,500 % fällig am 09.02.2040                       | 100            | 107                      | 0,20                              |
| Berkeley Group PLC                             |                |                          |                                   | Builders FirstSource, Inc.                             |                |                          |                                   | Ladder Capital Finance Holdings LLLP               |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 11.08.2031                   | £ 100          | 115                      | 0,22                              | 4,250 % fällig am 01.02.2032                           | 200            | 185                      | 0,35                              | 5,500 % fällig am 01.08.2030 (a)                   | 75             | 76                       | 0,14                              |
| British Telecommunications PLC                 |                |                          |                                   | Carvana Co. (13,000 % PIK)                             |                |                          |                                   | Lamb Weston Holdings, Inc.                         |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 20.01.2034                   | € 100          | 120                      | 0,23                              | 13,000 % fällig am 01.06.2030 (b)                      | 100            | 105                      | 0,20                              | 4,375 % fällig am 31.01.2032                       | 200            | 188                      | 0,36                              |
| HSBC Holdings PLC                              |                |                          |                                   | CCO Holdings LLC                                       |                |                          |                                   | Level 3 Financing, Inc.                            |                |                          |                                   |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030                   | \$ 100         | 97                       | 0,18                              | 4,500 % fällig am 01.05.2032                           | 75             | 70                       | 0,13                              | 11,000 % fällig am 15.11.2029                      | 50             | 58                       | 0,11                              |
| 5,733 % fällig am 17.05.2032                   | 50             | 52                       | 0,10                              | Centene Corp.                                          |                |                          |                                   | LPL Holdings, Inc.                                 |                |                          |                                   |
| Land Securities Capital Markets PLC            |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.03.2031                           | 100            | 86                       | 0,16                              | 4,000 % fällig am 15.03.2029                       | 50             | 49                       | 0,09                              |
| 4,875 % fällig am 15.09.2034                   | £ 100          | 137                      | 0,26                              | Charter Communications Operating LLC                   |                |                          |                                   | Marvell Technology, Inc.                           |                |                          |                                   |
| Marex Group PLC                                |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 30.06.2062                           | 200            | 129                      | 0,24                              | 4,875 % fällig am 22.06.2028                       | 50             | 51                       | 0,10                              |
| 5,829 % fällig am 08.05.2028                   | \$ 50          | 51                       | 0,10                              | Chobani LLC                                            |                |                          |                                   | Moody's Corp.                                      |                |                          |                                   |
| Marks & Spencer PLC                            |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.11.2028                           | 300            | 295                      | 0,56                              | 2,000 % fällig am 19.08.2031                       | 225            | 195                      | 0,37                              |
| 4,500 % fällig am 10.07.2027                   | £ 100          | 133                      | 0,25                              | Citigroup, Inc.                                        |                |                          |                                   | Morgan Stanley                                     |                |                          |                                   |
| National Grid PLC                              |                |                          |                                   | 5,449 % fällig am 11.06.2035                           | 75             | 77                       | 0,15                              | 5,192 % fällig am 17.04.2031                       | 100            | 103                      | 0,20                              |
| 3,875 % fällig am 16.01.2029                   | € 300          | 364                      | 0,69                              | Clearway Energy Operating LLC                          |                |                          |                                   | 5,831 % fällig am 19.04.2035                       | 200            | 210                      | 0,40                              |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.02.2031                           | 275            | 253                      | 0,48                              | MSCI, Inc.                                         |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 05.04.2032 (c)               | \$ 125         | 89                       | 0,17                              | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.                  |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 01.09.2030                       | 50             | 47                       | 0,09                              |
| Seymour Trent Utilities Finance PLC            |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.04.2032                           | 75             | 77                       | 0,15                              | 3,875 % fällig am 15.02.2031                       | 75             | 71                       | 0,13                              |
| 3,875 % fällig am 04.08.2035                   | € 100          | 118                      | 0,22                              | Community Health Systems, Inc.                         |                |                          |                                   | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. |                |                          |                                   |
| SSE PLC                                        |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.02.2031                           | 50             | 43                       | 0,08                              | 1,350 % fällig am 15.03.2031                       | 200            | 168                      | 0,32                              |
| 3,500 % fällig am 18.03.2032                   | 100            | 119                      | 0,23                              | Coty, Inc.                                             |                |                          |                                   | Newell Brands, Inc.                                |                |                          |                                   |
| United Utilities Water Finance PLC             |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.04.2026                           | 59             | 59                       | 0,11                              | 8,500 % fällig am 01.06.2028                       | 75             | 79                       | 0,15                              |
| 3,500 % fällig am 27.02.2033                   | 100            | 117                      | 0,22                              | Credit Acceptance Corp.                                |                |                          |                                   | OneMain Finance Corp.                              |                |                          |                                   |
| Virgin Media Secured Finance PLC               |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 15.03.2030                           | 50             | 51                       | 0,10                              | 3,500 % fällig am 15.01.2027                       | 50             | 49                       | 0,09                              |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030                   | £ 100          | 124                      | 0,24                              | Crocs, Inc.                                            |                |                          |                                   | Open Text Holdings, Inc.                           |                |                          |                                   |
| Vmed O2 UK Financing PLC                       |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.03.2029                           | 50             | 48                       | 0,09                              | 4,125 % fällig am 15.02.2030                       | 100            | 95                       | 0,18                              |
| 4,500 % fällig am 15.07.2031                   | 200            | 246                      | 0,47                              | Crown Castle, Inc.                                     |                |                          |                                   | Oracle Corp.                                       |                |                          |                                   |
| Vodafone Group PLC                             |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 15.07.2031                           | 150            | 131                      | 0,25                              | 4,700 % fällig am 27.09.2034                       | 75             | 73                       | 0,14                              |
| 5,125 % fällig am 04.06.2081                   | \$ 300         | 228                      | 0,43                              | CVS Health Corp.                                       |                |                          |                                   | Organon & Co.                                      |                |                          |                                   |
| Summe Großbritannien                           |                | 2.576                    | 4,89                              | 3,750 % fällig am 01.04.2030                           | 75             | 72                       | 0,14                              | 2,875 % fällig am 30.04.2028                       | € 200          | 229                      | 0,43                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                          |                |                          |                                   | Elanco Animal Health, Inc.                             |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 30.04.2028                       | \$ 50          | 48                       | 0,09                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>        |                |                          |                                   | Elevance Health, Inc.                                  |                |                          |                                   | Pacific Gas & Electric Co.                         |                |                          |                                   |
| GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust      |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 15.02.2035                           | 50             | 51                       | 0,10                              | 6,700 % fällig am 01.04.2053                       | 225            | 226                      | 0,43                              |
| 5,520 % fällig am 22.02.2055                   | \$ 83          | 80                       | 0,15                              | Equinix, Inc.                                          |                |                          |                                   | Panther Escrow Issuer LLC                          |                |                          |                                   |
| Option One Mortgage Loan Trust                 |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 15.05.2031                           | 150            | 133                      | 0,25                              | 7,125 % fällig am 01.06.2031                       | 75             | 78                       | 0,15                              |
| 4,934 % fällig am 25.07.2036                   | 240            | 138                      | 0,26                              | Ford Motor Co.                                         |                |                          |                                   | Park Intermediate Holdings LLC                     |                |                          |                                   |
| Summe USA                                      |                | 218                      | 0,41                              | 3,250 % fällig am 12.02.2032                           | 175            | 148                      | 0,28                              | 4,875 % fällig am 15.05.2029                       | 100            | 97                       | 0,18                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC |                |                          |                                   | PennyMac Financial Services, Inc.                  |                |                          |                                   |
| AES Corp.                                      |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 15.04.2033                           | 100            | 99                       | 0,19                              | 7,875 % fällig am 15.12.2029                       | 100            | 106                      | 0,20                              |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031                   | 250            | 219                      | 0,42                              | Freedom Mortgage Holdings LLC                          |                |                          |                                   | Post Holdings, Inc.                                |                |                          |                                   |
| Albertsons Cos., Inc.                          |                |                          |                                   | 9,125 % fällig am 15.05.2031                           | 100            | 103                      | 0,20                              | 5,500 % fällig am 15.12.2029                       | 150            | 149                      | 0,28                              |
| 3,500 % fällig am 15.03.2029                   | 100            | 95                       | 0,18                              | Frontier Communications Holdings LLC                   |                |                          |                                   | Quanta Services, Inc.                              |                |                          |                                   |
| Ally Financial, Inc.                           |                |                          |                                   | 8,750 % fällig am 15.05.2030                           | 73             | 76                       | 0,14                              | 2,350 % fällig am 15.01.2032                       | 200            | 172                      | 0,33                              |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031                   | 140            | 158                      | 0,30                              | Global Medical Response, Inc. (9,500 % PIK)            |                |                          |                                   | QXO Building Products, Inc.                        |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 31.10.2028 (b)                       | 51             | 51                       | 0,10                              | 6,750 % fällig am 30.04.2032                       | 50             | 52                       | 0,10                              |
|                                                |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                              |                |                          |                                   | Radian Group, Inc.                                 |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | 3,102 % fällig am 24.02.2033                           | 100            | 90                       | 0,17                              | 6,200 % fällig am 15.05.2029                       | 100            | 104                      | 0,20                              |
|                                                |                |                          |                                   | 5,330 % fällig am 23.07.2035                           | 75             | 76                       | 0,14                              | Raven Acquisition Holdings LLC                     |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc.            |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.11.2031                       | 100            | 100                      | 0,19                              |
|                                                |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 01.07.2034                           | 75             | 75                       | 0,14                              | Realty Income Corp.                                |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | Haleon U.S. Capital LLC                                |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 15.04.2035                       | 75             | 75                       | 0,14                              |
|                                                |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 24.03.2029                           | 100            | 97                       | 0,18                              | Rocket Cos., Inc.                                  |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | HAT Holdings LLC                                       |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 01.08.2030                       | 125            | 127                      | 0,24                              |
|                                                |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 15.06.2026                           | 50             | 49                       | 0,09                              | Santander Holdings USA, Inc.                       |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   |                                                        |                |                          |                                   | 5,473 % fällig am 20.03.2029                       | 75             | 76                       | 0,14                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,807 % fällig am 09.09.2026 \$                                         | 100            | \$ 100                   | 0,19                              | Walgreens Boots Alliance, Inc.<br>2,125 % fällig am 20.11.2026 €                         | 100            | \$ 116                   | 0,22                              | <b>US-SCHATZ OBLIGATIONEN</b>                                                 |                |                          |                                   |
| SBA Tower Trust<br>4,831 % fällig am 15.10.2029                         | 200            | 200                      | 0,38                              | Warnermedia Holdings, Inc.<br>4,279 % fällig am 15.03.2032 \$                            | 50             | 42                       | 0,08                              | U.S. Treasury Bonds<br>3,875 % fällig am 15.05.2043 \$                        | 500            | \$ 447                   | 0,85                              |
| Sirius XM Radio LLC<br>3,875 % fällig am 01.09.2031                     | 50             | 44                       | 0,08                              | Wayfair LLC<br>7,250 % fällig am 31.10.2029                                              | 50             | 34                       | 0,06                              | 4,000 % fällig am 15.11.2042                                                  | 75             | 68                       | 0,13                              |
| SLM Corp.<br>3,125 % fällig am 02.11.2026                               | 150            | 147                      | 0,28                              | Windstream Services LLC<br>8,250 % fällig am 01.10.2031                                  | 50             | 52                       | 0,10                              | 4,125 % fällig am 15.08.2044                                                  | 900            | 825                      | 1,56                              |
| Snap, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.03.2033                              | 100            | 103                      | 0,20                              | Wisconsin Power & Light Co.<br>4,950 % fällig am 01.04.2033                              | 100            | 100                      | 0,19                              |                                                                               |                | 1.340                    | 2,54                              |
| Solar Star Funding LLC<br>5,375 % fällig am 30.06.2035                  | 240            | 247                      | 0,47                              | WMG Acquisition Corp.<br>2,250 % fällig am 15.08.2031 €                                  | 200            | 218                      | 0,41                              | Summe USA                                                                     |                | 18.993                   | 36,04                             |
| Southern California Edison Co.<br>2,500 % fällig am 01.06.2031          | 500            | 434                      | 0,82                              | Yum! Brands, Inc.<br>4,625 % fällig am 31.01.2032 \$                                     | 100            | 96                       | 0,18                              | <b>URUGUAY</b>                                                                |                |                          |                                   |
| Sprint Capital Corp.<br>8,750 % fällig am 15.03.2032                    | 150            | 182                      | 0,35                              |                                                                                          |                | 13.738                   | 26,07                             | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                       |                |                          |                                   |
| Standard Industries, Inc.<br>4,375 % fällig am 15.07.2030               | 200            | 190                      | 0,36                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                                |                |                          |                                   | Uruguay Government International Bond<br>5,100 % fällig am 18.06.2050         | 300            | 278                      | 0,53                              |
| Starwood Property Trust, Inc.<br>6,500 % fällig am 15.10.2030           | 100            | 104                      | 0,20                              | GBT U.S. LLC<br>6,783 % fällig am 28.07.2031                                             | 100            | 100                      | 0,19                              | <b>USBEKISTAN</b>                                                             |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 01.04.2029                                            | 50             | 53                       | 0,10                              | LifePoint Health, Inc.<br>8,006 % fällig am 19.05.2031                                   | 100            | 98                       | 0,19                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                       |                |                          |                                   |
| TerraForm Power Operating LLC<br>5,000 % fällig am 01.06.2028           | 200            | 198                      | 0,38                              |                                                                                          |                | 198                      | 0,38                              | Republic of Uzbekistan International Bond<br>5,375 % fällig am 29.05.2027 €   | 100            | 120                      | 0,23                              |
| Topaz Solar Farms LLC<br>5,750 % fällig am 30.09.2039                   | 176            | 173                      | 0,33                              | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                                    |                |                          |                                   | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                                               |                |                          |                                   |
| TopBuild Corp.<br>3,625 % fällig am 15.03.2029                          | 250            | 237                      | 0,45                              | Downey Savings & Loan Association Mortgage<br>Loan Trust<br>5,272 % fällig am 19.09.2044 | 23             | 22                       | 0,04                              | <b>U.S. TREASURY BILLS</b>                                                    |                |                          |                                   |
| Travel & Leisure Co.<br>4,625 % fällig am 01.03.2030                    | 100            | 96                       | 0,18                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                                             |                |                          |                                   | 4,297 % fällig am<br>25.09.2025 (c)(d)                                        | \$ 600         | 594                      | 1,13                              |
| Twilio, Inc.<br>3,875 % fällig am 15.03.2031                            | 125            | 117                      | 0,22                              | Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,500 % fällig am 01.09.2053                         | 97             | 93                       | 0,18                              | 4,304 % fällig am<br>31.07.2025 (c)(d)                                        | 1.300          | 1.296                    | 2,46                              |
| UKG, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.02.2031                               | 75             | 78                       | 0,15                              | 5,000 % fällig am<br>01.09.2053 - 01.10.2053                                             | 730            | 718                      | 1,36                              | 4,347 % fällig am<br>14.10.2025 (c)(d)                                        | 700            | 691                      | 1,31                              |
| United Rentals North America, Inc.<br>3,875 % fällig am 15.02.2031      | 200            | 188                      | 0,36                              | 5,500 % fällig am 01.12.2053                                                             | 455            | 456                      | 0,87                              | Summe kurzfristige Instrumente                                                |                | 2.581                    | 4,90                              |
| Univision Communications, Inc.<br>8,500 % fällig am 31.07.2031          | 50             | 50                       | 0,10                              | 6,000 % fällig am 01.10.2053                                                             | 77             | 79                       | 0,15                              | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>                                         | \$             | 48.355                   | 91,76                             |
| Verizon Communications, Inc.<br>1,500 % fällig am 18.09.2030            | 50             | 43                       | 0,08                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>4,000 % fällig am 01.08.2055                    | 500            | 465                      | 0,88                              | <b>AKTIEN</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| 2,850 % fällig am 03.09.2041                                            | 100            | 71                       | 0,13                              | 4,500 % fällig am 01.07.2055                                                             | 200            | 191                      | 0,36                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                                                        |                |                          |                                   |
| VMware LLC<br>2,200 % fällig am 15.08.2031                              | 200            | 174                      | 0,33                              | 5,000 % fällig am 01.08.2055                                                             | 500            | 490                      | 0,93                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,350 % fällig am 27.03.2030 | 125            | 127                      | 0,24                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                                                             | 400            | 406                      | 0,77                              | PIMCO Funds: Global<br>Investors Series plc -<br>PIMCO ESG Income<br>Fund (f) | 486.295        | 5.155                    | 9,78                              |
|                                                                         |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.08.2055                                                             | 561            | 579                      | 1,10                              | Summe Investmentfonds                                                         | \$             | 5.155                    | 9,78                              |
|                                                                         |                |                          |                                   |                                                                                          |                | 3.477                    | 6,60                              |                                                                               |                |                          |                                   |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Canada Government 10-Year Bond September Futures               | Long  | 09.2025     | 4                       | \$ 3                                            | 0,01                    |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Short | 09.2025     | 6                       | 4                                               | 0,01                    |
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 3                       | 0                                               | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09.2025     | 1                       | 1                                               | 0,00                    |
| Euro-OAT September Futures                                     | Short | 09.2025     | 1                       | 1                                               | 0,00                    |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 2                       | (1)                                             | 0,00                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 24                      | 9                                               | 0,02                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 34                      | 37                                              | 0,07                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 3                       | 6                                               | 0,01                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 4                       | 9                                               | 0,02                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Short | 09.2025     | 1                       | (2)                                             | (0,01)                  |
|                                                                |       |             |                         | \$ 67                                           | 0,13                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                         | \$ 67                                           | 0,13                    |

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

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

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

| Referenzeinheit      | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Cellnex Telecom S.A. | 5,000 %                        | 20.12.2030       | € 100                     | \$ 25                                           | 0,05                    |



**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 3.125                  | \$ 104                                          | 0,19                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 700                       | 9                                               | 0,02                    |
|                        |                                |                  |                           | \$ 113                                          | 0,21                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %            | 19.03.2030       | £ 1.100    | \$ 16                                           | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500              | 19.03.2035       | 100        | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750              | 19.03.2027       | 200        | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750              | 19.03.2055       | 30         | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 18.06.2030       | \$ 900     | (7)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 18.06.2055       | 500        | (9)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.06.2029       | 2.700      | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,842              | 04.03.2030       | 100        | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,100              | 15.11.2052       | 570        | (15)                                            | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,291             | 02.01.2029       | BRL 1.300  | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,320             | 02.01.2029       | 100        | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,926             | 04.01.2027       | 300        | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927             | 04.01.2027       | 2.000      | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2025       | CAD 400    | 4                                               | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,750              | 20.12.2033       | AUD 1.200  | 1                                               | 0,00                    |
|                                             |                                     |                    |                  |            | \$ (11)                                         | (0,02)                  |
|                                             |                                     |                    |                  |            | \$ 127                                          | 0,24                    |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-<br>verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %       | 16.07.2025    | 100                       | \$ (1)  | \$ 0      | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000         | 16.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850         | 16.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            |                                  |                         |               |               |                           | \$ (1)  | \$ 0      | 0,00                    |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable<br>Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|---------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,555 %       | 24.07.2025    | 100                       | \$ 0    | \$ 0      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 3,905         | 24.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,564         | 24.07.2025    | 100                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,605         | 23.07.2025    | 100                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 3,914         | 24.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 3,955         | 23.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,790         | 09.07.2025    | 100                       | 0       | (1)       | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 4,140         | 09.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,525         | 28.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,583         | 23.07.2025    | 100                       | (1)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,775         | 07.07.2025    | 100                       | 0       | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 3,875         | 28.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 3,933         | 23.07.2025    | 100                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 4,125         | 07.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,772         | 10.07.2025    | 100                       | 0       | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 4,122         | 10.07.2025    | 100                       | 0       | 0         | 0,00                    |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR          | Erhalt                                      | 3,669         | 07.07.2025    | 100                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR          | Zahlung                                     | 4,019         | 07.07.2025    | 100                       | (1)     | 0         | 0,00                    |
|            |                                       |                           |                                             |               |               |                           | \$ (6)  | \$ (6)    | (0,01)                  |

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond    | 1,000 %                        | 20.06.2028       | \$ 300                    | \$ (17)                                      | \$ 18                                           | \$ 1      | 0,00                    |
| BPS        | Romania Government International Bond   | 1,000                          | 20.12.2025       | 100                       | 0                                            | 0                                               | 0         | 0,00                    |
| GST        | Indonesia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2030       | 300                       | 1                                            | 2                                               | 3         | 0,01                    |
| MYC        | Turkey Government International Bond    | 1,000                          | 20.12.2029       | 100                       | (8)                                          | 1                                               | (7)       | (0,01)                  |
|            |                                         |                                |                  |                           | \$ (24)                                      | \$ 21                                           | \$ (3)    | 0,00                    |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | € 8.728                | \$ 9.925                 | \$ 0                             | \$ (322)                           | \$ (322)                                             | (0,61)                  |
|            | 07.2025          | IDR 2.003.711          | \$ 123                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PEN 500                | 138                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | SEK 95                 | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 39                  | CHF 32                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 20                     | KRW 27.285               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | BRL 1.123              | \$ 200                   | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | IDR 2.935.553          | 180                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | INR 26.592             | 310                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 7.000                | 48                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB 387                | 12                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 2.425              | 75                       | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 162                 | BRL 891                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 58                     | IDR 949.650              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 220                    | KRW 297.832              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 170                    | THB 5.562                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 280                    | TWD 8.323                | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          | TWD 4.192              | \$ 135                   | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$ 17                  | INR 1.487                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 74                     | TWD 2.132                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 05.2030          | KWD 27                 | \$ 92                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,01                    |
| BRC        | 07.2025          | THB 1.238              | 38                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY 1.062              | 26                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1.049               | £ 771                    | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 5                      | IDR 79.137               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 5                      | PLN 19                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 129                    | TRY 5.271                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 162                    | ZAR 2.870                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR 4.274              | \$ 236                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | £ 771                  | 1.049                    | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | INR 773                | 9                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 31                  | TRY 1.293                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 09.2025          | PEN 224                | \$ 62                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 231                  | 268                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW 302.255            | 220                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | SGD 6                  | 5                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB 3.121              | 94                       | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 3.650              | 112                      | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 152                 | AUD 233                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 200                    | CAD 274                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 6                      | EGP 328                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 95                     | IDR 1.554.958            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 16                     | THB 534                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 129                    | TWD 3.825                | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          | PEN 109                | \$ 29                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 3.823              | 117                      | 0                                | (17)                               | (17)                                                 | (0,03)                  |
|            | 08.2025          | \$ 1                   | EGP 70                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 140                    | INR 12.058               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN 546                | \$ 148                   | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | (0,01)                  |
|            | 12.2025          | 37                     | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | \$ 9.967               | € 8.591                  | 119                              | 0                                  | 119                                                  | 0,22                    |
|            | 07.2025          | 2                      | KZT 1.150                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 8.573                | \$ 9.967                 | 0                                | (119)                              | (119)                                                | (0,22)                  |
|            | 08.2025          | \$ 59                  | INR 5.123                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN 763                | \$ 40                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 6                   | KZT 3.387                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 0                      | MXN 0                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025          | 14                     | KZT 7.371                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | AUD 287                | \$ 185                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF 38                 | 46                       | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 4.016                | 28                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |



| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025          | PLN                    | 160 \$                   | 43                               | \$ 0                               | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 35 AUD                   | 54                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 193 BRL                  | 1.089                            | 8                                  | 8                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 7 CHF                    | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 55 ¥                     | 8.042                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 140 PEN                  | 500                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 54 \$                    | 35                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 6                        | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 8.012                    | 55                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 28 INR                   | 2.454                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | BRL                    | 369 \$                   | 66                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 120                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025          | PEN                    | 503                      | 140                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | BRL                    | 837                      | 152                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 23 IDR                   | 373.454                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2 EGP                    | 90                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 152 BRL                  | 850                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| IND        | 07.2025          |                        | 20 SEK                   | 190                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK                    | 190 \$                   | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | BRL                    | 22                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 59                       | 80                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 130.171                  | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 7.201                    | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 34                       | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 289                      | 78                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 114                      | 89                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 2.453                    | 75                               | 0                                  | (9)                                                  | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 56 PLN                   | 209                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 16 TWD                   | 490                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 1.212 \$                 | 68                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 1.586                    | 48                               | 0                                  | (7)                                                  | (0,01)                  |
| MBC        | 08.2025          | \$                     | 19 INR                   | 1.658                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 289 \$                   | 211                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 100                      | 114                              | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 334                      | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 275                      | 214                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.891                    | 57                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 1.316                    | 40                               | 0                                  | (5)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 11 CAD                   | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 641 €                    | 556                              | 13                                 | 13                                                   | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 19 IDR                   | 309.706                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 301 ¥                    | 43.800                           | 2                                  | 2                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 40 PLN                   | 149                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 310 SGD                  | 399                              | 3                                  | 3                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 24 THB                   | 800                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 29 TWD                   | 926                              | 3                                  | 3                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 15 \$                    | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 1.257                    | 38                               | 0                                  | (5)                                                  | (0,01)                  |
| MYI        | 07.2025          | ¥                      | 1.335                    | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 17 ¥                     | 2.545                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 2.536 \$                 | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 9 ¥                      | 1.330                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | ¥                      | 4.153 \$                 | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 95                       | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 20 EGP                   | 1.090                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 110 IDR                  | 1.795.243                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 161 TWD                  | 4.791                            | 4                                  | 4                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 752 \$                   | 23                               | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 20 INR                   | 1.719                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2 ¥                      | 252                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | ¥                      | 37.459 \$                | 259                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 21 NZD                   | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 34 \$                    | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 0 INR                    | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 259 ¥                    | 37.321                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | £                      | 712 \$                   | 964                              | 0                                  | (12)                                                 | (0,02)                  |
| UAG        | 07.2025          | KRW                    | 13.665                   | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 251                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025          | \$                     | 154 MXN                  | 2.978                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 191                           | \$ (590)                           | \$ (399)                                             | (0,76)                  |

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | \$                     | 13.532 €                 | 11.901                           | \$ 437                             | \$ 0                                                 | 0,83                    |
| BPS        | 07.2025          | €                      | 89 \$                    | 103                              | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC        | 07.2025          | € 96                   | \$ 111                   | \$ 0                             | \$ (2)                             | \$ (2)                                               | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 13.420              | € 11.817                 | 452                              | 0                                  | 452                                                  | 0,86                    |
| CBK        | 07.2025          | € 38                   | \$ 43                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | 233                    | 268                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 12.608              | € 11.105                 | 427                              | 0                                  | 427                                                  | 0,81                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 1.316                         | \$ (12)                            | \$ 1.304                                             | 2,47                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC                              | 07.2025          | £ 77                   | \$ 104                   | \$ 0                             | \$ (1)                             | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 96                  | £ 71                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | 104                    | 77                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| JPM                              | 07.2025          | 101                    | 75                       | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,01                    |
| MBC                              | 07.2025          | 1                      | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB                              | 07.2025          | £ 76                   | \$ 104                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 101                 | £ 75                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | 104                    | 76                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  |                  |                        |                          | \$ 5                             | \$ (1)                             | \$ 4                                                 | 0,01                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 900                                               | 1,71                    |
| Summe Anlagen                    |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 54.604                                            | 103,62                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ (1.907)                                           | (3,62)                  |
| Nettovermögen                    |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 52.697                                            | 100,00                  |

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

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

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,26 %):

| Emittentenbeschreibung | Kupon    | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum  | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|----------|------------------|------------|--------|-----------|-------------------------|
| Altice France S.A.     | 11,500 % | 01.02.2027       | 20.12.2023 | \$ 162 | \$ 170    | 0,32                    |

- (i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 149 USD (31. Dezember 2024: 143 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 699 USD (31. Dezember 2024: 613 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 359 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 64 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                     | \$ 47.978                                                       | \$ 377                                                       | \$ 48.355 |
| Investmentfonds               | 5.155                                                                    | 0                                                               | 0                                                            | 5.155     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 6                                                                        | 1.088                                                           | 0                                                            | 1.094     |
| Summen                        | \$ 5.161                                                                 | \$ 49.066                                                       | \$ 377                                                       | \$ 54.604 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                     | \$ 47.917                                                       | \$ 250                                                       | \$ 48.167 |
| Investmentfonds               | 4.950                                                                    | 0                                                               | 0                                                            | 4.950     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 14                                                                       | (414)                                                           | 0                                                            | (400)     |
| Summen                        | \$ 4.964                                                                 | \$ 47.503                                                       | \$ 250                                                       | \$ 52.717 |

- (1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.
- (2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.
- (3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| MYI                                | 4,200 %    | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (144)     | \$ (147)                                 | (0,28)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (147)                                 | (0,28)               |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| BOA        | \$ 113                           | \$ 0                               | \$ 113                          | \$ 14                            | \$ 0                               | \$ 14                           |
| BPS        | (18)                             | 0                                  | (18)                            | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| BRC        | 449                              | (420)                              | 29                              | (262)                            | 202                                | (60)                            |
| CBK        | (41)                             | 0                                  | (41)                            | (1)                              | 10                                 | 9                               |
| GLM        | (2)                              | 0                                  | (2)                             | 8                                | 0                                  | 8                               |
| GST        | 3                                | 0                                  | 3                               | 3                                | 0                                  | 3                               |
| JPM        | (17)                             | 0                                  | (17)                            | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| MBC        | 427                              | (280)                              | 147                             | (68)                             | 0                                  | (68)                            |
| MYC        | (7)                              | 0                                  | (7)                             | (7)                              | 0                                  | (7)                             |
| MYI        | 0                                | (10)                               | (10)                            | (7)                              | 0                                  | (7)                             |
| SCX        | 3                                | 0                                  | 3                               | (238)                            | 211                                | (27)                            |
| SSB        | (11)                             | 0                                  | (11)                            | 1                                | 0                                  | 1                               |
| UAG        | 1                                | 0                                  | 1                               | 17                               | 0                                  | 17                              |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 55,36             | 49,79             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 25,69             | 29,13             |
| Investmentfonds                                                        | 8,64              | 8,11              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,12              | 0,04              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,27              | 0,33              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,54              | 0,37              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 7,38              | 12,23             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert   | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Argentinien             | 0,92              | 0,98              |
| Australien              | 0,91              | 0,27              |
| Brasilien               | 1,26              | 1,27              |
| Bulgarien               | 0,25              | 0,14              |
| Kanada                  | 1,06              | 1,17              |
| Kaimaninseln            | 0,60              | 0,67              |
| Chile                   | 0,62              | 0,63              |
| Kolumbien               | 1,21              | 1,28              |
| Costa Rica              | 0,26              | 0,27              |
| Tschechische Republik   | 0,24              | 0,22              |
| Dänemark                | 0,71              | 0,67              |
| Dominikanische Republik | 1,02              | 1,07              |
| Ecuador                 | 0,58              | 0,72              |
| Ägypten                 | 1,07              | 0,74              |
| El Salvador             | 0,24              | 0,39              |
| Frankreich              | 2,21              | 2,28              |
| Deutschland             | 1,91              | 1,80              |
| Ghana                   | 0,47              | 0,38              |
| Ungarn                  | 0,99              | 1,00              |
| Indien                  | 0,71              | 0,75              |
| Indonesien              | 0,95              | 0,98              |
| Irland                  | 3,60              | 3,68              |
| Italien                 | 0,92              | 1,27              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Elfenbeinküste                                                                         | 0,55              | 0,57              |
| Japan                                                                                  | 1,61              | 1,63              |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 0,42              | 0,10              |
| Kasachstan                                                                             | 0,41              | 0,44              |
| Kenia                                                                                  | 0,36              | k. A.             |
| Liberia                                                                                | 0,66              | 0,69              |
| Luxemburg                                                                              | 0,63              | 0,59              |
| Mexiko                                                                                 | 0,75              | 1,26              |
| Marokko                                                                                | 0,32              | 0,33              |
| Multinational                                                                          | 0,38              | 0,41              |
| Niederlande                                                                            | 2,76              | 2,98              |
| Norwegen                                                                               | 0,22              | k. A.             |
| Oman                                                                                   | 0,39              | 0,41              |
| Panama                                                                                 | 1,27              | 1,51              |
| Paraguay                                                                               | 0,16              | 0,17              |
| Peru                                                                                   | 1,48              | 0,92              |
| Philippinen                                                                            | 0,46              | 0,49              |
| Polen                                                                                  | 1,16              | 1,15              |
| Rumänien                                                                               | 1,06              | 1,05              |
| Senegal                                                                                | 0,31              | 0,34              |
| Serbien                                                                                | 0,37              | 0,34              |
| Singapur                                                                               | 0,44              | 0,60              |
| Südafrika                                                                              | 1,40              | 1,42              |
| Spanien                                                                                | 1,20              | 1,19              |
| Sri Lanka                                                                              | 0,52              | 0,56              |
| Supranational                                                                          | 0,22              | 0,21              |
| Schweden                                                                               | 0,58              | 0,53              |
| Schweiz                                                                                | 0,43              | 0,44              |
| Türkei                                                                                 | 1,24              | 1,31              |
| Ukraine                                                                                | 0,41              | 0,49              |
| Großbritannien                                                                         | 5,18              | 4,77              |
| USA                                                                                    | 36,04             | 45,73             |
| Uruguay                                                                                | 0,53              | 0,56              |
| Usbekistan                                                                             | 0,23              | 0,21              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 4,90              | 1,13              |
| Investmentfonds                                                                        | 9,78              | 9,98              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,13              | (0,06)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,05              | 0,05              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf                                 | 0,21              | 0,02              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,02)            | 0,27              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | (0,02)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,76)            | 0,42              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 2,48              | (1,48)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (3,62)            | (6,33)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                                             |                |                          |                                   | ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                                                           |                |                          |                                   | ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                                                    |                |                          |                                   |
| KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG                                   |                |                          |                                   | KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG                                                 |                |                          |                                   | KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG                                          |                |                          |                                   |
| American Airlines, Inc.<br>6,522 % fällig am 20.04.2028              | \$ 585         | \$ 582                   | 0,01                              | Avolon Holdings Funding Ltd.<br>2,528 % fällig am 18.11.2027                       | \$ 4.290       | \$ 4.080                 | 0,09                              | Everglades Re Ltd.<br>14,794 % fällig am 13.05.2031                         | \$ 450         | \$ 470                   | 0,01                              |
| BCP Modular Services Holdings Ltd.<br>6,155 % fällig am 15.12.2028   | € 4.900        | 5.740                    | 0,13                              | 4,950 % fällig am 15.01.2028                                                       | 5.100          | 5.129                    | 0,12                              | 15,794 % fällig am 13.05.2031                                               | 450            | 467                      | 0,01                              |
| Caesars Entertainment, Inc.<br>6,577 % fällig am 06.02.2031          | \$ 4.246       | 4.249                    | 0,10                              | Balder Finland Oyj<br>1,000 % fällig am 18.01.2027                                 | € 1.800        | 2.056                    | 0,05                              | 17,044 % fällig am 13.05.2031                                               | 450            | 466                      | 0,01                              |
| Carnival Corp.<br>6,312 % fällig am 08.08.2027                       | 555            | 556                      | 0,01                              | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA<br>3,625 % fällig am 27.11.2030                | 3.000          | 3.558                    | 0,08                              | Fairfax Financial Holdings Ltd.<br>4,625 % fällig am 29.04.2030             | 2.500          | 2.488                    | 0,06                              |
| Charter Communications Operating LLC<br>6,548 % fällig am 15.12.2031 | 183            | 184                      | 0,00                              | Banco Santander S.A.<br>3,250 % fällig am 02.04.2029                               | 4.500          | 5.351                    | 0,12                              | Federation des Caisses Desjardins du Quebec<br>4,877 % fällig am 30.11.2026 | £ 1.700        | 2.337                    | 0,05                              |
| Delos Aircraft DAC<br>6,046 % fällig am 31.10.2027                   | 1.840          | 1.849                    | 0,04                              | 4,375 % fällig am 14.01.2026 (h)(j)                                                | 3.200          | 3.761                    | 0,09                              | Ford Motor Credit Co. LLC<br>2,700 % fällig am 10.08.2026                   | \$ 3.900       | 3.798                    | 0,09                              |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>6,069 % fällig am 08.11.2030  | 4.774          | 4.795                    | 0,11                              | Bank of America Corp.<br>2,687 % fällig am 22.04.2032                              | \$ 200         | 179                      | 0,00                              | 2,900 % fällig am 16.02.2028                                                | 1.800          | 1.688                    | 0,04                              |
| IRB Holding Corp.<br>6,827 % fällig am 15.12.2027                    | 1.781          | 1.783                    | 0,04                              | 4,623 % fällig am 09.05.2029                                                       | 7.970          | 8.022                    | 0,18                              | 4,389 % fällig am 08.01.2026                                                | 400            | 398                      | 0,01                              |
| LifePoint Health, Inc.<br>7,820 % fällig am 19.05.2031               | 2.283          | 2.252                    | 0,05                              | Barclays PLC<br>2,645 % fällig am 24.06.2031                                       | 900            | 813                      | 0,02                              | 5,800 % fällig am 05.03.2027                                                | 4.600          | 4.638                    | 0,11                              |
| Modena Buyer LLC<br>8,780 % fällig am 01.07.2031                     | 3.085          | 2.978                    | 0,07                              | 4,337 % fällig am 10.01.2028                                                       | 300            | 299                      | 0,01                              | Goldman Sachs Group, Inc.<br>1,875 % fällig am 16.12.2030 (l) £             | 2.500          | 2.963                    | 0,07                              |
| Nouryon Finance BV<br>5,736 % fällig am 03.04.2028                   | € 5.476        | 6.455                    | 0,15                              | 4,972 % fällig am 16.05.2029                                                       | 300            | 303                      | 0,01                              | 2,615 % fällig am 22.04.2032                                                | \$ 200         | 178                      | 0,00                              |
| Quikrete Holdings, Inc.<br>6,577 % fällig am 10.02.2032              | 1.596          | 1.596                    | 0,04                              | 5,304 % fällig am 09.08.2026                                                       | 2.500          | 2.501                    | 0,06                              | 3,615 % fällig am 15.03.2028                                                | 2.000          | 1.973                    | 0,05                              |
| Stepstone Group Midco GmbH<br>6,673 % fällig am 26.04.2032           | € 6.400        | 7.381                    | 0,17                              | 5,501 % fällig am 09.08.2028                                                       | 600            | 612                      | 0,01                              | 3,691 % fällig am 05.06.2028                                                | 300            | 296                      | 0,01                              |
| Telecom Serbia<br>3,399 % fällig am 11.06.2029                       | 7.500          | 8.745                    | 0,20                              | 6,375 % fällig am 15.12.2025 (h)(j) £                                              | 1.700          | 2.335                    | 0,05                              | 4,937 % fällig am 23.04.2028                                                | 6.200          | 6.251                    | 0,14                              |
|                                                                      |                | 53.266                   | 1,22                              | 7,385 % fällig am 02.11.2028                                                       | \$ 2.500       | 2.654                    | 0,06                              | 5,218 % fällig am 23.04.2031                                                | 6.900          | 7.075                    | 0,16                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 7,437 % fällig am 02.11.2033                                                       | 2.700          | 3.065                    | 0,07                              | 5,330 % fällig am 23.07.2035                                                | 3.400          | 3.431                    | 0,08                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Bayou Re Ltd.<br>22,808 % fällig am 30.04.2031                                     | 600            | 645                      | 0,01                              | 5,727 % fällig am 25.04.2030                                                | 700            | 729                      | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Bevco Lux SARL<br>1,000 % fällig am 16.01.2030                                     | € 4.400        | 4.659                    | 0,11                              | 5,798 % fällig am 10.08.2026                                                | 4.200          | 4.206                    | 0,10                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | BGC Group, Inc.<br>4,375 % fällig am 15.12.2025                                    | \$ 1.100       | 1.097                    | 0,03                              | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.<br>4,250 % fällig am 03.05.2030         | € 1.300        | 1.593                    | 0,04                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 02.04.2030                                                       | 2.380          | 2.414                    | 0,06                              | Hardwood Funding LLC<br>4,840 % fällig am 07.06.2028 (k)                    | \$ 1.200       | 1.207                    | 0,03                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Blue Owl Capital Corp.<br>2,875 % fällig am 11.06.2028                             | 1.900          | 1.771                    | 0,04                              | 4,980 % fällig am 07.06.2030 (k)                                            | 1.600          | 1.616                    | 0,04                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Blue Owl Finance LLC<br>3,125 % fällig am 10.06.2031                               | 4.500          | 3.998                    | 0,09                              | 5,160 % fällig am 07.06.2032 (k)                                            | 1.400          | 1.417                    | 0,03                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 18.04.2034 (l)                                                   | 1.500          | 1.544                    | 0,04                              | 5,430 % fällig am 07.06.2037 (k)                                            | 1.500          | 1.521                    | 0,03                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | BNP Paribas S.A.<br>1,904 % fällig am 30.09.2028                                   | 7.800          | 7.363                    | 0,17                              | Hestia Re Ltd.<br>11,044 % fällig am 13.03.2032                             | 300            | 297                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 2,125 % fällig am 23.01.2027                                                       | € 2.400        | 2.815                    | 0,06                              | 12,544 % fällig am 13.03.2032                                               | 300            | 296                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 5,786 % fällig am 13.01.2033                                                       | \$ 3.900       | 4.060                    | 0,09                              | HSBC Holdings PLC<br>1,750 % fällig am 24.07.2027                           | £ 3.200        | 4.256                    | 0,10                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | BPCE S.A.<br>6,612 % fällig am 19.10.2027                                          | 3.550          | 3.635                    | 0,08                              | 3,973 % fällig am 22.05.2030                                                | \$ 2.500       | 2.435                    | 0,06                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Cape Lookout Re Ltd.<br>11,194 % fällig am 13.03.2032                              | 1.800          | 1.808                    | 0,04                              | 5,210 % fällig am 11.08.2028                                                | 2.600          | 2.637                    | 0,06                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 12,996 % fällig am 05.04.2027                                                      | 3.500          | 3.550                    | 0,08                              | ING Groep NV<br>5,550 % fällig am 19.03.2035                                | 7.000          | 7.171                    | 0,16                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Capital One Financial Corp.<br>6,183 % fällig am 30.01.2036 (l)                    | 4.950          | 5.042                    | 0,12                              | 5,750 % fällig am 16.11.2026 (h)(j)                                         | 900            | 896                      | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | CapitaLand Ascendas REIT<br>0,750 % fällig am 23.06.2028                           | € 3.200        | 3.482                    | 0,08                              | Integrity RE Ltd.<br>12,294 % fällig am 06.06.2027                          | 250            | 251                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-<br>SIF-Pan European Core Fund |                |                          |                                   | 14,044 % fällig am 06.06.2027                                               | 250            | 252                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 27.01.2028                                                       | 2.000          | 2.206                    | 0,05                              | 16,544 % fällig am 06.06.2028                                               | 500            | 504                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 0,900 % fällig am 12.10.2029                                                       | 2.300          | 2.463                    | 0,06                              | 29,794 % fällig am 06.06.2027                                               | 900            | 907                      | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | CIMA Finance DAC<br>2,950 % fällig am 05.09.2029                                   | \$ 1.635       | 1.504                    | 0,03                              | Intesa Sanpaolo SpA<br>0,750 % fällig am 16.03.2028                         | € 3.100        | 3.476                    | 0,08                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Constellation Insurance, Inc.<br>6,800 % fällig am 24.01.2030                      | 3.500          | 3.482                    | 0,08                              | 4,000 % fällig am 23.09.2029                                                | \$ 400         | 390                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Cooperative Rabobank UA<br>4,375 % fällig am 29.06.2027 (h)(j)                     | € 1.800        | 2.110                    | 0,05                              | 5,148 % fällig am 10.06.2030                                                | £ 1.400        | 1.904                    | 0,04                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 29.06.2029 (h)(j)                                                | 2.200          | 2.584                    | 0,06                              | Iridium Capital PLC<br>4,103 % fällig am 07.03.2027                         | € 2.700        | 3.142                    | 0,07                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 05.10.2026                                                       | \$ 3.000       | 3.050                    | 0,07                              | JAB Holdings BV<br>2,200 % fällig am 23.11.2030                             | \$ 1.638       | 1.413                    | 0,03                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Coventry Building Society<br>2,625 % fällig am 07.12.2026                          | € 1.100        | 1.300                    | 0,03                              | JPMorgan Chase & Co.<br>4,005 % fällig am 23.04.2029                        | 4.500          | 4.461                    | 0,10                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Crown Castle, Inc.<br>3,100 % fällig am 15.11.2029                                 | \$ 250         | 235                      | 0,01                              | 4,457 % fällig am 13.11.2031                                                | € 8.600        | 10.771                   | 0,25                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 3,800 % fällig am 15.02.2028                                                       | 2.250          | 2.211                    | 0,05                              | 4,995 % fällig am 22.07.2030                                                | \$ 2.400       | 2.444                    | 0,06                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | CTP NV<br>0,625 % fällig am 27.09.2026                                             | € 366          | 418                      | 0,01                              | JPMorgan Chase Bank N.A.<br>5,110 % fällig am 08.12.2026                    | 2.100          | 2.127                    | 0,05                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 21.06.2029                                                       | 5.100          | 5.555                    | 0,13                              | Kizuna RE Pte Ltd.<br>7,044 % fällig am 09.04.2029                          | 602            | 613                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 27.09.2031                                                       | 1.700          | 1.743                    | 0,04                              | Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>5,500 % fällig am 01.08.2030 (b)    | 1.200          | 1.209                    | 0,03                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Deutsche Bank AG<br>1,625 % fällig am 20.01.2027                                   | 1.900          | 2.205                    | 0,05                              | Lazard Group LLC<br>4,375 % fällig am 11.03.2029                            | 15.300         | 15.124                   | 0,35                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 3,035 % fällig am 28.05.2032                                                       | \$ 800         | 718                      | 0,02                              | Legal & General Group PLC<br>5,625 % fällig am 24.03.2031 (h)(j)            | £ 800          | 1.029                    | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Digital Dutch Finco BV<br>1,500 % fällig am 15.03.2030                             | € 1.100        | 1.194                    | 0,03                              | LFS Topco LLC<br>5,875 % fällig am 15.10.2026                               | \$ 1.500       | 1.501                    | 0,03                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.07.2034                                                       | 4.200          | 4.872                    | 0,11                              | Lloyds Banking Group PLC<br>4,375 % fällig am 22.03.2028                    | 900            | 899                      | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | EQT AB<br>2,375 % fällig am 06.04.2028                                             | 1.200          | 1.398                    | 0,03                              | 4,976 % fällig am 11.08.2033                                                | 2.900          | 2.876                    | 0,07                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | Equinix, Inc.<br>0,250 % fällig am 15.03.2027                                      | 1.500          | 1.694                    | 0,04                              | Logicor Financing SARL<br>1,500 % fällig am 13.07.2026                      | € 2.300        | 2.667                    | 0,06                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 3,900 % fällig am 15.04.2032                                                       | \$ 300         | 284                      | 0,01                              | 1,625 % fällig am 17.01.2030                                                | 900            | 973                      | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 15.01.2030                                                | £ 900          | 1.104                    | 0,03                              |
|                                                                      |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | Longleaf Pine Re Ltd.<br>21,794 % fällig am 27.05.2031                      | \$ 900         | 928                      | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | Mizuho Financial Group, Inc.<br>0,470 % fällig am 06.09.2029                | € 3.000        | 3.281                    | 0,08                              |
|                                                                      |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 2,564 % fällig am 13.09.2031                                                | \$ 1.600       | 1.398                    | 0,03                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| MMIFS Re Ltd.                                                                    |                |                          |                                   | Torrey Pines Re Ltd.                     |                |                          |                                   | 3,350 % fällig am 15.04.2031                             | \$ 683         | \$ 651                   | 0,02                              |
| 5,548 % fällig am 10.01.2033                                                     | CAD 600        | \$ 441                   | 0,01                              | 10,308 % fällig am 07.06.2032            | \$ 800         | \$ 826                   | 0,02                              | 3,375 % fällig am 01.11.2028                             | 799            | 780                      | 0,02                              |
| Morgan Stanley                                                                   |                |                          |                                   | 11,558 % fällig am 07.06.2032            | 400            | 417                      | 0,01                              | 3,575 % fällig am 15.07.2029                             | 834            | 809                      | 0,02                              |
| 0,000 % fällig am 02.04.2032 (k)                                                 | \$ 3.600       | 2.499                    | 0,06                              | 13,308 % fällig am 05.06.2031            | 400            | 409                      | 0,01                              | 3,700 % fällig am 01.04.2028                             | 138            | 136                      | 0,00                              |
| Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal |                |                          |                                   | TP ICAP Finance PLC                      |                |                          |                                   | American Airlines, Inc.                                  |                |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am 21.06.2027                                                     | € 1.200        | 1.351                    | 0,03                              | 2,625 % fällig am 18.11.2028             | £ 1.200        | 1.515                    | 0,03                              | 5,500 % fällig am 20.04.2026                             | 433            | 433                      | 0,01                              |
| 2,125 % fällig am 21.06.2052                                                     | 3.400          | 3.448                    | 0,08                              | 6,375 % fällig am 12.06.2032             | 5.000          | 6.967                    | 0,16                              | 5,750 % fällig am 20.04.2029                             | 3.900          | 3.899                    | 0,09                              |
| National Australia Bank Ltd.                                                     |                |                          |                                   | UBS AG                                   |                |                          |                                   | Ashtead Capital, Inc.                                    |                |                          |                                   |
| 3,146 % fällig am 05.02.2031                                                     | 3.200          | 3.831                    | 0,09                              | 0,250 % fällig am 01.09.2028             | € 3.700        | 4.046                    | 0,09                              | 5,950 % fällig am 15.10.2033                             | 7.820          | 8.105                    | 0,19                              |
| National Bank of Canada                                                          |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 15.02.2028             | \$ 300         | 324                      | 0,01                              | Bayer U.S. Finance LLC                                   |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 25.04.2028                                                     | 1.800          | 2.178                    | 0,05                              | UBS Group AG                             |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 21.11.2026                             | 800            | 813                      | 0,02                              |
| Nationwide Building Society                                                      |                |                          |                                   | 3,091 % fällig am 14.05.2032             | 950            | 863                      | 0,02                              | BMW U.S. Capital LLC                                     |                |                          |                                   |
| 3,960 % fällig am 18.07.2030                                                     | \$ 900         | 878                      | 0,02                              | 3,869 % fällig am 12.01.2029             | 4.750          | 4.678                    | 0,11                              | 4,650 % fällig am 15.09.2036                             | 1.800          | 1.811                    | 0,04                              |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029                                                     | 6.800          | 6.760                    | 0,16                              | 4,194 % fällig am 01.04.2031             | 2.100          | 2.057                    | 0,05                              | 4,750 % fällig am 21.03.2028                             | 900            | 911                      | 0,02                              |
| NatWest Group PLC                                                                |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 10.02.2031 (h)(j)      | 650            | 576                      | 0,01                              | Boeing Co.                                               |                |                          |                                   |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029                                                     | 1.700          | 1.717                    | 0,04                              | 5,699 % fällig am 08.02.2035             | 600            | 623                      | 0,01                              | 2,750 % fällig am 01.02.2026                             | 5.100          | 5.043                    | 0,12                              |
| 5,125 % fällig am 12.05.2027 (h)(j)                                              | £ 200          | 269                      | 0,01                              | 6,442 % fällig am 11.08.2028             | 4.750          | 4.936                    | 0,11                              | 6,298 % fällig am 01.05.2029                             | 2.000          | 2.115                    | 0,05                              |
| Nexti SpA                                                                        |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am 01.03.2029             | € 7.400        | 9.790                    | 0,22                              | British Airways Pass-Through Trust                       |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 21.05.2031                                                     | € 4.500        | 5.329                    | 0,12                              | UniCredit SpA                            |                |                          |                                   | 2,900 % fällig am 15.09.2036                             | 1.330          | 1.201                    | 0,03                              |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC                                                  |                |                          |                                   | 2,569 % fällig am 22.09.2026             | \$ 350         | 348                      | 0,01                              | 4,250 % fällig am 15.05.2034                             | 578            | 556                      | 0,01                              |
| 1,850 % fällig am 16.09.2026                                                     | \$ 1.600       | 1.527                    | 0,03                              | Ursa Re Ltd.                             |                |                          |                                   | Broadcom, Inc.                                           |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 09.03.2026                                                     | 1.400          | 1.366                    | 0,03                              | 11,794 % fällig am 22.02.2028            | 1.000          | 1.006                    | 0,02                              | 5,050 % fällig am 15.04.2030                             | 9.700          | 9.940                    | 0,23                              |
| 2,450 % fällig am 15.09.2028                                                     | 700            | 621                      | 0,01                              | VICI Properties LP                       |                |                          |                                   | Burberry Group PLC                                       |                |                          |                                   |
| Nomura Holdings, Inc.                                                            |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.02.2027             | 3.300          | 3.251                    | 0,07                              | 5,750 % fällig am 20.06.2030                             | £ 2.700        | 3.704                    | 0,09                              |
| 3,459 % fällig am 28.05.2030                                                     | € 2.100        | 2.482                    | 0,06                              | 4,125 % fällig am 15.08.2030             | 2.500          | 2.401                    | 0,06                              | Charter Communications Operating LLC                     |                |                          |                                   |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC                                   |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.02.2028             | 2.300          | 2.314                    | 0,05                              | 3,500 % fällig am 01.06.2041                             | \$ 1.000       | 726                      | 0,02                              |
| 0,000 % fällig am 05.04.2032 (e)                                                 | \$ 6.500       | 4.626                    | 0,11                              | 4,750 % fällig am 01.04.2028             | 1.000          | 1.008                    | 0,02                              | 3,900 % fällig am 01.06.2052                             | 950            | 653                      | 0,02                              |
| Polestar Re Ltd.                                                                 |                |                          |                                   | Virgin Money UK PLC                      |                |                          |                                   | 6,384 % fällig am 23.10.2035                             | 875            | 919                      | 0,02                              |
| 14,794 % fällig am 07.01.2028                                                    | 750            | 774                      | 0,02                              | 4,000 % fällig am 18.03.2028             | € 1.600        | 1.924                    | 0,04                              | 6,484 % fällig am 23.10.2045 (l)                         | 550            | 545                      | 0,01                              |
| 17,544 % fällig am 07.01.2027                                                    | 2.900          | 3.030                    | 0,07                              | Volkswagen Leasing GmbH                  |                |                          |                                   | 6,834 % fällig am 23.10.2055                             | 75             | 77                       | 0,00                              |
| Prologis International Funding S.A.                                              |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 11.10.2026             | 1.700          | 2.025                    | 0,05                              | Cogent Communications Group LLC                          |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 01.06.2031                                                     | € 2.200        | 2.553                    | 0,06                              | 3,875 % fällig am 11.10.2028             | 2.300          | 2.776                    | 0,06                              | 6,500 % fällig am 01.07.2032                             | 2.600          | 2.563                    | 0,06                              |
| Purple Re Ltd.                                                                   |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.                        |                |                          |                                   | Coty, Inc.                                               |                |                          |                                   |
| 13,294 % fällig am 06.06.2031                                                    | \$ 1.000       | 1.024                    | 0,02                              | 1,375 % fällig am 26.10.2026             | 2.200          | 2.551                    | 0,06                              | 3,875 % fällig am 15.04.2026                             | € 4.200        | 4.938                    | 0,11                              |
| Quercus Re DAC                                                                   |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 22.04.2026             | \$ 2.100       | 2.077                    | 0,05                              | 4,750 % fällig am 15.01.2029                             | \$ 2.000       | 1.956                    | 0,05                              |
| 10,176 % fällig am 06.01.2031                                                    | € 300          | 362                      | 0,01                              | 3,526 % fällig am 24.03.2028             | 2.600          | 2.564                    | 0,06                              | Exela Intermediate LLC (11,500 % PIK)                    |                |                          |                                   |
| RCI Banque S.A.                                                                  |                |                          |                                   | 5,133 % fällig am 24.01.2028             | 1.800          | 1.802                    | 0,04                              | 11,500 % fällig am 15.04.2026 (c)                        | 1.008          | 50                       | 0,00                              |
| 4,750 % fällig am 24.03.2037                                                     | 3.100          | 3.673                    | 0,08                              | 5,150 % fällig am 23.04.2031             | 1.400          | 1.434                    | 0,03                              | Flora Food Management BV                                 |                |                          |                                   |
| Realty Income Corp.                                                              |                |                          |                                   | 6,303 % fällig am 23.10.2029             | 6.100          | 6.448                    | 0,15                              | 6,875 % fällig am 02.07.2029                             | € 6.200        | 7.400                    | 0,17                              |
| 3,375 % fällig am 20.06.2031                                                     | 1.800          | 2.108                    | 0,05                              | Wells Fargo Bank N.A.                    |                |                          |                                   | Flutter Treasury DAC                                     |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029                                                     | \$ 400         | 395                      | 0,01                              | 5,254 % fällig am 11.12.2026             | 8.000          | 8.118                    | 0,19                              | 4,000 % fällig am 04.06.2031                             | 300            | 353                      | 0,01                              |
| RLJ Lodging Trust LP                                                             |                |                          |                                   | Windmill Re DAC                          |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 04.06.2031                             | \$ 600         | 605                      | 0,01                              |
| 3,750 % fällig am 01.07.2026                                                     | 1.600          | 1.585                    | 0,04                              | 7,599 % fällig am 05.07.2028             | € 250          | 296                      | 0,01                              | 5,875 % fällig am 04.06.2031                             | 2.500          | 2.520                    | 0,06                              |
| Sagax AB                                                                         |                |                          |                                   | Workspace Group PLC                      |                |                          |                                   | Global Payments, Inc.                                    |                |                          |                                   |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027                                                     | € 3.800        | 4.348                    | 0,10                              | 2,250 % fällig am 11.03.2028             | £ 2.700        | 3.417                    | 0,08                              | 5,300 % fällig am 15.08.2029                             | 1.800          | 1.833                    | 0,04                              |
| Sagax Euro MTN NL BV                                                             |                |                          |                                   | WPC Eurobond BV                          |                |                          |                                   | Grifols S.A.                                             |                |                          |                                   |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028                                                     | 2.200          | 2.442                    | 0,06                              | 1,350 % fällig am 15.04.2028             | € 1.700        | 1.915                    | 0,04                              | 3,875 % fällig am 15.10.2028                             | € 3.100        | 3.490                    | 0,08                              |
| 1,000 % fällig am 17.05.2029                                                     | 1.200          | 1.292                    | 0,03                              |                                          |                | 545.804                  | 12,56                             | H Lundbeck A/S                                           |                |                          |                                   |
| Santander UK Group Holdings PLC                                                  |                |                          |                                   | INDUSTRIEWERTE                           |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 02.06.2029                             | 2.900          | 3.422                    | 0,08                              |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028                                                     | \$ 3.100       | 3.039                    | 0,07                              | AA Bond Co. Ltd.                         |                |                          |                                   | Haleon U.S. Capital LLC                                  |                |                          |                                   |
| 5,694 % fällig am 15.04.2031                                                     | 400            | 413                      | 0,01                              | 3,250 % fällig am 31.07.2050             | £ 2.300        | 2.942                    | 0,07                              | 3,375 % fällig am 24.03.2029                             | \$ 1.850       | 1.789                    | 0,04                              |
| 7,482 % fällig am 29.08.2029                                                     | £ 5.400        | 7.955                    | 0,18                              | AbbVie, Inc.                             |                |                          |                                   | Haleon UK Capital PLC                                    |                |                          |                                   |
| SELP Finance SARL                                                                |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 15.03.2031             | \$ 8.300       | 8.524                    | 0,20                              | 4,625 % fällig am 18.09.2033                             | £ 1.100        | 1.461                    | 0,03                              |
| 3,750 % fällig am 10.08.2027                                                     | € 3.300        | 3.941                    | 0,09                              | Accor S.A.                               |                |                          |                                   | HCA, Inc.                                                |                |                          |                                   |
| Sirius Real Estate Ltd.                                                          |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 29.11.2028             | € 3.500        | 4.052                    | 0,09                              | 5,375 % fällig am 01.09.2026                             | \$ 900         | 905                      | 0,02                              |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026                                                     | 4.800          | 5.532                    | 0,13                              | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. |                |                          |                                   | Hilton Domestic Operating Co., Inc.                      |                |                          |                                   |
| Sofina S.A.                                                                      |                |                          |                                   | 3,100 % fällig am 02.02.2031             | \$ 5.000       | 4.235                    | 0,10                              | 3,750 % fällig am 01.05.2029                             | 300            | 288                      | 0,01                              |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028                                                     | 2.900          | 3.162                    | 0,07                              | Aeroporti di Roma SpA                    |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.05.2031                             | 3.200          | 3.011                    | 0,07                              |
| SRC Sukuk Ltd.                                                                   |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 30.07.2031             | € 3.800        | 4.095                    | 0,09                              | Hilton Grand Vacations Borrower LLC                      |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 27.02.2035                                                     | \$ 9.100       | 9.225                    | 0,21                              | Air Canada                               |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.06.2029                             | 4.000          | 3.850                    | 0,09                              |
| Standard Chartered PLC                                                           |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.08.2026             | \$ 1.300       | 1.288                    | 0,03                              | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement |                |                          |                                   |
| 5,005 % fällig am 15.10.2030                                                     | 1.600          | 1.617                    | 0,04                              | Air Canada Pass-Through Trust            |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 16.09.2028                             | € 2.200        | 2.364                    | 0,05                              |
| Store Capital LLC                                                                |                |                          |                                   | 3,600 % fällig am 15.09.2028             | 880            | 860                      | 0,02                              | Hyundai Capital America                                  |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.03.2029                                                     | 200            | 197                      | 0,00                              | Alaska Airlines Pass-Through Trust       |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 23.06.2028                             | \$ 8.100       | 8.160                    | 0,19                              |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.                                            |                |                          |                                   | 4,800 % fällig am 15.02.2029             | 712            | 713                      | 0,02                              | IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % bar oder 7,500 % PIK)      |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am 15.01.2032                                                     | 8.600          | 8.908                    | 0,20                              | Allegiant Travel Co.                     |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.11.2029 (c)                         | € 3.300        | 4.057                    | 0,09                              |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.                                                  |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 15.08.2027             | 2.600          | 2.603                    | 0,06                              | IHO Verwaltungs GmbH (7,000 % bar oder 7,750 % PIK)      |                |                          |                                   |
| 3,629 % fällig am 06.04.2026                                                     | € 3.300        | 3.916                    | 0,09                              | Altice France S.A.                       |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 15.11.2031 (c)                         | 4.200          | 5.221                    | 0,12                              |
| Synchrony Financial                                                              |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.10.2029             | € 2.300        | 2.272                    | 0,05                              | Imperial Brands Finance Netherlands BV                   |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 23.07.2025                                                     | \$ 800         | 799                      | 0,02                              | 5,500 % fällig am 15.10.2029             | \$ 2.700       | 2.241                    | 0,05                              | 1,750 % fällig am 18.03.2033                             | 1.700          | 1.722                    | 0,04                              |
| 5,150 % fällig am 19.03.2029                                                     | 9.000          | 9.040                    | 0,21                              | 11,500 % fällig am 01.02.2027 (k)        | € 2.010        | 2.286                    | 0,05                              | INEOS Finance PLC                                        |                |                          |                                   |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC                                             |                |                          |                                   | Altred Investment Authority S.A.S.       |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.08.2030 (l)                         | 1.100          | 1.258                    | 0,03                              |
| 9,750 % fällig am 10.10.2025                                                     | £ 175          | 225                      | 0,01                              | 3,704 % fällig am 23.06.2029             | 900            | 1.058                    | 0,02                              | Intelsat Jackson Holdings S.A.                           |                |                          |                                   |
| Titanium Bondco SARL (6,250 % PIK)                                               |                |                          |                                   | American Airlines Pass-Through Trust     |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.03.2030                             | \$ 1.406       | 1.437                    | 0,03                              |
| 6,250 % fällig am 14.01.2031 (c)                                                 | € 4.709        | 1.630                    | 0,04                              | 3,000 % fällig am 15.04.2030             | \$ 359         | 340                      | 0,01                              | J Sainsbury PLC                                          |                |                          |                                   |
| Toronto-Dominion Bank                                                            |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 15.04.2030             | 120            | 112                      | 0,00                              | 5,125 % fällig am 29.06.2030                             | £ 2.000        | 2.780                    | 0,06                              |
| 3,879 % fällig am 13.03.2026                                                     | 23.400         | 27.807                   | 0,64                              |                                          |                |                          |                                   |                                                          |                |                          |                                   |



| BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| JetBlue Pass-Through Trust            |                |                          |                                   | Universal Music Group NV                |                |                          |                                   | Illinois State General Obligation Bonds, (BABs),    |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 15.11.2033          | \$             | 149                      | 0,00                              | 3,750 % fällig am 30.06.2032            | €              | 3.400                    | 4.094                             | Series 2010                                         |                |                          |                                   |
| Knorr-Bremse AG                       |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 13.06.2031            |                | 300                      | 368                               | 7,350 % fällig am 01.07.2035                        | \$             | 589                      | 631                               |
| 3,000 % fällig am 30.09.2029          | €              | 1.000                    | 1.188                             | Var Energi ASA                          |                |                          |                                   | Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia |                |                          |                                   |
| Las Vegas Sands Corp.                 |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 12.03.2031            |                | 2.300                    | 2.713                             | Revenue Bonds, Series 2007                          |                |                          |                                   |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029          | \$             | 200                      | 191                               | Venture Global Calcasieu Pass LLC       |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 01.06.2047 (e)                    | 23.300         | 2.132                    | 0,05                              |
| 5,625 % fällig am 15.06.2028          |                | 4.000                    | 4.081                             | 3,875 % fällig am 01.11.2033            | \$             | 6.400                    | 5.602                             | Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia |                |                          |                                   |
| Mileage Plus Holdings LLC             |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 15.01.2030            |                | 4.800                    | 4.954                             | Revenue Bonds, Series 2020                          |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 20.06.2027          |                | 2.640                    | 2.645                             | Virgin Media Secured Finance PLC        |                |                          |                                   | 3,151 % fällig am 01.06.2032                        | 1.500          | 1.336                    | 0,03                              |
| Motability Operations Group PLC       |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.05.2029            | £              | 2.000                    | 2.651                             | 3,301 % fällig am 01.06.2033                        | 800            | 703                      | 0,02                              |
| 4,000 % fällig am 17.01.2030          | €              | 3.400                    | 4.154                             | Vmed O2 UK Financing PLC                |                |                          |                                   |                                                     |                | 7.227                    | 0,17                              |
| Mundys SpA                            |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.07.2031            |                | 2.800                    | 3.447                             |                                                     |                |                          |                                   |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028          |                | 10.100                   | 11.467                            | 5,625 % fällig am 15.04.2032 (b)        | €              | 7.200                    | 8.578                             |                                                     |                |                          |                                   |
| Nidec Corp.                           |                |                          |                                   | Volkswagen Group of America Finance LLC |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 0,046 % fällig am 30.03.2026          |                | 1.100                    | 1.270                             | 5,650 % fällig am 25.03.2032            | \$             | 600                      | 610                               |                                                     |                |                          |                                   |
| Nissan Motor Co. Ltd.                 |                |                          |                                   | Wabtec Transportation Netherlands BV    |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025          | \$             | 7.500                    | 7.458                             | 1,250 % fällig am 03.12.2027            | €              | 4.600                    | 5.230                             |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027          |                | 1.700                    | 1.633                             | Werfen S.A.                             |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 (I)      |                | 500                      | 459                               | 3,625 % fällig am 12.02.2032            |                | 4.600                    | 5.392                             |                                                     |                |                          |                                   |
| Petroleos Mexicanos                   |                |                          |                                   | WMG Acquisition Corp.                   |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032          |                | 4.981                    | 4.632                             | 2,250 % fällig am 15.08.2031            |                | 2.300                    | 2.509                             |                                                     |                |                          |                                   |
| 10,000 % fällig am                    |                |                          |                                   | Wynn Macau Ltd.                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 07.02.2033 (I)                        |                | 900                      | 964                               | 5,500 % fällig am 15.01.2026            | \$             | 400                      | 400                               |                                                     |                |                          |                                   |
| Prosus NV                             |                |                          |                                   | ZF Europe Finance BV                    |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,680 % fällig am 21.01.2030          |                | 600                      | 566                               | 7,000 % fällig am 12.06.2030            | €              | 5.000                    | 5.887                             |                                                     |                |                          |                                   |
| Sabine Pass Liquefaction LLC          |                |                          |                                   |                                         |                |                          | 298.444                           | 6,86                                                |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027          |                | 800                      | 805                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Sandoz Finance BV                     |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 12.09.2029          | €              | 2.200                    | 2.620                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,220 % fällig am 17.04.2030          |                | 3.200                    | 3.956                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Sands China Ltd.                      |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 2,850 % fällig am 08.03.2029          | \$             | 900                      | 828                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 08.08.2031          |                | 1.100                    | 971                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028          |                | 7.800                    | 7.863                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Sartorius Finance BV                  |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 14.09.2029          | €              | 700                      | 861                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 14.09.2035          |                | 600                      | 754                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Schaeffler AG                         |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 01.04.2028          |                | 1.800                    | 2.130                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Scripps Escrow, Inc.                  |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 15.01.2031          | \$             | 1.600                    | 1.109                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Smith & Nephew PLC                    |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,400 % fällig am 20.03.2034          |                | 1.900                    | 1.928                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Southern Co.                          |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,700 % fällig am 30.04.2030          |                | 400                      | 387                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Syngenta Finance NV                   |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 16.04.2026          | €              | 1.000                    | 1.179                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| T-Mobile USA, Inc.                    |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 15.11.2031          | \$             | 2.300                    | 1.995                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,300 % fällig am 15.02.2051          |                | 2.700                    | 1.794                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.04.2030          |                | 4.200                    | 4.080                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| TD SYNNEX Corp.                       |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 09.08.2028          |                | 5.800                    | 5.434                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| TDF Infrastructure SASU               |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029          | €              | 6.400                    | 7.060                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 0,875 % fällig am 29.05.2026          |                | 2.200                    | 2.549                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Thales S.A.                           |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 18.10.2028          |                | 1.500                    | 1.838                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC  |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027          | £              | 91                       | 138                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027          |                | 83                       | 125                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Thames Water Utilities Finance PLC    |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 18.01.2033          | €              | 700                      | 538                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 03.07.2036          | £              | 400                      | 360                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 28.09.2039          |                | 800                      | 737                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 11.02.2043          |                | 500                      | 456                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 09.02.2034          |                | 400                      | 369                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 7,125 % fällig am 30.04.2033          |                | 700                      | 653                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| Thames Water Utilities Ltd.           |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am                     |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 22.03.2027 (e)                        |                | 25                       | 29                                |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| United Airlines Pass-Through Trust    |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,450 % fällig am 15.08.2038          | \$             | 793                      | 803                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029          |                | 1.709                    | 1.746                             |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| United Airlines, Inc.                 |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 (I)      |                | 200                      | 194                               |                                         |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Ginnie Mae, TBA</b>                                  |                |                          |                                   | <b>6,249 % fällig am 20.02.2036</b>                         | \$ 68          | \$ 65                    | 0,00                              | <b>Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust</b>                  | \$ 89          | \$ 49                    | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055                            | 3.000          | 2.794                    | 0,06                              | <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                       |                |                          |                                   | <b>6,000 % fällig am 25.05.2036</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                 |                |                          |                                   | 5,118 % fällig am 25.02.2035                                | 47             | 45                       | 0,00                              | <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                                   |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.04.2037 -                          |                |                          |                                   | 5,403 % fällig am 25.05.2035                                | 194            | 173                      | 0,00                              | 0,566 % fällig am 25.12.2035 (a)                                            | 1.056          | 76                       | 0,00                              |
| 01.07.2048                                              | 10.341         | 9.432                    | 0,22                              | 5,442 % fällig am 25.06.2035                                | 30             | 28                       | 0,00                              | 4,612 % fällig am 20.02.2047                                                | 272            | 219                      | 0,01                              |
| 4,000 % fällig am 01.05.2047 -                          |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 20.07.2032                                | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,622 % fällig am 20.03.2047                                                | 4.219          | 3.628                    | 0,08                              |
| 01.03.2049                                              | 7.298          | 6.895                    | 0,16                              | 6,019 % fällig am 25.01.2035                                | 21             | 20                       | 0,00                              | 4,627 % fällig am 20.12.2046                                                | 9.416          | 8.232                    | 0,19                              |
| 4,500 % fällig am 01.04.2028                            | 2              | 2                        | 0,00                              | <b>BCAP LLC Trust</b>                                       |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.04.2047                                                | 118            | 116                      | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 01.07.2026 -                          |                |                          |                                   | 3,498 % fällig am 26.11.2036                                | 1.092          | 1.165                    | 0,03                              | 4,712 % fällig am 20.09.2046                                                | 555            | 487                      | 0,01                              |
| 01.08.2040                                              | 330            | 339                      | 0,01                              | 4,466 % fällig am 26.03.2037                                | 1.100          | 1.791                    | 0,04                              | 4,714 % fällig am 25.06.2037                                                | 588            | 536                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 01.10.2025 -                          |                |                          |                                   | 4,774 % fällig am 25.01.2037                                | 1.645          | 1.515                    | 0,04                              | 4,714 % fällig am 25.04.2047                                                | 1.055          | 970                      | 0,02                              |
| 01.04.2055                                              | 29.759         | 30.652                   | 0,70                              | 4,794 % fällig am 25.03.2037                                | 622            | 563                      | 0,01                              | 4,754 % fällig am 25.09.2047                                                | 453            | 420                      | 0,01                              |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>            |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 26.02.2036                                | 560            | 213                      | 0,01                              | 4,774 % fällig am 25.05.2047                                                | 468            | 420                      | 0,01                              |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 26.06.2036                                | 10.755         | 3.895                    | 0,09                              | 4,794 % fällig am 25.05.2047                                                | 695            | 640                      | 0,02                              |
| 01.08.2055                                              | 108.500        | 93.879                   | 2,16                              | 5,250 % fällig am 26.04.2037                                | 567            | 317                      | 0,01                              | 4,804 % fällig am 25.02.2037                                                | 1.917          | 557                      | 0,01                              |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 26.06.2037                                | 95             | 84                       | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.07.2046                                                | 158            | 169                      | 0,00                              |
| 01.08.2055                                              | 119.800        | 107.851                  | 2,48                              | 5,734 % fällig am 25.09.2047                                | 784            | 697                      | 0,02                              | 4,814 % fällig am 25.09.2046                                                | 14             | 13                       | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>          |                |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.05.2036                                                | 355            | 275                      | 0,01                              |
| 01.08.2055                                              | 160.200        | 148.951                  | 3,43                              | 4,203 % fällig am 25.09.2034                                | 154            | 140                      | 0,00                              | 4,852 % fällig am 20.03.2046                                                | 43             | 40                       | 0,00                              |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055                            | 165.700        | 158.440                  | 3,64                              | 4,250 % fällig am 25.05.2047                                | 481            | 434                      | 0,01                              | 4,852 % fällig am 20.05.2046                                                | 258            | 229                      | 0,01                              |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   | 4,848 % fällig am 25.07.2034                                | 34             | 32                       | 0,00                              | 4,884 % fällig am 25.09.2035                                                | 224            | 136                      | 0,00                              |
| 01.08.2055                                              | 991.500        | 971.272                  | 22,33                             | 5,117 % fällig am 25.01.2035                                | 221            | 215                      | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.01.2037                                                | 1.814          | 1.539                    | 0,04                              |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055                            | 216.100        | 215.907                  | 4,97                              | 5,396 % fällig am 25.08.2035                                | 33             | 31                       | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.12.2035                                                | 1.161          | 469                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   | 6,339 % fällig am 25.11.2034                                | 29             | 28                       | 0,00                              | 4,994 % fällig am 25.02.2037                                                | 593            | 502                      | 0,01                              |
| 01.08.2055                                              | 757.200        | 768.788                  | 17,69                             | 6,367 % fällig am 25.11.2034                                | 33             | 32                       | 0,00                              | 5,000 % fällig am 25.03.2035                                                | 4              | 3                        | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 01.08.2055                            | 68.400         | 70.528                   | 1,62                              | 6,547 % fällig am 25.04.2033                                | 4              | 4                        | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.02.2036                                                | 1.498          | 1.360                    | 0,03                              |
|                                                         |                | 2.668.535                | 61,38                             | 6,575 % fällig am 25.04.2033                                | 2              | 2                        | 0,00                              | 5,076 % fällig am 20.11.2035                                                | 17             | 15                       | 0,00                              |
| <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                             |                |                          |                                   | 6,884 % fällig am 25.01.2034                                | 30             | 31                       | 0,00                              | 5,144 % fällig am 25.07.2036                                                | 520            | 176                      | 0,00                              |
| <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)</b> |                |                          |                                   | 7,011 % fällig am 25.01.2035                                | 24             | 23                       | 0,00                              | 5,334 % fällig am 25.12.2036                                                | 640            | 207                      | 0,01                              |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025                            | 1.623          | 1.622                    | 0,04                              | 7,326 % fällig am 25.08.2033                                | 70             | 68                       | 0,00                              | 5,399 % fällig am 25.12.2035                                                | 1.785          | 1.531                    | 0,04                              |
| 0,625 % fällig am 15.07.2032                            | 81.033         | 75.618                   | 1,74                              | 7,486 % fällig am 25.01.2035                                | 13             | 13                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.04.2035                                                | 110            | 76                       | 0,00                              |
| 1,125 % fällig am 15.01.2033                            | 74.086         | 70.827                   | 1,63                              | <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                             |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                                | 162            | 89                       | 0,00                              |
| 1,750 % fällig am 15.01.2034                            | 18.157         | 18.008                   | 0,41                              | 3,250 % fällig am 25.02.2034                                | 7              | 7                        | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.12.2035                                                | 2.899          | 1.757                    | 0,04                              |
| 1,875 % fällig am 15.07.2034                            | 112.140        | 112.291                  | 2,58                              | 4,239 % fällig am 25.03.2036                                | 200            | 162                      | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.01.2036                                                | 19             | 11                       | 0,00                              |
| <b>U.S. Treasury Notes</b>                              |                |                          |                                   | 4,297 % fällig am 25.04.2035                                | 38             | 35                       | 0,00                              | 5,734 % fällig am 25.10.2035                                                | 1.124          | 778                      | 0,02                              |
| 0,250 % fällig am 31.08.2025                            | 12.200         | 12.115                   | 0,28                              | 4,333 % fällig am 25.11.2036                                | 986            | 450                      | 0,01                              | 5,750 % fällig am 25.02.2035                                                | 128            | 86                       | 0,00                              |
| 4,250 % fällig am 15.11.2034                            | 163.200        | 163.786                  | 3,77                              | 4,608 % fällig am 25.11.2036                                | 2.906          | 1.676                    | 0,04                              | 5,750 % fällig am 25.07.2035                                                | 634            | 391                      | 0,01                              |
|                                                         |                | 454.267                  | 10,45                             | 4,714 % fällig am 25.09.2035                                | 3.847          | 1.589                    | 0,04                              | 5,750 % fällig am 25.05.2036                                                | 425            | 160                      | 0,00                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                   |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 25.05.2036                                | 486            | 232                      | 0,01                              | 5,750 % fällig am 25.03.2037                                                | 363            | 188                      | 0,01                              |
| <b>Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                   |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.02.2034                                | 76             | 72                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.04.2036                                                | 735            | 324                      | 0,01                              |
| 4,609 % fällig am 25.02.2036                            | 1.131          | 712                      | 0,02                              | 4,774 % fällig am 25.08.2036                                | 156            | 140                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.08.2036                                                | 114            | 65                       | 0,00                              |
| 4,751 % fällig am 25.10.2035                            | 36             | 33                       | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.02.2034                                | 377            | 347                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.12.2036                                                | 1.236          | 485                      | 0,01                              |
| 4,954 % fällig am 25.01.2036                            | 607            | 576                      | 0,01                              | 4,874 % fällig am 25.04.2036                                | 335            | 298                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.02.2037                                                | 226            | 89                       | 0,00                              |
| 5,107 % fällig am 25.11.2035                            | 216            | 152                      | 0,00                              | 4,898 % fällig am 25.09.2034                                | 53             | 48                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.03.2037                                                | 286            | 98                       | 0,00                              |
| 5,539 % fällig am 25.03.2037                            | 5              | 4                        | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.02.2036                                | 243            | 232                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.04.2037                                                | 550            | 244                      | 0,01                              |
| 6,024 % fällig am 25.01.2036                            | 27             | 26                       | 0,00                              | 5,467 % fällig am 25.05.2035                                | 176            | 168                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.05.2037                                                | 92             | 42                       | 0,00                              |
| 7,015 % fällig am 25.08.2035                            | 20             | 20                       | 0,00                              | 5,775 % fällig am 25.01.2034                                | 32             | 30                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                                                | 628            | 292                      | 0,01                              |
| <b>Alba PLC</b>                                         |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>                  |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.08.2032                                                | 32             | 33                       | 0,00                              |
| 4,528 % fällig am 17.03.2039                            | 625            | 844                      | 0,02                              | 4,794 % fällig am 25.06.2037                                | 493            | 463                      | 0,01                              | 6,500 % fällig am 25.09.2037                                                | 542            | 191                      | 0,01                              |
| <b>American Home Mortgage Assets Trust</b>              |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>         |                |                          |                                   | <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>                    |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.06.2037                            | \$ 2.651       | 2.559                    | 0,06                              | 4,120 % fällig am 26.12.2046                                | 355            | 282                      | 0,01                              | 3,655 % fällig am 25.04.2035                                                | 26             | 21                       | 0,00                              |
| 5,319 % fällig am 25.11.2046                            | 59             | 14                       | 0,00                              | <b>Canada Square Funding PLC</b>                            |                |                          |                                   | 4,048 % fällig am 20.05.2036                                                | 530            | 494                      | 0,01                              |
| 6,750 % fällig am 25.12.2046                            | 552            | 494                      | 0,01                              | 5,161 % fällig am 17.01.2059                                | £ 1.781        | 2.445                    | 0,06                              | 4,180 % fällig am 20.02.2036                                                | 412            | 367                      | 0,01                              |
| <b>American Home Mortgage Investment Trust</b>          |                |                          |                                   | <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                         |                |                          |                                   | 4,517 % fällig am 20.05.2036                                                | 303            | 282                      | 0,01                              |
| 6,460 % fällig am 25.11.2045                            | 201            | 75                       | 0,00                              | 4,266 % fällig am 25.03.2037                                | \$ 242         | 226                      | 0,01                              | 4,894 % fällig am 25.05.2035                                                | 28             | 24                       | 0,00                              |
| <b>Atlas Funding PLC</b>                                |                |                          |                                   | 4,669 % fällig am 25.03.2037                                | 21             | 20                       | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.04.2035                                                | 26             | 24                       | 0,00                              |
| 5,374 % fällig am 20.01.2061                            | £ 1.068        | 1.471                    | 0,03                              | 6,550 % fällig am 25.02.2037                                | 8              | 8                        | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.03.2035                                                | 212            | 197                      | 0,01                              |
| <b>Banc of America Alternative Loan Trust</b>           |                |                          |                                   | <b>ChaseFlex Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.02.2035                                                | 27             | 25                       | 0,00                              |
| 2,206 % fällig am                                       |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.07.2037                                | 10             | 9                        | 0,00                              | 5,174 % fällig am 25.02.2035                                                | 638            | 593                      | 0,01                              |
| 25.06.2037 (a)                                          | \$ 522         | 65                       | 0,00                              | <b>ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through</b>    |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 25.12.2027                                                | 20             | 12                       | 0,00                              |
| 4,794 % fällig am 25.06.2037                            | 481            | 347                      | 0,01                              | <b>Certificates Trust</b>                                   |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                                | 3              | 2                        | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046                            | 194            | 170                      | 0,00                              | 4,283 % fällig am 25.08.2037                                | 681            | 577                      | 0,01                              | 5,750 % fällig am 25.02.2037                                                | 351            | 147                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046                            | 411            | 359                      | 0,01                              | <b>Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates</b> |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.05.2037                                                | 20             | 10                       | 0,00                              |
| <b>Banc of America Funding Trust</b>                    |                |                          |                                   | 4,614 % fällig am 25.05.2036                                | 17             | 16                       | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.08.2037                                                | 1.982          | 976                      | 0,02                              |
| 3,507 % fällig am 20.10.2046                            | 65             | 56                       | 0,00                              | <b>Citicorp Mortgage Securities Trust</b>                   |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.09.2037                                                | 80             | 40                       | 0,00                              |
| 4,474 % fällig am 20.06.2037                            | 51             | 44                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.09.2037                                | 24             | 24                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.12.2037                                                | 1.397          | 555                      | 0,01                              |
| 4,494 % fällig am 25.01.2037                            | 83             | 71                       | 0,00                              | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                  |                |                          |                                   | 6,662 % fällig am 20.02.2036                                                | 18             | 16                       | 0,00                              |
| 4,719 % fällig am 20.12.2034                            | 11             | 9                        | 0,00                              | 4,118 % fällig am 25.10.2046                                | 242            | 214                      | 0,01                              | 6,804 % fällig am 20.07.2034                                                | 65             | 64                       | 0,00                              |
| 4,752 % fällig am 20.02.2047                            | 497            | 477                      | 0,01                              | 5,135 % fällig am 25.07.2037                                | 7              | 6                        | 0,00                              | <b>Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust</b>                       |                |                          |                                   |
| 4,812 % fällig am 20.07.2036                            | 1.553          | 1.547                    | 0,04                              | 5,830 % fällig am 25.09.2035                                | 0              | 0                        | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.11.2034                                                | 9              | 9                        | 0,00                              |
| 4,812 % fällig am 20.12.2046                            | 138            | 123                      | 0,00                              | 5,988 % fällig am 25.08.2035                                | 26             | 25                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.03.2035                                                | 274            | 287                      | 0,01                              |
| 4,846 % fällig am 20.05.2036                            | 110            | 96                       | 0,00                              | 6,310 % fällig am 25.11.2035                                | 60             | 61                       | 0,00                              | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b>                 |                |                          |                                   |
| 5,078 % fällig am 20.01.2047                            | 279            | 243                      | 0,01                              | 6,490 % fällig am 25.05.2035                                | 36             | 36                       | 0,00                              | 5,063 % fällig am 25.03.2032                                                | 21             | 20                       | 0,00                              |
| 5,234 % fällig am 25.05.2037                            | 511            | 439                      | 0,01                              | 6,743 % fällig am 25.02.2034                                | 4              | 4                        | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.01.2036                                                | 480            | 282                      | 0,01                              |
| 5,582 % fällig am 20.06.2036                            | 8              | 7                        | 0,00                              | 6,756 % fällig am 25.03.2034                                | 42             | 39                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.04.2033                                                | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 5,625 % fällig am 20.04.2035                            | 665            | 617                      | 0,02                              | 7,239 % fällig am 25.09.2037                                | 11             | 11                       | 0,00                              | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   |
| 6,230 % fällig am 20.11.2034                            | 276            | 267                      | 0,01                              | <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                  |                |                          |                                   | 6,887 % fällig am 25.10.2033                                                | 3              | 3                        | 0,00                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.01.2037                                | 929            | 769                      | 0,02                              | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Certificates</b>                          |                |                          |                                   |
|                                                         |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.06.2037                                | 1.344          | 1.089                    | 0,03                              | 3,241 % fällig am 30.11.2037                                                | 2.928          | 2.677                    | 0,06                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 5,084 % fällig am 25.09.2036                                | 1.267          | 1.077                    | 0,03                              | 4,905 % fällig am 25.06.2050                                                | 1.551          | 1.389                    | 0,03                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.10.2037                                | 574            | 530                      | 0,01                              | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b>                 |                |                          |                                   |
|                                                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.02.2037                                                | 3.638          | 1.568                    | 0,04                              |
|                                                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.08.2036                                                | 41             | 15                       | 0,00                              |
|                                                         |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 25.08.2037                                                | 371            | 175                      | 0,00                              |

| BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust              |                |                          |                                   | 5,741 % fällig am 25.04.2036                                | \$ 6           | \$ 5                     | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.02.2036                               | \$ 124         | \$ 42                    | 0,00                              |
| 4,714 % fällig am 25.07.2047                               | \$ 322         | \$ 299                   | 0,01                              | 5,750 % fällig am 25.01.2036                                | 52             | 22                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.07.2037                               | 388            | 143                      | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                               | 207            | 193                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                                | 250            | 109                      | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.08.2037                               | 2.328          | 541                      | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.09.2047                               | 577            | 496                      | 0,01                              | 6,250 % fällig am 25.07.2036                                | 137            | 42                       | 0,00                              | <b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b> |                |                          |                                   |
| 5,094 % fällig am 25.08.2037                               | 1.182          | 959                      | 0,02                              | 6,500 % fällig am 25.08.2036                                | 247            | 76                       | 0,00                              | 5,023 % fällig am 27.07.2037                               | 199            | 145                      | 0,00                              |
| <b>Downey Savings &amp; Loan Association Mortgage</b>      |                |                          |                                   | 6,759 % fällig am 25.12.2034                                | 13             | 13                       | 0,00                              | 5,594 % fällig am 25.04.2037                               | 28             | 24                       | 0,00                              |
| <b>Loan Trust</b>                                          |                |                          |                                   | <b>Jubilee Place BV</b>                                     |                |                          |                                   | 5,871 % fällig am 25.09.2035                               | 304            | 195                      | 0,01                              |
| 4,622 % fällig am 19.10.2036                               | 524            | 473                      | 0,01                              | 3,263 % fällig am 17.10.2057                                | € 291          | 343                      | 0,01                              | 6,500 % fällig am 25.03.2032                               | 14             | 14                       | 0,00                              |
| 5,274 % fällig am 19.07.2044                               | 139            | 131                      | 0,00                              | <b>Lehman Mortgage Trust</b>                                |                |                          |                                   | <b>Resloc UK PLC</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>EMF-NL Prime BV</b>                                     |                |                          |                                   | 5,743 % fällig am 25.04.2036                                | \$ 885         | 552                      | 0,01                              | 2,155 % fällig am 15.12.2043                               | € 715          | 798                      | 0,02                              |
| 3,063 % fällig am 17.04.2041                               | € 329          | 384                      | 0,01                              | <b>Lehman XS Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 2,225 % fällig am 15.12.2043                               | 3.162          | 3.460                    | 0,08                              |
| <b>Eurosail PLC</b>                                        |                |                          |                                   | 4,884 % fällig am 25.08.2046                                | 122            | 124                      | 0,00                              | 4,578 % fällig am 15.12.2043                               | £ 4.315        | 5.673                    | 0,13                              |
| 2,203 % fällig am 13.03.2045                               | 3.632          | 4.159                    | 0,10                              | 5,334 % fällig am 25.08.2047                                | 406            | 364                      | 0,01                              | <b>Rochester Financing PLC</b>                             |                |                          |                                   |
| 4,608 % fällig am 13.03.2045                               | £ 4.250        | 5.682                    | 0,13                              | <b>Luminent Mortgage Trust</b>                              |                |                          |                                   | 4,939 % fällig am 18.12.2044                               | 972            | 1.331                    | 0,03                              |
| 4,838 % fällig am 10.06.2044                               | 3.945          | 5.361                    | 0,12                              | 4,794 % fällig am 25.12.2036                                | 11             | 11                       | 0,00                              | <b>Sequoia Mortgage Trust</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,308 % fällig am 13.06.2045                               | 10.049         | 13.631                   | 0,31                              | <b>Mansard Mortgages PLC</b>                                |                |                          |                                   | 4,731 % fällig am 20.01.2047                               | \$ 105         | 75                       | 0,00                              |
| <b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b> |                |                          |                                   | 4,736 % fällig am 15.04.2049                                | £ 2.494        | 3.309                    | 0,08                              | 5,384 % fällig am 20.07.2033                               | 10             | 9                        | 0,00                              |
| 4,355 % fällig am 25.01.2036                               | \$ 300         | 148                      | 0,00                              | <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>                |                |                          |                                   | 7,373 % fällig am 20.04.2035                               | 27             | 27                       | 0,00                              |
| 5,151 % fällig am 25.09.2034                               | 23             | 24                       | 0,00                              | 3,420 % fällig am 25.07.2035                                | \$ 165         | 147                      | 0,00                              | <b>Stratton BTL Mortgage Funding PLC</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>First Horizon Mortgage Pass-Through Trust</b>           |                |                          |                                   | 6,043 % fällig am 21.11.2034                                | 84             | 81                       | 0,00                              | 5,028 % fällig am 20.01.2054                               | £ 1.259        | 1.726                    | 0,04                              |
| 6,431 % fällig am 25.08.2035                               | 23             | 16                       | 0,00                              | 6,266 % fällig am 25.05.2034                                | 36             | 35                       | 0,00                              | <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>      |                |                          |                                   |
| <b>GMAC Mortgage Corp. Loan Trust</b>                      |                |                          |                                   | <b>MASTR Seasoned Securitization Trust</b>                  |                |                          |                                   | 4,077 % fällig am 25.04.2036                               | \$ 109         | 57                       | 0,00                              |
| 3,938 % fällig am 19.04.2036                               | 39             | 33                       | 0,00                              | 5,996 % fällig am 25.10.2032                                | 24             | 24                       | 0,00                              | 4,520 % fällig am 25.04.2035                               | 106            | 96                       | 0,00                              |
| <b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>                   |                |                          |                                   | <b>Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-</b>      |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.09.2034                               | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 4,974 % fällig am 25.11.2045                               | 132            | 124                      | 0,00                              | <b>Through Trust</b>                                        |                |                          |                                   | 5,030 % fällig am 25.09.2035                               | 63             | 57                       | 0,00                              |
| 5,054 % fällig am 25.10.2045                               | 7              | 6                        | 0,00                              | 4,866 % fällig am 15.12.2030                                | 97             | 94                       | 0,00                              | 5,207 % fällig am 25.04.2035                               | 189            | 174                      | 0,00                              |
| <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                             |                |                          |                                   | 5,126 % fällig am 15.11.2031                                | 10             | 10                       | 0,00                              | 5,409 % fällig am 25.09.2034                               | 194            | 187                      | 0,01                              |
| 2,216 % fällig am                                          |                |                          |                                   | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>               |                |                          |                                   | 5,673 % fällig am 25.10.2035                               | 111            | 104                      | 0,00                              |
| 25.01.2037 (a)                                             | 3.026          | 226                      | 0,01                              | 4,448 % fällig am 25.03.2036                                | 404            | 200                      | 0,01                              | 5,967 % fällig am 25.07.2034                               | 86             | 84                       | 0,00                              |
| 4,429 % fällig am 25.11.2035                               | 40             | 35                       | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.11.2035                                | 27             | 26                       | 0,00                              | 5,969 % fällig am 25.12.2034                               | 5              | 5                        | 0,00                              |
| 5,293 % fällig am 25.09.2035                               | 106            | 102                      | 0,00                              | 5,313 % fällig am 25.10.2028                                | 4              | 4                        | 0,00                              | 6,174 % fällig am 25.04.2034                               | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 5,540 % fällig am 25.11.2035                               | 90             | 43                       | 0,00                              | 5,519 % fällig am 25.02.2035                                | 9              | 8                        | 0,00                              | 6,525 % fällig am 25.02.2034                               | 71             | 70                       | 0,00                              |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036                               | 9              | 8                        | 0,00                              | 5,786 % fällig am 25.07.2035                                | 23             | 21                       | 0,00                              | <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>         |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037                               | 17             | 10                       | 0,00                              | 5,879 % fällig am 25.05.2033                                | 37             | 36                       | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.08.2036                               | 551            | 485                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.03.2032                               | 0              | 0                        | 0,00                              | 6,210 % fällig am 25.12.2032                                | 3              | 3                        | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.03.2037                               | 48             | 4                        | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035                               | 824            | 272                      | 0,01                              | <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.07.2046                               | 309            | 270                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037                               | 44             | 22                       | 0,00                              | 3,368 % fällig am 25.11.2037                                | 1.463          | 1.022                    | 0,02                              | 4,814 % fällig am 25.06.2036                               | 42             | 42                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037                               | 99             | 72                       | 0,00                              | 3,824 % fällig am 25.12.2037                                | 1.011          | 648                      | 0,02                              | 4,834 % fällig am 25.10.2036                               | 1.071          | 959                      | 0,02                              |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036                               | 78             | 34                       | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.04.2035                                | 31             | 31                       | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.04.2036                               | 193            | 175                      | 0,00                              |
| <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                      |                |                          |                                   | 5,962 % fällig am 25.06.2036                                | 692            | 184                      | 0,01                              | 4,854 % fällig am 25.08.2036                               | 51             | 42                       | 0,00                              |
| 4,030 % fällig am 19.10.2033                               | 24             | 22                       | 0,00                              | 6,354 % fällig am 25.08.2036                                | 758            | 128                      | 0,00                              | 4,932 % fällig am 19.07.2035                               | 61             | 60                       | 0,00                              |
| 4,594 % fällig am 25.05.2038                               | 409            | 328                      | 0,01                              | <b>Morgan Stanley Re-REMIC Trust</b>                        |                |                          |                                   | 5,054 % fällig am 25.12.2035                               | 129            | 108                      | 0,00                              |
| 4,787 % fällig am 19.06.2045                               | 1.042          | 476                      | 0,01                              | 5,250 % fällig am 26.05.2037                                | 815            | 365                      | 0,01                              | <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-</b>    |                |                          |                                   |
| 4,872 % fällig am 19.05.2035                               | 119            | 115                      | 0,00                              | <b>MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>      |                |                          |                                   | <b>Through Certificates</b>                                |                |                          |                                   |
| 4,932 % fällig am 19.01.2036                               | 606            | 394                      | 0,01                              | 4,894 % fällig am 25.06.2047                                | 1.231          | 1.078                    | 0,03                              | 6,066 % fällig am 25.12.2033                               | 43             | 42                       | 0,00                              |
| 4,992 % fällig am 19.02.2036                               | 202            | 89                       | 0,00                              | <b>Newgate Funding PLC</b>                                  |                |                          |                                   | 6,554 % fällig am 25.06.2033                               | 1              | 1                        | 0,00                              |
| 5,252 % fällig am 19.11.2034                               | 64             | 58                       | 0,00                              | 2,346 % fällig am 01.12.2050                                | € 2.519        | 2.886                    | 0,07                              | <b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Harmony French Home Loans</b>                           |                |                          |                                   | <b>Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust</b> |                |                          |                                   | 5,677 % fällig am 25.07.2036                               | 124            | 100                      | 0,00                              |
| 2,690 % fällig am 27.05.2062                               | € 4.362        | 5.132                    | 0,12                              | 4,413 % fällig am 25.10.2035                                | \$ 78          | 70                       | 0,00                              | 5,684 % fällig am 25.06.2037                               | 278            | 258                      | 0,01                              |
| <b>HomeBanc Mortgage Trust</b>                             |                |                          |                                   | 4,763 % fällig am 25.06.2036                                | 1.155          | 832                      | 0,02                              | 5,999 % fällig am 25.06.2037                               | 1.496          | 1.278                    | 0,03                              |
| 4,705 % fällig am 25.04.2037                               | \$ 1.332       | 1.203                    | 0,03                              | 5,504 % fällig am 25.02.2035                                | 135            | 133                      | 0,00                              | <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Impac CMB Trust</b>                                     |                |                          |                                   | <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                      |                |                          |                                   | 5,074 % fällig am 20.04.2051                               | £ 9.254        | 12.690                   | 0,29                              |
| 5,074 % fällig am 25.09.2034                               | 0              | 0                        | 0,00                              | 0,445 % fällig am 25.09.2046                                | 1.770          | 626                      | 0,02                              | <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                               | 249            | 240                      | 0,01                              | <b>OBX Trust</b>                                            |                |                          |                                   | 4,959 % fällig am 20.12.2063                               | 803            | 1.101                    | 0,03                              |
| 5,094 % fällig am 25.03.2035                               | 256            | 234                      | 0,01                              | 5,084 % fällig am 25.06.2057                                | 112            | 110                      | 0,00                              | <b>Twin Bridges PLC</b>                                    |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.10.2034                               | 79             | 79                       | 0,00                              | <b>Prime Mortgage Trust</b>                                 |                |                          |                                   | 5,089 % fällig am 12.03.2055                               | 2.912          | 3.994                    | 0,09                              |
| 5,354 % fällig am 25.11.2034                               | 8              | 8                        | 0,00                              | 8,000 % fällig am 25.07.2034                                | 165            | 139                      | 0,00                              | <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>       |                |                          |                                   |
| <b>IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust</b>              |                |                          |                                   | <b>RBSGC Structured Trust</b>                               |                |                          |                                   | 3,413 % fällig am 25.05.2037                               | \$ 22          | 18                       | 0,00                              |
| 6,622 % fällig am 25.01.2032                               | 11             | 10                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                | 567            | 476                      | 0,01                              | 4,024 % fällig am 25.06.2037                               | 59             | 52                       | 0,00                              |
| <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                         |                |                          |                                   | <b>RBSSP Resecuritization Trust</b>                         |                |                          |                                   | 4,033 % fällig am 25.12.2046                               | 167            | 151                      | 0,00                              |
| 3,157 % fällig am 25.06.2037                               | 840            | 497                      | 0,01                              | 4,679 % fällig am 27.06.2036                                | 4.946          | 4.326                    | 0,10                              | 4,068 % fällig am 25.12.2046                               | 98             | 86                       | 0,00                              |
| 3,404 % fällig am 25.07.2037                               | 1.885          | 1.234                    | 0,03                              | <b>Residential Accredited Loans, Inc. Trust</b>             |                |                          |                                   | 4,093 % fällig am 25.02.2037                               | 125            | 107                      | 0,00                              |
| 3,886 % fällig am 25.06.2037                               | 57             | 35                       | 0,00                              | 4,584 % fällig am 25.02.2047                                | 2.551          | 779                      | 0,02                              | 4,257 % fällig am 25.02.2037                               | 1.037          | 935                      | 0,02                              |
| 4,057 % fällig am 25.06.2036                               | 202            | 177                      | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.08.2035                                | 175            | 123                      | 0,00                              | 4,585 % fällig am 25.03.2036                               | 8              | 8                        | 0,00                              |
| 4,670 % fällig am 25.07.2037                               | 442            | 186                      | 0,01                              | 4,814 % fällig am 25.09.2036                                | 504            | 463                      | 0,01                              | 4,823 % fällig am 25.09.2036                               | 264            | 231                      | 0,01                              |
| 4,794 % fällig am 25.07.2047                               | 520            | 341                      | 0,01                              | 4,814 % fällig am 25.12.2036                                | 278            | 249                      | 0,01                              | 4,954 % fällig am 25.11.2045                               | 646            | 621                      | 0,02                              |
| 4,854 % fällig am 25.07.2036                               | 653            | 627                      | 0,02                              | 4,814 % fällig am 25.05.2047                                | 316            | 289                      | 0,01                              | 5,014 % fällig am 25.07.2045                               | 106            | 104                      | 0,00                              |
| 5,034 % fällig am 25.07.2035                               | 184            | 148                      | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.11.2036                                | 91             | 65                       | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.10.2045                               | 148            | 149                      | 0,00                              |
| 5,074 % fällig am 25.02.2035                               | 42             | 39                       | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.08.2037                                | 66             | 63                       | 0,00                              | 5,099 % fällig am 25.02.2047                               | 504            | 462                      | 0,01                              |
| 5,234 % fällig am 25.11.2034                               | 86             | 79                       | 0,00                              | 4,994 % fällig am 25.12.2045                                | 67             | 40                       | 0,00                              | 5,129 % fällig am 25.01.2047                               | 137            | 130                      | 0,00                              |
| 5,254 % fällig am 25.11.2034                               | 63             | 56                       | 0,00                              | 5,204 % fällig am 25.01.2036                                | 188            | 126                      | 0,00                              | 5,139 % fällig am 25.01.2047                               | 47             | 43                       | 0,00                              |
| 5,297 % fällig am 25.10.2034                               | 163            | 157                      | 0,00                              | 5,309 % fällig am 25.12.2035                                | 134            | 119                      | 0,00                              | 5,149 % fällig am 25.06.2047                               | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037                               | 3.049          | 977                      | 0,02                              | 5,397 % fällig am 25.10.2037                                | 152            | 123                      | 0,00                              | 5,159 % fällig am 25.04.2047                               | 822            | 748                      | 0,02                              |
| <b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>                     |                |                          |                                   | 5,899 % fällig am 25.08.2035                                | 47             | 37                       | 0,00                              | 5,274 % fällig am 25.07.2045                               | 166            | 162                      | 0,00                              |
| 4,654 % fällig am 25.03.2036                               | 163            | 122                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.08.2036                                | 234            | 202                      | 0,01                              | 5,379 % fällig am 25.06.2046                               | 243            | 227                      | 0,01                              |
| 4,794 % fällig am 25.06.2037                               | 8.377          | 4.298                    | 0,10                              | 6,500 % fällig am 25.09.2037                                | 91             | 76                       | 0,00                              | 5,399 % fällig am 25.02.2046                               | 299            | 273                      | 0,01                              |
| 5,843 % fällig am 26.05.2037                               | 836            | 655                      | 0,02                              | <b>Residential Asset Securitization Trust</b>               |                |                          |                                   | 5,399 % fällig am 25.08.2046                               | 294            | 269                      | 0,01                              |
| <b>JPMorgan Mortgage Trust</b>                             |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.06.2033                                | 31             | 31                       | 0,00                              | 5,447 % fällig am 25.07.2046                               | 184            | 167                      | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am 25.05.2034                               | 3              | 3                        | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.09.2035                                | 16             | 7                        | 0,00                              | 5,447 % fällig am 25.08.2046                               | 2.565          | 2.203                    | 0,05                              |
| 4,154 % fällig am 27.07.2037                               | 96             | 90                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.12.2035                                | 80             | 36                       | 0,00                              | 5,799 % fällig am 25.06.2042                               | 7              | 7                        | 0,00                              |
| 5,078 % fällig am 25.11.2035                               | 16             | 12                       | 0,00                              |                                                             |                |                          |                                   | 5,799 % fällig am 25.08.2042                               | 34             | 33                       | 0,00                              |
| 5,461 % fällig am 25.10.2035                               | 125            | 96                       | 0,00                              |                                                             |                |                          |                                   | 5,899 % fällig am 25.11.2046                               | 1.846          | 1.636                    | 0,04                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,902 % fällig am 25.08.2034                            | \$ 58          | \$ 56                    | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.05.2037                         | \$ 3.626       | \$ 2.379                 | 0,06                              | Long Beach Mortgage Loan Trust                       |                |                          |                                   |
| 6,205 % fällig am 25.03.2034                            | 185            | 186                      | 0,01                              | 4,694 % fällig am 25.03.2037                         | 351            | 317                      | 0,01                              | 4,654 % fällig am 25.11.2036                         | \$ 8.775       | \$ 2.635                 | 0,06                              |
| 6,633 % fällig am 25.09.2033                            | 14             | 13                       | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.12.2036                         | 231            | 155                      | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.02.2036                         | 994            | 981                      | 0,02                              |
| 6,924 % fällig am 25.10.2034                            | 1              | 1                        | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.08.2036                         | 1.792          | 1.781                    | 0,04                              | 5,034 % fällig am 25.02.2036                         | 244            | 210                      | 0,01                              |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through                 |                |                          |                                   | 4,954 % fällig am 25.09.2036                         | 605            | 543                      | 0,01                              | 5,349 % fällig am 25.08.2035                         | 700            | 635                      | 0,02                              |
| Certificates Trust                                      |                |                          |                                   |                                                      |                |                          |                                   | MASTR Specialized Loan Trust                         |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.02.2037                            | 168            | 130                      | 0,00                              | Countrywide Asset-Backed                             |                |                          |                                   | 5,134 % fällig am 25.05.2037                         | 60             | 57                       | 0,00                              |
| 5,034 % fällig am 25.07.2036                            | 1.205          | 773                      | 0,02                              | 4,388 % fällig am 25.10.2032                         | 0              | 12                       | 0,00                              | 5,174 % fällig am 25.01.2037                         | 1.056          | 407                      | 0,01                              |
| 5,119 % fällig am 25.12.2046                            | 2.646          | 2.139                    | 0,05                              | 4,419 % fällig am 25.07.2036                         | 2.257          | 2.152                    | 0,05                              | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust               |                |                          |                                   |
| 5,134 % fällig am 25.01.2036                            | 294            | 237                      | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.07.2037                         | 986            | 920                      | 0,02                              | 4,774 % fällig am 25.07.2037                         | 53             | 20                       | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035                            | 321            | 302                      | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.08.2037                         | 142            | 129                      | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.08.2037                         | 10.956         | 5.368                    | 0,12                              |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035                            | 259            | 249                      | 0,01                              | 4,634 % fällig am 25.06.2047                         | 4.473          | 3.955                    | 0,09                              | 4,954 % fällig am 25.03.2037                         | 1.814          | 1.692                    | 0,04                              |
| 6,000 % fällig am 25.10.2035                            | 122            | 96                       | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.06.2035                         | 359            | 327                      | 0,01                              | 4,954 % fällig am 25.04.2037                         | 1.234          | 584                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036                            | 201            | 199                      | 0,01                              | 4,794 % fällig am 25.11.2047                         | 7              | 9                        | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.05.2037                         | 954            | 569                      | 0,01                              |
| Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through             |                |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.09.2037                         | 511            | 469                      | 0,01                              | 5,074 % fällig am 25.03.2037                         | 639            | 596                      | 0,01                              |
| Certificates Trust                                      |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.05.2047                         | 1.576          | 1.393                    | 0,03                              | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust               |                |                          |                                   |
| 4,712 % fällig am 25.02.2033                            | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.09.2037                         | 178            | 186                      | 0,01                              | 4,494 % fällig am 25.12.2036                         | 1.011          | 504                      | 0,01                              |
| Wells Fargo Alternative Loan Trust                      |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.09.2047                         | 1.207          | 1.208                    | 0,03                              | 4,564 % fällig am 25.10.2036                         | 584            | 517                      | 0,01                              |
| 4,784 % fällig am 25.06.2037                            | 169            | 122                      | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.05.2037                         | 192            | 186                      | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.10.2036                         | 25             | 11                       | 0,00                              |
| Wells Fargo Commercial Mortgage Trust                   |                |                          |                                   | 5,114 % fällig am 25.12.2036                         | 79             | 64                       | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.11.2036                         | 648            | 308                      | 0,01                              |
| 3,874 % fällig am 15.06.2036                            | 2.100          | 1.915                    | 0,05                              | 5,529 % fällig am 25.04.2036                         | 300            | 292                      | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.03.2037                         | 2.527          | 2.278                    | 0,05                              |
|                                                         |                | 200.241                  | 4,61                              | 6,159 % fällig am 25.05.2035                         | 322            | 319                      | 0,01                              | 4,584 % fällig am 25.10.2036                         | 6.102          | 3.161                    | 0,07                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 6,384 % fällig am 25.08.2035                         | 1.485          | 1.381                    | 0,03                              | 4,584 % fällig am 25.12.2036                         | 207            | 103                      | 0,00                              |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                        |                |                          |                                   | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |                |                          |                                   | 4,614 % fällig am 25.03.2037                         | 1.001          | 427                      | 0,01                              |
| AUTOMOBILE ABS SONSTIGE                                 |                |                          |                                   | 4,562 % fällig am 25.01.2032                         | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.10.2036                         | 998            | 436                      | 0,01                              |
| Golden Bar Securitisation SRL                           |                |                          |                                   | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC    |                |                          |                                   | 4,664 % fällig am 25.10.2036                         | 3.608          | 1.869                    | 0,04                              |
| 3,086 % fällig am 22.09.2043                            | € 5.604        | 6.622                    | 0,15                              | 3,221 % fällig am 25.01.2037                         | 133            | 39                       | 0,00                              | 4,684 % fällig am 25.07.2036                         | 612            | 556                      | 0,01                              |
| HYPOTHEKEN SONSTIGE                                     |                |                          |                                   | 3,277 % fällig am 25.03.2037                         | 8.835          | 3.113                    | 0,07                              | 4,684 % fällig am 25.03.2037                         | 501            | 213                      | 0,01                              |
| Accredited Mortgage Loan Trust                          |                |                          |                                   | 3,364 % fällig am 25.07.2036                         | 1.495          | 1.421                    | 0,03                              | 4,734 % fällig am 25.06.2036                         | 12             | 11                       | 0,00                              |
| 5,379 % fällig am 25.09.2035                            | \$ 6.171       | 5.303                    | 0,12                              | CSAB Mortgage-Backed Trust                           |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.07.2036                         | 1.426          | 519                      | 0,01                              |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust             |                |                          |                                   | 6,220 % fällig am 25.09.2036                         | 3.187          | 893                      | 0,02                              | 4,734 % fällig am 25.09.2036                         | 62             | 21                       | 0,00                              |
| 4,674 % fällig am 25.08.2036                            | 1.476          | 333                      | 0,01                              | Delta Funding Home Equity Loan Trust                 |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.11.2036                         | 987            | 559                      | 0,01                              |
| 5,259 % fällig am 25.12.2045                            | 820            | 627                      | 0,02                              | 5,246 % fällig am 15.09.2029                         | 4              | 4                        | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.03.2036                         | 925            | 772                      | 0,02                              |
| Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass- |                |                          |                                   | EMC Mortgage Loan Trust                              |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 25.01.2035                         | 654            | 659                      | 0,02                              |
| Through Certificates                                    |                |                          |                                   | 5,174 % fällig am 25.05.2040                         | 73             | 73                       | 0,00                              | 5,484 % fällig am 25.09.2033                         | 42             | 42                       | 0,00                              |
| 5,139 % fällig am 25.11.2035                            | 1.565          | 1.545                    | 0,04                              | Fieldstone Mortgage Investment Trust                 |                |                          |                                   | 5,684 % fällig am 25.07.2037                         | 2.100          | 1.868                    | 0,04                              |
| 5,304 % fällig am 25.01.2036                            | 600            | 584                      | 0,01                              | 4,759 % fällig am 25.11.2036                         | 1.056          | 659                      | 0,02                              | Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust        |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am 25.09.2034                            | 393            | 400                      | 0,01                              | 5,119 % fällig am 25.04.2047                         | 3.348          | 2.241                    | 0,05                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                         | 1.498          | 588                      | 0,01                              |
| Amortizing Residential Collateral Trust                 |                |                          |                                   | First NLC Trust                                      |                |                          |                                   | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                   |                |                          |                                   |
| 5,134 % fällig am 25.10.2031                            | 14             | 14                       | 0,00                              | 4,614 % fällig am 25.08.2037                         | 6.294          | 3.146                    | 0,07                              | 6,465 % fällig am 25.09.2046                         | 1.003          | 328                      | 0,01                              |
| Amresco Residential Securities Corp. Mortgage           |                |                          |                                   | Fremont Home Loan Trust                              |                |                          |                                   | New Century Home Equity Loan Trust                   |                |                          |                                   |
| Loan Trust                                              |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.08.2036                         | 585            | 183                      | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.03.2035                         | 519            | 521                      | 0,01                              |
| 5,374 % fällig am 25.06.2029                            | 5              | 5                        | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.11.2036                         | 1.748          | 613                      | 0,01                              | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust |                |                          |                                   |
| Argent Mortgage Loan Trust                              |                |                          |                                   | 4,704 % fällig am 25.10.2036                         | 2.802          | 2.549                    | 0,06                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                         | 1.060          | 1.012                    | 0,02                              |
| 4,914 % fällig am 25.05.2035                            | 1.620          | 1.452                    | 0,03                              | 4,714 % fällig am 25.02.2037                         | 6.187          | 4.544                    | 0,11                              | 5,094 % fällig am 25.10.2036                         | 2.072          | 459                      | 0,01                              |
| Argent Securities Trust                                 |                |                          |                                   | 4,774 % fällig am 25.02.2037                         | 1.586          | 485                      | 0,01                              | 5,234 % fällig am 25.02.2037                         | 546            | 153                      | 0,00                              |
| 4,584 % fällig am 25.09.2036                            | 1.916          | 616                      | 0,01                              | 4,934 % fällig am 25.05.2036                         | 1.192          | 762                      | 0,02                              | NovaStar Mortgage Funding Trust                      |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.05.2036                            | 518            | 125                      | 0,00                              | 5,049 % fällig am 25.11.2035                         | 5.407          | 4.973                    | 0,12                              | 4,634 % fällig am 25.09.2037                         | 425            | 419                      | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.06.2036                            | 1.622          | 442                      | 0,01                              | 5,304 % fällig am 25.05.2034                         | 1.324          | 1.294                    | 0,03                              | 4,774 % fällig am 25.11.2036                         | 2.012          | 616                      | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                            | 4.956          | 4.454                    | 0,10                              | GE-WMC Mortgage Securities Trust                     |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.01.2037                         | 1.297          | 430                      | 0,01                              |
| 4,754 % fällig am 25.05.2036                            | 3.468          | 835                      | 0,02                              | 4,734 % fällig am 25.08.2036                         | 9.568          | 4.044                    | 0,09                              | 6,309 % fällig am 25.03.2035                         | 461            | 456                      | 0,01                              |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust                 |                |                          |                                   | GSAA Home Equity Trust                               |                |                          |                                   | Option One Mortgage Loan Trust                       |                |                          |                                   |
| 5,134 % fällig am 25.06.2034                            | 544            | 546                      | 0,01                              | 4,554 % fällig am 25.05.2036                         | 641            | 134                      | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.03.2037                         | 117            | 107                      | 0,00                              |
| 5,484 % fällig am 25.03.2034                            | 295            | 287                      | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.03.2036                         | 2.411          | 774                      | 0,02                              | 4,654 % fällig am 25.04.2037                         | 3.973          | 2.751                    | 0,06                              |
| Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust    |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.05.2047                         | 97             | 59                       | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.05.2037                         | 3.260          | 1.963                    | 0,05                              |
| 5,529 % fällig am 25.02.2035                            | 482            | 488                      | 0,01                              | 5,334 % fällig am 25.08.2037                         | 27             | 27                       | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.01.2037                         | 729            | 469                      | 0,01                              |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust              |                |                          |                                   | 5,985 % fällig am 25.06.2036                         | 6.029          | 1.349                    | 0,03                              | 4,714 % fällig am 25.02.2037                         | 731            | 462                      | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.11.2036                            | 828            | 821                      | 0,02                              | 6,502 % fällig am 25.11.2036                         | 40             | 15                       | 0,00                              | Ownit Mortgage Loan Trust                            |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.02.2037                            | 3.284          | 3.166                    | 0,07                              | GSAMP Trust                                          |                |                          |                                   | 4,739 % fällig am 25.05.2037                         | 582            | 476                      | 0,01                              |
| 4,974 % fällig am 25.11.2035                            | 650            | 649                      | 0,02                              | 4,504 % fällig am 25.12.2036                         | 303            | 150                      | 0,00                              | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-       |                |                          |                                   |
| 5,289 % fällig am 25.07.2034                            | 1.162          | 1.156                    | 0,03                              | 4,754 % fällig am 25.04.2036                         | 31             | 21                       | 0,00                              | Through Certificates                                 |                |                          |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.08.2037                            | 82             | 73                       | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.11.2036                         | 2.616          | 1.220                    | 0,03                              | 5,754 % fällig am 25.01.2036                         | 1.683          | 1.613                    | 0,04                              |
| 6,406 % fällig am 25.06.2043                            | 39             | 39                       | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.06.2036                         | 1.733          | 1.684                    | 0,04                              | People's Choice Home Loan Securities Trust           |                |                          |                                   |
| Carrington Mortgage Loan Trust                          |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.04.2036                         | 491            | 332                      | 0,01                              | 5,379 % fällig am 25.05.2035                         | 1.609          | 1.513                    | 0,04                              |
| 4,594 % fällig am 25.10.2036                            | 1.532          | 1.493                    | 0,04                              | Home Equity Asset Trust                              |                |                          |                                   | 5,784 % fällig am 25.01.2035                         | 125            | 122                      | 0,00                              |
| 4,684 % fällig am 25.10.2036                            | 824            | 626                      | 0,02                              | 5,529 % fällig am 25.05.2035                         | 49             | 49                       | 0,00                              | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust              |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.06.2036                            | 725            | 682                      | 0,02                              | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust         |                |                          |                                   | 4,644 % fällig am 25.01.2037                         | 552            | 532                      | 0,01                              |
| 5,334 % fällig am 25.05.2034                            | 282            | 300                      | 0,01                              | 4,594 % fällig am 25.07.2037                         | 712            | 391                      | 0,01                              | RAAC Trust                                           |                |                          |                                   |
| Centex Home Equity Loan Trust                           |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.04.2037                         | 770            | 594                      | 0,01                              | 5,194 % fällig am 25.10.2046                         | 1.077          | 1.052                    | 0,02                              |
| 5,364 % fällig am 25.09.2034                            | 253            | 250                      | 0,01                              | 4,674 % fällig am 25.04.2037                         | 799            | 541                      | 0,01                              | Renaissance Home Equity Loan Trust                   |                |                          |                                   |
| CIT Mortgage Loan Trust                                 |                |                          |                                   | HSI Asset Securitization Corp. Trust                 |                |                          |                                   | 2,654 % fällig am 25.09.2037                         | 685            | 477                      | 0,01                              |
| 6,684 % fällig am 25.10.2037                            | 7.511          | 7.589                    | 0,18                              | 4,624 % fällig am 25.01.2037                         | 800            | 572                      | 0,01                              | 5,134 % fällig am 25.08.2032                         | 10             | 9                        | 0,00                              |
| Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-        |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.12.2036                         | 4.051          | 1.013                    | 0,02                              | 5,612 % fällig am 25.04.2037                         | 3.152          | 732                      | 0,02                              |
| Through Certificates                                    |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.12.2036                         | 3.677          | 881                      | 0,02                              | Residential Asset Securities Corp. Trust             |                |                          |                                   |
| 5,379 % fällig am 25.10.2034                            | 165            | 160                      | 0,00                              | 4,959 % fällig am 25.02.2036                         | 6.100          | 5.188                    | 0,12                              | 4,774 % fällig am 25.11.2036                         | 1.401          | 1.311                    | 0,03                              |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                     |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 25.01.2036                         | 3.968          | 3.431                    | 0,08                              | 4,954 % fällig am 25.07.2036                         | 729            | 648                      | 0,02                              |
| 4,604 % fällig am 25.07.2045                            | 1.176          | 816                      | 0,02                              | IXIS Real Estate Capital Trust                       |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.07.2036                         | 1.042          | 912                      | 0,02                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.01.2037                         | 271            | 92                       | 0,00                              | 5,114 % fällig am 25.04.2037                         | 1.958          | 1.904                    | 0,04                              |
|                                                         |                |                          |                                   | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                  |                |                          |                                   | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust       |                |                          |                                   |
|                                                         |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.07.2036                         | 594            | 276                      | 0,01                              | 5,199 % fällig am 25.02.2034                         | 109            | 109                      | 0,00                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 4,839 % fällig am 25.07.2036                         | 1.563          | 1.545                    | 0,04                              |                                                      |                |                          |                                   |



| BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SG Mortgage Securities Trust</b>                          |                |                          |                                   | <b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>                  |                |                          |                                   | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                    |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.10.2036 \$                              | 1.800          | \$ 1.367                 | 0,03                              | 1,050 % fällig am 15.01.2031 €                        | 248            | \$ 286                   | 0,01                              | 7,250 % fällig am 25.05.2036 \$                               | 465            | \$ 231                   | 0,01                              |
| <b>Soundview Home Loan Trust</b>                             |                |                          |                                   | 2,999 % fällig am 15.01.2031                          | 4.703          | 5.525                    | 0,13                              | <b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>                     |                |                          |                                   |
| 4,514 % fällig am 25.06.2037                                 | 516            | 340                      | 0,01                              | <b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 25.12.2036                                  | 1.032          | 418                      | 0,01                              |
| 4,554 % fällig am 25.11.2036                                 | 255            | 69                       | 0,00                              | 2,929 % fällig am 15.10.2031                          | 1.473          | 1.727                    | 0,04                              | 5,154 % fällig am 25.11.2035                                  | 1.060          | 993                      | 0,02                              |
| 4,604 % fällig am 25.07.2037                                 | 628            | 555                      | 0,01                              | 3,056 % fällig am 22.07.2032                          | 5.793          | 6.781                    | 0,16                              | 5,334 % fällig am 25.07.2035                                  | 1.280          | 1.273                    | 0,03                              |
| 4,604 % fällig am 25.08.2037                                 | 1.915          | 1.676                    | 0,04                              | <b>Bosphorus CLO DAC</b>                              |                |                          |                                   | <b>Lehman XS Trust</b>                                        |                |                          |                                   |
| 4,644 % fällig am 25.06.2037                                 | 2.393          | 1.575                    | 0,04                              | 2,964 % fällig am 12.12.2032                          | 2.042          | 2.401                    | 0,06                              | 4,702 % fällig am 25.06.2036                                  | 544            | 533                      | 0,01                              |
| 4,714 % fällig am 25.06.2037                                 | 3.447          | 2.269                    | 0,05                              | <b>Cairn CLO DAC</b>                                  |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.05.2036                                  | 1.602          | 1.386                    | 0,03                              |
| 4,994 % fällig am 25.10.2036                                 | 276            | 273                      | 0,01                              | 3,059 % fällig am 15.10.2031                          | 3.861          | 4.525                    | 0,10                              | <b>RAAC Trust</b>                                             |                |                          |                                   |
| 5,334 % fällig am 25.10.2037                                 | 4.367          | 3.351                    | 0,08                              | <b>Cairn CLO DAC</b>                                  |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.06.2044                                  | 83             | 75                       | 0,00                              |
| <b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>                |                |                          |                                   | 2,856 % fällig am 31.01.2030                          | 3.075          | 3.601                    | 0,08                              | 5,294 % fällig am 25.03.2037                                  | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 5,409 % fällig am 25.01.2035                                 | 2.327          | 2.166                    | 0,05                              | <b>Carlyle Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   | <b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 5,559 % fällig am 25.01.2035                                 | 418            | 361                      | 0,01                              | 0,000 % fällig am                                     |                |                          |                                   | 5,174 % fällig am 25.05.2037                                  | 2.052          | 1.868                    | 0,04                              |
| 6,009 % fällig am 25.01.2035                                 | 456            | 377                      | 0,01                              | 15.08.2038 (b)                                        | 5.500          | 6.456                    | 0,15                              | <b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>         |                |                          |                                   |
| 6,159 % fällig am 25.01.2035                                 | 371            | 185                      | 0,00                              | 2,979 % fällig am 15.01.2031                          | 3.718          | 4.365                    | 0,10                              | 4,754 % fällig am 25.10.2036                                  | 9.139          | 3.036                    | 0,07                              |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b> |                |                          |                                   | <b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC</b>  |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.08.2035                                  | 1.471          | 1.094                    | 0,03                              |
| 4,589 % fällig am 25.09.2036                                 | 6.325          | 3.880                    | 0,09                              | 3,212 % fällig am 16.01.2033                          | 5.156          | 6.058                    | 0,14                              | 5,394 % fällig am 25.01.2036                                  | 176            | 167                      | 0,01                              |
| 4,614 % fällig am 25.01.2037                                 | 745            | 416                      | 0,01                              | <b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.</b> |                |                          |                                   | <b>Specialty Underwriting &amp; Residential Finance Trust</b> |                |                          |                                   |
| 4,934 % fällig am 25.11.2037                                 | 1.631          | 1.509                    | 0,04                              | 2,893 % fällig am 15.11.2031                          | 5.591          | 6.568                    | 0,15                              | 3,943 % fällig am 25.02.2037                                  | 1.401          | 456                      | 0,01                              |
| 5,124 % fällig am 25.09.2035                                 | 2.828          | 2.707                    | 0,06                              | <b>Clarinda Park CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.09.2037                                  | 440            | 151                      | 0,00                              |
| 5,439 % fällig am 25.11.2035                                 | 3.801          | 3.791                    | 0,09                              | 3,043 % fällig am 15.02.2034                          | 7.550          | 8.861                    | 0,20                              | 5,000 % fällig am 25.12.2036                                  | 641            | 633                      | 0,02                              |
| 5,939 % fällig am 25.04.2035                                 | 9              | 9                        | 0,00                              | <b>Contego CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
| <b>WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust</b>             |                |                          |                                   | 2,823 % fällig am 23.01.2030                          | 4.175          | 4.894                    | 0,11                              |                                                               |                |                          |                                   |
| 4,659 % fällig am 25.05.2037                                 | 2.644          | 2.482                    | 0,06                              | <b>CVC Cordatus Loan Fund DAC</b>                     |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.01.2037                                 | 9.090          | 4.130                    | 0,10                              | 2,605 % fällig am 15.09.2031                          | 2.015          | 2.365                    | 0,06                              |                                                               |                |                          |                                   |
| <b>Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust</b>     |                |                          |                                   | 2,886 % fällig am 21.07.2030                          | 5.066          | 5.957                    | 0,14                              |                                                               |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.05.2036                                 | 713            | 553                      | 0,01                              | 2,939 % fällig am 26.08.2032                          | 436            | 511                      | 0,01                              |                                                               |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.05.2036                                 | 583            | 452                      | 0,01                              | <b>Dryden Euro CLO DAC</b>                            |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
| <b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b> |                |                          |                                   | 2,939 % fällig am 15.04.2033                          | 6.715          | 7.880                    | 0,18                              |                                                               |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.04.2037                                 | 2.967          | 2.154                    | 0,05                              | 3,003 % fällig am 15.05.2034                          | 4.177          | 4.897                    | 0,11                              |                                                               |                |                          |                                   |
| 6,159 % fällig am 25.11.2035                                 | 2.781          | 2.780                    | 0,06                              | 3,243 % fällig am 17.01.2033                          | 3.701          | 4.339                    | 0,10                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                | 195.588                  | 4,50                              | <b>Euro-Galaxy CLO DAC</b>                            |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 2,811 % fällig am 24.04.2034                          | 3.787          | 4.436                    | 0,10                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b>         |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,256 % fällig am 20.07.2034                          | 3.000          | 3.522                    | 0,08                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Golub Capital Partners CLO Ltd.</b>                |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,592 % fällig am 25.10.2034 \$                       | 1.000          | 1.001                    | 0,02                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Hayfin Emerald CLO DAC</b>                         |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,586 % fällig am 18.07.2038 €                        | 2.500          | 2.940                    | 0,07                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,914 % fällig am 22.01.2039                          | 1.700          | 1.998                    | 0,05                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Jubilee CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 2,929 % fällig am 15.04.2031                          | 3.015          | 3.532                    | 0,08                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Madison Park Euro Funding DAC</b>                  |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,029 % fällig am 15.01.2032                          | 9.704          | 11.357                   | 0,26                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Man GLG Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 2,665 % fällig am 15.12.2031                          | 1.522          | 1.782                    | 0,04                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Massachusetts Educational Financing Authority</b>  |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,575 % fällig am 25.04.2038 \$                       | 228            | 228                      | 0,01                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Navient Student Loan Trust</b>                     |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,470 % fällig am 27.12.2066                          | 2.779          | 2.780                    | 0,06                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>OCP Euro CLO DAC</b>                               |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,116 % fällig am 22.09.2034 €                        | 5.036          | 5.911                    | 0,14                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Octagon Investment Partners Ltd.</b>               |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,488 % fällig am 15.04.2031 \$                       | 307            | 307                      | 0,01                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>        |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,143 % fällig am 15.05.2034 €                        | 3.199          | 3.752                    | 0,09                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,170 % fällig am 15.10.2034                          | 600            | 702                      | 0,02                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,203 % fällig am 15.02.2035                          | 7.500          | 8.804                    | 0,20                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Providus CLO DAC</b>                               |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,439 % fällig am 15.10.2038                          | 1.400          | 1.646                    | 0,04                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Sculptor European CLO DAC</b>                      |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,055 % fällig am 14.01.2032                          | 8.948          | 10.492                   | 0,24                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Sierra Madre Funding Ltd.</b>                      |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 4,806 % fällig am 07.09.2039 \$                       | 1.614          | 975                      | 0,02                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 4,826 % fällig am 07.09.2039                          | 9.261          | 5.607                    | 0,13                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>St. Paul's CLO DAC</b>                             |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,029 % fällig am 15.01.2032 €                        | 592            | 695                      | 0,02                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Toro European CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,185 % fällig am 12.01.2032                          | 5.900          | 6.920                    | 0,16                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Triaxx Prime CDO Ltd.</b>                          |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,220 % fällig am 02.10.2039                          |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,220 % fällig am 02.10.2039                          | 524            | 5                        | 0,00                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Trinitas Euro CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 15.07.2039                          | 1.318          | 13                       | 0,00                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | (b)                                                   | 1.600          | 1.878                    | 0,04                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   |                                                       | 216.117        | 4,97                     |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>SICHERHEITEN FÜR WHOLE LOANS</b>                   |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>     |                |                          |                                   |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,199 % fällig am 25.07.2036 \$                       | 4              | 4                        | 0,00                              |                                                               |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.08.2036                          | 8              | 8                        | 0,00                              |                                                               |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                 | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 8,875 % fällig am 28.02.2035         | ZAR 301.400    | \$ 15.837                | 0,36                              | 4,730 % fällig am 10.07.2025          | \$ 1.750       | \$ 1.748                 | 0,04                              | RTX Corp.                    |             |                          |                                   |
| 9,000 % fällig am 31.01.2040         | 362.150        | 17.621                   | 0,41                              | 4,830 % fällig am 11.07.2025          | 250            | 250                      | 0,01                              | 4,660 % fällig am 15.07.2025 | \$ 1.000    | \$ 998                   | 0,02                              |
| Turkey Government International Bond |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 06.08.2025 (b)      | 7.750          | 7.712                    | 0,18                              | Telus Corp.                  |             |                          |                                   |
| 7,625 % fällig am 15.05.2034         | \$ 8.300       | 8.516                    | 0,20                              | CBRE Services, Inc.                   |                |                          |                                   | 4,990 % fällig am 04.09.2025 | 550         | 545                      | 0,01                              |
|                                      |                | 603.249                  | 13,88                             | 4,640 % fällig am 24.07.2025          | 2.750          | 2.741                    | 0,06                              |                              |             | 112.389                  | 2,59                              |
|                                      |                |                          |                                   | 4,690 % fällig am 10.07.2025          | 1.250          | 1.248                    | 0,03                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,710 % fällig am 10.07.2025          | 950            | 949                      | 0,02                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Crown Castle, Inc.                    |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 5,030 % fällig am 22.07.2025          | 13.300         | 13.259                   | 0,30                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 5,030 % fällig am 24.07.2025          | 3.700          | 3.688                    | 0,08                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | CVS Corp.                             |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,920 % fällig am 14.07.2025          | 7.350          | 7.336                    | 0,17                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,920 % fällig am 15.07.2025          | 1.500          | 1.497                    | 0,03                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Dominion Energy, Inc.                 |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 18.07.2025          | 500            | 499                      | 0,01                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Enbridge, Inc.                        |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 11.07.2025          | 1.150          | 1.148                    | 0,03                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 21.07.2025          | 2.200          | 2.194                    | 0,05                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Global Payments, Inc.                 |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.07.2025          | 1.000          | 1.000                    | 0,02                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Harley-Davidson Funding Corp.         |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 5,070 % fällig am 04.08.2025          | 250            | 249                      | 0,01                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | HCA, Inc.                             |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 14.08.2025          | 1.950          | 1.938                    | 0,04                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 15.08.2025          | 2.050          | 2.037                    | 0,05                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Holcim Finance U.S. LLC               |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,670 % fällig am 15.07.2025          | 800            | 798                      | 0,02                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,670 % fällig am 16.07.2025          | 7.250          | 7.235                    | 0,17                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Intel Corp.                           |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,590 % fällig am 03.07.2025          | 6.250          | 6.248                    | 0,14                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Jabil, Inc.                           |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,850 % fällig am 14.07.2025          | 900            | 898                      | 0,02                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,860 % fällig am 02.07.2025          | 950            | 950                      | 0,02                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Jones Lang LaSalle Finance BV         |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,650 % fällig am 14.07.2025          | 600            | 599                      | 0,01                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,720 % fällig am 09.07.2025          | 2.450          | 2.447                    | 0,06                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,720 % fällig am 16.07.2025          | 600            | 599                      | 0,01                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | Mondelez International, Inc.          |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,570 % fällig am 11.08.2025          | 1.750          | 1.741                    | 0,04                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 23.07.2025          | 1.200          | 1.196                    | 0,03                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 19.08.2025          | 250            | 248                      | 0,01                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | NXP BV                                |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 02.07.2025          | 400            | 400                      | 0,01                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,640 % fällig am 10.09.2025          | 300            | 297                      | 0,01                              |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | ONEOK, Inc.                           |                |                          |                                   |                              |             |                          |                                   |
|                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 11.07.2025          | 750            | 749                      | 0,02                              |                              |             |                          |                                   |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                                                | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------|------------------|------------------|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOM        | 2,720 %    | 30.06.2025       | 09.07.2025       | CAD 200.000   | Province of Ontario 2,900 % -<br>3,450 % fällig am 02.06.2045 -<br>02.06.2049                  | \$ (150.270)               | \$ 146.574                     | \$ 146.708                                                     | 3,37                    |
|            | 2,730      | 20.06.2025       | 07.07.2025       | 20.000        | Hydro-Québec 4,000 % fällig<br>am 15.02.2063                                                   | (15.250)                   | 14.657                         | 14.683                                                         | 0,34                    |
| BUS        | 2,700      | 23.06.2025       | 07.07.2025       | 120.000       | Hydro-Québec 6,500 % fällig<br>am 15.02.2035                                                   | (45.193)                   | 87.944                         | 88.069                                                         | 2,02                    |
|            |            |                  |                  |               | Province of Quebec 3,500 % fällig<br>am 01.12.2048                                             | (45.327)                   |                                |                                                                |                         |
|            | 2,700      | 24.06.2025       | 08.07.2025       | 100.000       | Province of Ontario 2,650 % fällig<br>am 02.12.2050                                            | (75.375)                   | 73.287                         | 73.390                                                         | 1,69                    |
| CEW        | 2,720      | 16.06.2025       | 08.07.2025       | 200.000       | Canadian Government Real Return<br>Bond 0,250 % - 3,000 % fällig<br>am 01.12.2036 - 01.12.2054 | (153.235)                  | 146.574                        | 146.902                                                        | 3,38                    |
|            | 2,720      | 27.06.2025       | 07.07.2025       | 140.000       | Province of Alberta 3,100 % fällig<br>am 01.06.2050                                            | (87.654)                   | 102.602                        | 102.706                                                        | 2,36                    |
|            |            |                  |                  |               | Province of Quebec 3,500 % fällig<br>am 01.12.2045                                             | (18.481)                   |                                |                                                                |                         |
|            | 2,730      | 24.06.2025       | 08.07.2025       | 80.000        | Province of Alberta 3,050 % fällig<br>am 01.12.2048                                            | (2.987)                    | 58.630                         | 58.714                                                         | 1,35                    |
|            |            |                  |                  |               | Province of Ontario 2,900 % fällig<br>am 02.06.2049                                            | (56.884)                   |                                |                                                                |                         |

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                                                                        | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des Nettovermögens |
|-------------------------|------------|------------------|------------------|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------|----------------------------------------------------------|----------------------|
|                         | 2,730 %    | 25.06.2025       | 03.07.2025       | CAD 60.000    | Province of British Columbia 4,300 % fällig am 18.06.2042<br>Province of Quebec 4,200 % fällig am 01.12.2057           | \$ (36.414)<br>(8.587)  | \$ 43.972                   | \$ 44.008                                                | 1,01                 |
| DEU                     | 4,470      | 30.06.2025       | 01.07.2025       | \$ 100        | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027                                              | (102)                   | 100                         | 100                                                      | 0,00                 |
| FICC                    | 4,400      | 30.06.2025       | 01.07.2025       | 113.400       | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027                                                                       | (116.590)               | 113.400                     | 113.414                                                  | 2,61                 |
| MEI                     | 2,680      | 19.06.2025       | 03.07.2025       | CAD 40.000    | Canada Government International Bond 4,000 % fällig am 01.05.2026                                                      | (29.996)                | 29.315                      | 29.356                                                   | 0,67                 |
|                         | 2,680      | 23.06.2025       | 07.07.2025       | 151.361       | Canada Government International Bond 3,500 % fällig am 01.12.2057<br>Canada Housing Trust 2,650 % fällig am 15.12.2028 | (70.669)<br>(43.155)    | 110.928                     | 111.083                                                  | 2,55                 |
|                         | 2,680      | 27.06.2025       | 07.07.2025       | 48.639        | Province of Ontario 2,900 % fällig am 02.06.2028                                                                       | (36.471)                | 35.646                      | 35.682                                                   | 0,82                 |
| TOR                     | 2,700      | 25.06.2025       | 03.07.2025       | 50.000        | Province of Ontario 1,100 % fällig am 08.03.2029                                                                       | (39.838)                | 36.643                      | 36.673                                                   | 0,84                 |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |               |                                                                                                                        | \$ (1.032.478)          | \$ 1.000.272                | \$ 1.001.488                                             | 23,01                |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

#### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2026     | 432                  | \$ (322)                                  | (0,01)               |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2025     | 432                  | (699)                                     | (0,02)               |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2026     | 432                  | 83                                        | 0,00                 |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Long  | 06.2026     | 432                  | (111)                                     | 0,00                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2025     | 432                  | (559)                                     | (0,01)               |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures     | Long  | 09.2025     | 337                  | 261                                       | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025     | 911                  | 473                                       | 0,01                 |
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025     | 578                  | 628                                       | 0,01                 |
| Euro-Schatz September Futures                        | Short | 09.2025     | 1.191                | 230                                       | 0,01                 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures      | Short | 09.2025     | 195                  | (567)                                     | (0,01)               |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 2.044                | 1.609                                     | 0,04                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 11.188               | 11.280                                    | 0,26                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 1.757                | 3.307                                     | 0,07                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025     | 5.436                | (11.688)                                  | (0,27)               |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025     | 566                  | (2.288)                                   | (0,05)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2025     | 1.279                | (5.221)                                   | (0,12)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025     | 375                  | 1.103                                     | 0,02                 |
|                                                      |       |             |                      | \$ (2.481)                                | (0,06)               |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------|-----------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 69                   | \$ (23)  | \$ (2)    | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000       | 25.07.2025    | 118                  | (50)     | (4)       | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500       | 25.07.2025    | 58                   | (19)     | (4)       | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250       | 25.07.2025    | 33                   | (8)      | (4)       | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000       | 25.07.2025    | 69                   | (24)     | (52)      | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500       | 25.07.2025    | 176                  | (67)     | (94)      | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750       | 25.07.2025    | 33                   | (10)     | (14)      | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                    | € 117,250     | 25.07.2025    | 16                   | (4)      | (3)       | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                   | 118,500       | 25.07.2025    | 16                   | (3)      | (2)       | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                    | 129,000       | 25.07.2025    | 11                   | (5)      | (4)       | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                   | 132,500       | 25.07.2025    | 11                   | (6)      | (2)       | 0,00                 |
|                                                                |               |               |                      | \$ (219) | \$ (185)  | 0,00                 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                      |          |           | \$ (2.666) (0,06)    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

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

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

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

| Referenzeinheit           | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| AES Corp.                 | 5,000 %                        | 20.12.2025       | \$ 500                    | \$ (84)                                         | 0,00                    |
| AT&T, Inc.                | 1,000                          | 20.06.2026       | 2.700                     | (30)                                            | 0,00                    |
| Boeing Co.                | 1,000                          | 20.06.2026       | 100                       | 1                                               | 0,00                    |
| Deutsche Bank AG          | 1,000                          | 20.06.2030       | € 13.100                  | 32                                              | 0,00                    |
| General Electric Co.      | 1,000                          | 20.06.2026       | \$ 4.300                  | (10)                                            | 0,00                    |
| General Electric Co.      | 1,000                          | 20.12.2026       | 400                       | 1                                               | 0,00                    |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000                          | 20.06.2026       | 2.450                     | 1                                               | 0,00                    |
| Morgan Stanley            | 1,000                          | 20.06.2026       | 5.300                     | 4                                               | 0,00                    |
|                           |                                |                  |                           | \$ (85)                                         | 0,00                    |

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

| Index/Tranchen         | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-41 5-Year Index | (5,000) %                      | 20.12.2028       | \$ 44.164                 | \$ (716)                                        | (0,02)                  |

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

| Index/Tranchen                   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.IG-43 5-Year Index           | 1,000 %                        | 20.12.2029       | \$ 800                    | \$ (1)                                          | 0,00                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index           | 1,000                          | 20.06.2030       | 6.800                     | 34                                              | 0,00                    |
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index | 5,000                          | 20.06.2030       | € 10.970                  | 217                                             | 0,01                    |
|                                  |                                |                  |                           | \$ 250                                          | 0,01                    |

#### ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------|--------------------------------|-------------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                 | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %           | 19.03.2030       | £ 399.100  | \$ 6.962                                        | 0,16                    |
| Erhalt                                  | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,700             | 28.03.2034       | 2.100      | 59                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,930             | 06.01.2035       | 900        | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,750             | 21.12.2052       | \$ 24.100  | 4.216                                           | 0,10                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,842             | 19.09.2053       | 12.500     | 603                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,874             | 19.09.2053       | 11.700     | 585                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,999             | 03.07.2053       | 14.610     | 4.430                                           | 0,10                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,000             | 10.12.2029       | 40         | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,060             | 27.10.2053       | 7.600      | 2.388                                           | 0,05                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,250             | 20.06.2028       | 104.830    | (2.378)                                         | (0,06)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250             | 18.06.2055       | 67.500     | (1.543)                                         | (0,04)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500             | 18.12.2054       | 4.000      | 237                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,545             | 31.10.2030       | 7.700      | 8                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,550             | 31.10.2030       | 1.400      | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,572             | 31.10.2030       | 98.400     | (43)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,592             | 31.10.2030       | 80.660     | (124)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,595             | 31.10.2030       | 20.900     | (35)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,601             | 31.10.2030       | 18.500     | (37)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,602             | 31.10.2030       | 49.300     | (104)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,606             | 31.10.2030       | 46.900     | (109)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,623             | 31.10.2030       | 20.300     | (66)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,664             | 31.10.2030       | 13.400     | (74)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,677             | 31.10.2030       | 10.900     | (68)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,687             | 31.10.2030       | 45.000     | (305)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,691             | 31.10.2030       | 21.300     | (149)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,721             | 31.10.2030       | 43.900     | (381)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,739             | 31.10.2030       | 15.700     | (152)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,749             | 31.10.2030       | 29.000     | (296)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750             | 18.12.2029       | 118.230    | (1.505)                                         | (0,04)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750             | 18.12.2031       | 58.800     | (559)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750             | 15.05.2032       | 168.500    | (2.590)                                         | (0,06)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750             | 18.12.2034       | 73.800     | 1.384                                           | 0,03                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,800             | 14.07.2044       | 4.150      | 141                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,842             | 04.03.2030       | 2.400      | (36)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,870             | 05.03.2035       | 1.500      | (17)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,874             | 05.03.2035       | 2.100      | (24)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,884             | 25.03.2035       | 3.500      | (46)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,890             | 03.03.2035       | 2.050      | (26)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,899             | 11.03.2035       | 2.300      | (32)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,905             | 12.03.2035       | 4.300      | (63)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,908             | 04.03.2035       | 3.800      | (54)                                            | 0,00                    |



| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz        | Variable Zinssatzindex              | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag      | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------|------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,975 %           | 21.03.2035       | \$ 3.300        | \$ (69)                                         | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000             | 26.02.2035       | 3.000           | (67)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,100             | 10.02.2026       | 380.000         | 61                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 10,768            | 04.01.2027       | BRL 926.600     | (8.156)                                         | (0,19)                  |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 11,496            | 04.01.2027       | 109.600         | (680)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 11,566            | 04.01.2027       | 564.000         | (3.365)                                         | (0,08)                  |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                      | 11,691            | 04.01.2027       | 1.076.000       | 5.993                                           | 0,14                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,175            | 02.01.2029       | 560.600         | 403                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,291            | 02.01.2029       | 267.800         | 412                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,320            | 02.01.2029       | 39.000          | 67                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,354            | 02.01.2029       | 1.825.600       | 1.824                                           | 0,04                    |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                      | 13,545            | 02.01.2029       | 630.400         | (1.262)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,926            | 04.01.2027       | 70.000          | (37)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927            | 04.01.2027       | 62.500          | (36)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 14,009            | 04.01.2027       | 104.300         | (24)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                      | 14,028            | 04.01.2027       | 404.800         | 68                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500             | 01.06.2032       | CAD 45.000      | (894)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,500             | 28.04.2028       | COP 134.335.300 | (80)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,750             | 18.09.2030       | 84.774.500      | (32)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500             | 18.09.2034       | AUD 297.520     | 4.975                                           | 0,11                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500             | 18.06.2035       | 90.250          | 1.152                                           | 0,03                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,650             | 12.04.2027       | € 6.700         | (174)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,650             | 11.05.2027       | 5.800           | (137)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,700             | 11.04.2027       | 3.400           | (88)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,000             | 13.05.2027       | 7.200           | (140)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,000             | 18.05.2027       | 3.500           | (69)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,220             | 08.01.2035       | 1.800           | (64)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250             | 17.09.2030       | 25.600          | 328                                             | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250             | 17.09.2035       | 145.444         | (505)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250             | 17.09.2055       | 47.700          | 3.484                                           | 0,08                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,280             | 04.03.2030       | 1.700           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,350             | 29.04.2030       | 3.500           | (14)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,400             | 09.04.2030       | 2.200           | (13)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,400             | 12.02.2035       | 1.900           | 41                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,415             | 09.07.2035       | 81.800          | (235)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,420             | 07.03.2035       | 700             | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,450             | 05.05.2035       | 1.300           | 23                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,460             | 13.03.2035       | 1.700           | (17)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,460             | 01.04.2035       | 800             | (9)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520             | 27.03.2035       | 1.400           | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520             | 09.04.2035       | 1.500           | 16                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,550             | 16.04.2035       | 1.500           | 11                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,576             | 09.07.2035       | 83.200          | 211                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,610             | 24.03.2035       | 1.200           | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,760             | 04.03.2034       | 760             | 20                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,770             | 16.04.2029       | 5.100           | 145                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,780             | 02.05.2029       | 1.090           | 32                                              | 0,00                    |
|                                                |                                     |                   |                  |                 | \$ 13.287                                       | 0,30                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                     |                   |                  |                 | \$ 12.736                                       | 0,29                    |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|-----------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,255 %            | 16.08.2039         | 44.400                         | \$ 4.251  | \$ 3.360       | 0,08                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,255              | 16.08.2039         | 44.400                         | 4.251     | 5.320          | 0,12                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,470              | 04.06.2035         | 14.500                         | 1.300     | 1.336          | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 4,470              | 04.06.2035         | 14.500                         | 1.300     | 1.270          | 0,03                         |
| CBK        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,750              | 30.10.2025         | 11.200                         | 60        | 39             | 0,00                         |
| DUB        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,750              | 30.10.2025         | 378.700                        | 2.030     | 1.310          | 0,03                         |
| FAR        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,750              | 01.08.2025         | 985.100                        | 6.009     | 855            | 0,02                         |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,808              | 31.07.2034         | 22.800                         | 1.999     | 1.574          | 0,04                         |
| MYC        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,808              | 31.07.2034         | 22.800                         | 2.000     | 2.342          | 0,05                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,800              | 12.07.2034         | 41.500                         | 3.587     | 2.834          | 0,06                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,800              | 12.07.2034         | 41.500                         | 3.587     | 4.254          | 0,10                         |
|            |                                       |                         |                                      |                    |                    |                                | \$ 30.374 | \$ 24.494      | 0,56                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850 %            | 16.07.2025         | 2.900                          | \$ (4)  | \$ 0           | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 1,000              | 16.07.2025         | 3.900                          | (4)     | 0              | 0,00                         |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850              | 16.07.2025         | 7.200                          | (9)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900              | 16.07.2025         | 4.500                          | (5)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                  |                     |                    |                    |                                | \$ (22) | \$ (1)         | 0,00                         |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,555 %            | 24.07.2025         | 3.200                          | (10)    | (11)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,637              | 18.07.2025         | 4.500                          | (14)    | (22)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,700              | 21.07.2025         | 4.000                          | (13)    | (31)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,770              | 09.07.2025         | 2.400                          | (8)     | (22)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,905              | 24.07.2025         | 3.200                          | (10)    | (6)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,037              | 18.07.2025         | 4.500                          | (14)    | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,050              | 21.07.2025         | 4.000                          | (13)    | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,120              | 09.07.2025         | 2.400                          | (8)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 2,830              | 30.10.2025         | 11.200                         | (22)    | (7)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,290              | 30.10.2025         | 11.200                         | (38)    | (16)           | 0,00                         |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,564              | 24.07.2025         | 3.400                          | (11)    | (13)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,605              | 23.07.2025         | 3.800                          | (14)    | (18)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,914              | 24.07.2025         | 3.400                          | (10)    | (6)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,955              | 23.07.2025         | 3.800                          | (13)    | (4)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,380              | 03.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,460              | 16.07.2025         | 2.200                          | (7)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,640              | 03.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,720              | 16.07.2025         | 2.200                          | (7)     | (4)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 2,830              | 30.10.2025         | 378.700                        | (773)   | (223)          | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,290              | 30.10.2025         | 378.700                        | (1.265) | (526)          | (0,01)                       |
| FAR        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 2,750              | 01.08.2025         | 985.100                        | (2.266) | (16)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,250              | 01.08.2025         | 985.100                        | (3.743) | (104)          | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,750              | 03.07.2025         | 5.200                          | (20)    | (35)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,790              | 09.07.2025         | 3.000                          | (10)    | (31)           | 0,00                         |
| GLM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,100              | 03.07.2025         | 5.200                          | (19)    | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,140              | 09.07.2025         | 3.000                          | (10)    | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,525              | 28.07.2025         | 7.700                          | (25)    | (25)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,583              | 23.07.2025         | 1.900                          | (7)     | (8)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,653              | 14.07.2025         | 3.600                          | (11)    | (16)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,680              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,695              | 17.07.2025         | 4.800                          | (14)    | (33)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,775              | 07.07.2025         | 3.900                          | (12)    | (35)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,875              | 28.07.2025         | 7.700                          | (25)    | (20)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 3,933              | 23.07.2025         | 1.900                          | (7)     | (3)            | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,030              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,053              | 14.07.2025         | 3.600                          | (11)    | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,095              | 17.07.2025         | 4.800                          | (14)    | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,125              | 07.07.2025         | 3.900                          | (12)    | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,772              | 10.07.2025         | 5.600                          | (18)    | (53)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,122              | 10.07.2025         | 5.600                          | (18)    | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,664              | 14.07.2025         | 4.200                          | (13)    | (20)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,669              | 07.07.2025         | 4.900                          | (18)    | (16)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,697              | 16.07.2025         | 3.500                          | (10)    | (24)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,715              | 02.07.2025         | 3.400                          | (12)    | (14)           | 0,00                         |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,725              | 03.07.2025         | 3.400                          | (13)    | (18)           | 0,00                         |

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|------------|------------|-----------------------|
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,019 %        | 07.07.2025     | 4.900                      | \$ (18)    | \$ 0       | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,064          | 14.07.2025     | 4.200                      | (13)       | (1)        | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,065          | 02.07.2025     | 3.400                      | (12)       | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,075          | 03.07.2025     | 3.400                      | (13)       | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,097          | 16.07.2025     | 3.500                      | (10)       | (1)        | 0,00                  |
|            |                                      |                         |                                   |                |                |                            | \$ (8.626) | \$ (1.391) | (0,03)                |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit      | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|----------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|-----------------------|
| GST        | SoftBank Group Corp. | 1,000 %                     | 20.06.2026        | \$ 900                     | \$ (8)                                | \$ 4                                     | \$ (4)     | 0,00                  |

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

| Kontrahent | Index/Tranchen       | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|----------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|-----------------------|
| GST        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 %                     | 17.11.2059        | \$ 800                     | \$ (24)                               | \$ 27                                    | \$ 3       | 0,00                  |
| MYC        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                       | 17.11.2059        | 11.000                     | (379)                                 | 426                                      | 47         | 0,00                  |
| UAG        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                       | 17.11.2059        | 10.900                     | (378)                                 | 425                                      | 47         | 0,00                  |
|            |                      |                             |                   |                            | \$ (781)                              | \$ 878                                   | \$ 97      | 0,00                  |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025           | AUD                 | 32.239                | \$ 20.943                     | \$ 0                            | \$ (185)                                      | 0,00                 |
|            | 07.2025           | CNH                 | 62.450                | 8.668                         | 0                               | (60)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025           | €                   | 1.792                 | 2.098                         | 0                               | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$                  | 1.364                 | NZD 2.267                     | 12                              | 12                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025           | CNH                 | 100.342               | \$ 13.966                     | 0                               | (94)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025           | NZD                 | 2.267                 | 1.366                         | 0                               | (12)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025           | \$                  | 20.955                | AUD 32.239                    | 186                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 2.103                 | 1.792                         | 5                               | 5                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | DOP                 | 18.406                | \$ 308                        | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | IDR                 | 51.171.090            | 3.136                         | 0                               | (15)                                          | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025           | \$                  | 1.932                 | AUD 2.980                     | 21                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$                  | 8.947                 | KRW 12.196.901                | 71                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | €                   | 873                   | SGD 1.118                     | 5                               | 5                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | ZAR                 | 898.859               | \$ 50.148                     | 0                               | (351)                                         | (0,01)               |
|            | 08.2025           | PEN                 | 14.378                | 3.904                         | 0                               | (143)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025           | SGD                 | 1.115                 | 873                           | 0                               | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025           | TWD                 | 132.993               | 4.151                         | 0                               | (472)                                         | (0,01)               |
|            | 08.2025           | \$                  | 15.651                | CNH 111.919                   | 32                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | \$                  | 18.106                | MXN 343.413                   | 0                               | (17)                                          | 0,00                 |
|            | 09.2025           | €                   | 19                    | PEN 71                        | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | BRL                 | 107.626               | \$ 18.780                     | 0                               | (939)                                         | (0,02)               |
|            | 07.2025           | CAD                 | 320.292               | 233.853                       | 137                             | (1.082)                                       | (0,02)               |
|            | 07.2025           | €                   | 130                   | 150                           | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025           | IDR                 | 282.727.055           | 17.334                        | 0                               | (79)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025           | INR                 | 2.136.139             | 24.970                        | 70                              | 0                                             | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025           | KRW                 | 94.890                | 70                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | PEN                 | 5.016                 | 1.374                         | 0                               | (39)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025           | THB                 | 3.573                 | 108                           | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025           | TWD                 | 312.714               | 9.623                         | 0                               | (1.142)                                       | (0,03)               |
|            | 07.2025           | \$                  | 1.572                 | AUD 2.422                     | 15                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | €                   | 25.328                | BRL 141.238                   | 550                             | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025           | €                   | 1.812                 | 1.597                         | 62                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | €                   | 14.707                | IDR 239.762.694               | 61                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | €                   | 12.120                | KRW 16.646.832                | 193                             | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025           | €                   | 1.410                 | THB 46.525                    | 23                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025           | €                   | 23.411                | TWD 696.225                   | 484                             | 0                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025           | CNH                 | 33.542                | \$ 4.696                      | 0                               | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025           | TWD                 | 259.376               | 7.958                         | 0                               | (1.058)                                       | (0,02)               |
|            | 08.2025           | \$                  | 6.092                 | CNH 43.452                    | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 1.150                 | INR 99.978                    | 13                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025           | €                   | 12.274                | MXN 233.793                   | 40                              | 0                                             | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| BRC        | 06.2026               | \$                     | 92                       | KWD                              | 28                                 | \$                                                   | 0                       | 0,00   |
|            | 05.2030               | KWD                    | 1.132                    | \$                               | 3.900                              |                                                      | 156                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | €                      | 498.666                  |                                  | 566.367                            |                                                      | 0                       | (0,44) |
|            | 07.2025               | £                      | 6.248                    |                                  | 8.447                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | IDR                    | 67.722.718               |                                  | 4.147                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | ILS                    | 6.469                    |                                  | 1.916                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | KRW                    | 95.770                   |                                  | 70                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | NOK                    | 639                      |                                  | 63                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | PLN                    | 2.214                    |                                  | 591                                |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | TRY                    | 925                      |                                  | 23                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 9.265                    | AUD                              | 14.337                             |                                                      | 131                     | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 115.654                  | £                                | 85.017                             |                                                      | 849                     | 0,02   |
|            | 07.2025               |                        | 3.864                    | ILS                              | 13.452                             |                                                      | 131                     | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 4.732                    | KRW                              | 6.460.970                          |                                                      | 45                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 4.000                    | THB                              | 130.226                            |                                                      | 10                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 23.038                   | TRY                              | 945.622                            |                                                      | 538                     | 0,01   |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 978.770                  | \$                               | 54.121                             |                                                      | 0                       | (0,02) |
|            | 08.2025               | £                      | 83.115                   |                                  | 113.102                            |                                                      | 0                       | (0,02) |
|            | 08.2025               | \$                     | 61.528                   | TRY                              | 2.563.172                          |                                                      | 741                     | 0,02   |
|            | 09.2025               | PEN                    | 28.595                   | \$                               | 7.839                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | \$                     | 469                      | PEN                              | 1.695                              |                                                      | 8                       | 0,00   |
|            | 11.2025               | PEN                    | 46.429                   | \$                               | 12.633                             |                                                      | 0                       | (0,01) |
|            | BSH                   | 07.2025                | CAD                      | 3.396                            |                                    | 2.465                                                |                         | 0      |
| 07.2025    |                       | DKK                    | 580                      |                                  | 88                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
| 07.2025    |                       | PEN                    | 50.091                   |                                  | 13.580                             |                                                      | 0                       | (0,01) |
| 07.2025    |                       | \$                     | 8.754                    | PEN                              | 31.761                             |                                                      | 193                     | 0,01   |
| 09.2025    |                       | PEN                    | 34.212                   | \$                               | 9.341                              |                                                      | 0                       | (0,01) |
| 11.2025    |                       |                        | 26.066                   |                                  | 7.072                              |                                                      | 0                       | (0,01) |
| 11.2025    |                       | \$                     | 11                       | PEN                              | 39                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
| 07.2025    |                       | AUD                    | 1.400                    | \$                               | 914                                |                                                      | 0                       | 0,00   |
| 07.2025    |                       | CAD                    | 402.478                  |                                  | 293.223                            |                                                      | 0                       | (0,04) |
| 07.2025    |                       | €                      | 13.925                   |                                  | 15.994                             |                                                      | 0                       | (0,01) |
| 07.2025    |                       | £                      | 273                      |                                  | 371                                |                                                      | 0                       | 0,00   |
| 07.2025    |                       | KRW                    | 30.940.602               |                                  | 22.543                             |                                                      | 0                       | (0,01) |
| CBK        | 07.2025               | PEN                    | 105.507                  |                                  | 29.206                             |                                                      | 0                       | (0,01) |
|            | 07.2025               | SEK                    | 8.405                    |                                  | 885                                |                                                      | 3                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | THB                    | 186.966                  |                                  | 5.622                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | TWD                    | 545.029                  |                                  | 16.753                             |                                                      | 0                       | (0,05) |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.672                    | AUD                              | 2.578                              |                                                      | 17                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 21.402                   | CAD                              | 29.331                             |                                                      | 94                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 345                      | CNY                              | 2.473                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 8.022                    | £                                | 5.911                              |                                                      | 79                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 5.648                    | IDR                              | 91.968.766                         |                                                      | 16                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 558                      | KRW                              | 758.686                            |                                                      | 3                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 49.350                   | PEN                              | 176.455                            |                                                      | 364                     | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 12.972                   | SGD                              | 16.674                             |                                                      | 119                     | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 408                      | THB                              | 13.622                             |                                                      | 11                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 65.652                   | TWD                              | 1.939.053                          |                                                      | 1.101                   | 0,03   |
|            | 08.2025               | CNH                    | 19.883                   | \$                               | 2.766                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | PEN                    | 126.317                  |                                  | 34.422                             |                                                      | 0                       | (0,03) |
|            | 08.2025               | TWD                    | 604.041                  |                                  | 18.538                             |                                                      | 0                       | (0,06) |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.740                    | COP                              | 11.427.716                         |                                                      | 43                      | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 24.155                   | INR                              | 2.079.159                          |                                                      | 52                      | 0,00   |
|            | 09.2025               | PEN                    | 106.727                  | \$                               | 29.857                             |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | \$                     | 6.568                    | PEN                              | 23.470                             |                                                      | 30                      | 0,00   |
|            | 11.2025               | PEN                    | 150.955                  | \$                               | 41.050                             |                                                      | 0                       | (0,03) |
|            | 11.2025               | \$                     | 27                       | PEN                              | 100                                |                                                      | 1                       | 0,00   |
|            | 12.2025               | PEN                    | 57.481                   | \$                               | 15.931                             |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 46.567                   |                                  | 12.671                             |                                                      | 0                       | (0,01) |
|            | 07.2025               | SGD                    | 187                      |                                  | 145                                |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.521                    | AUD                              | 2.362                              |                                                      | 27                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 69                       | DKK                              | 437                                |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 575.008                  | €                                | 495.653                            |                                                      | 6.815                   | 0,16   |
|            | 07.2025               |                        | 1.885                    | ILS                              | 6.533                              |                                                      | 55                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 3.167                    | INR                              | 271.566                            |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 1.419                    | TWD                              | 42.181                             |                                                      | 33                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 97                       | \$                               | 5                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | DKK                    | 436                      |                                  | 69                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | €                      | 494.567                  |                                  | 575.008                            |                                                      | 0                       | (0,16) |
|            | 08.2025               | INR                    | 272.118                  |                                  | 3.167                              |                                                      | 1                       | 0,00   |
| 08.2025    | \$                    | 25.180                 | CNH                      | 180.027                          |                                    | 47                                                   | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                       | 11.442                 | INR                      | 984.612                          |                                    | 17                                                   | 0,00                    |        |
| 09.2025    |                       | 0                      | MXN                      | 2                                |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| FAR        | 07.2025               | AUD                    | 2.422                    | \$                               | 1.584                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | BRL                    | 506.820                  |                                  | 88.646                             |                                                      | 0                       | (0,10) |
|            | 07.2025               | CAD                    | 42.624                   |                                  | 31.420                             |                                                      | 182                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | CHF                    | 5.026                    |                                  | 6.103                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | CNH                    | 31.768                   |                                  | 4.421                              |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | ¥                      | 2.379.315                |                                  | 16.585                             |                                                      | 113                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | SGD                    | 473                      |                                  | 368                                |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 8.142                    | AUD                              | 12.619                             |                                                      | 128                     | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 779                      | CHF                              | 624                                |                                                      | 4                       | 0,00   |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |        |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |        |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |        |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025               | \$                     | 93                       | DKK 593                          | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 12.661                   | ¥ 1.842.882                      | 98                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4.570                    | PLN 16.852                       | 92                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 702                      | SGD 895                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CHF                    | 621                      | \$ 779                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 35.403                   | 4.947                            | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DKK                    | 592                      | 93                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 1.836.105                | 12.661                           | 0                                  | (98)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 893                      | 702                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.584                    | AUD 2.422                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 24.994                   | CNH 178.768                      | 57                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 1.908                    | INR 164.988                      | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 103.253                  | \$ 28.153                        | 0                                  | (884)                                                | (0,02)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 3.176                    | MXN 61.836                       | 71                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 2.372                    | PEN 8.600                        | 47                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025               | BRL                    | 379.838                  | \$ 68.501                        | 0                                  | (1.094)                                              | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | DOP                    | 20.848                   | 325                              | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 3.955.641                | 242                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 30.774                   | 8.603                            | 0                                  | (64)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 56.613                   | 1.740                            | 0                                  | (209)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.339                    | IDR 21.815.388                   | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 273                      | SGD 347                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 134                      | TWD 4.374                        | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 3.350                    | \$ 185                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 73.273                   | 202                              | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 347                      | 273                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 1.008                    | 31                               | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | DOP                    | 7.146                    | 120                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| IND        | 09.2025               | \$                     | 68.501                   | BRL 385.733                      | 1.110                              | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 07.2025               |                        | 890                      | SEK 8.416                        | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SEK                    | 8.398                    | \$ 890                           | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 88.849                   | 2.735                            | 0                                  | (353)                                                | (0,01)                  |
| JPM        | 07.2025               | CNH                    | 60.187                   | 8.339                            | 0                                  | (72)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | DKK                    | 450                      | 68                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 17.600.442               | 12.906                           | 0                                  | (112)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 4.746                    | 2.830                            | 0                                  | (51)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 23.793                   | 6.335                            | 0                                  | (248)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 12.530                   | 9.755                            | 0                                  | (83)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 317.717                  | 9.774                            | 0                                  | (1.163)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 145.822                  | BRL 852.696                      | 10.412                             | 0                                                    | 0,24                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.903                    | CAD 5.344                        | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 17.965                   | KRW 24.469.041                   | 127                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 8.223                    | PLN 30.394                       | 184                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 572                      | SGD 732                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.767                    | TWD 111.841                      | 83                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 360.633                  | \$ 20.180                        | 0                                  | (81)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | BRL                    | 102.604                  | 17.969                           | 0                                  | (686)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | CNH                    | 92.922                   | 12.926                           | 0                                  | (96)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 730                      | 572                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 1.012.890                | 30.950                           | 0                                  | (4.258)                                              | (0,10)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 6.071                    | CNH 43.392                       | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 08.2025               |                        | 1.286                    | INR 111.507                      | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | AUD                    | 3.121                    | \$ 2.008                         | 0                                  | (37)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CAD                    | 429.148                  | 315.302                          | 955                                | (260)                                                | 0,02                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 28.854                   | 4.004                            | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 22.169                   | 25.387                           | 0                                  | (636)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | £                      | 5.156                    | 6.974                            | 0                                  | (91)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | HKD                    | 6.295                    | 805                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 864.751                  | 53                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 108.676                  | 756                              | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 17.010                   | 4.543                            | 0                                  | (163)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 30.101                   | 23.463                           | 0                                  | (170)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 93.854                   | 2.836                            | 0                                  | (54)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 151.957                  | 4.663                            | 0                                  | (569)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 848                      | CAD 1.166                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5.394                    | CHF 4.401                        | 135                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 45.568                   | € 39.301                         | 565                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.140                    | £ 2.317                          | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.181                    | IDR 19.182.475                   | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.490                    | NZD 2.479                        | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 15.081                   | SGD 19.503                       | 231                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 4.632                    | THB 150.739                      | 17                                 | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5.979                    | TWD 189.473                      | 544                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CAD                    | 1.164                    | \$ 848                           | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 217.133                  | 30.243                           | 0                                  | (184)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 19.458                   | 15.081                           | 0                                  | (235)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | TWD                    | 271.533                  | 8.398                            | 0                                  | (1.040)                                              | (0,02)                  |
| MYI        | 08.2025               | \$                     | 10.419                   | CNH 75.487                       | 159                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 699                      | \$ 959                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 53.748                   | 372                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.516                    | CAD 3.442                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 141                      | € 120                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| RYL<br>SCX | 07.2025               |                        | 532 £                    | 388 \$                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4.026 ¥                  | 587.122                          | 39                                 | 39                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 599 NOK                  | 6.043                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 24 PLN                   | 88                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 36.085 \$                | 5.040                            | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 584.964                  | 4.026                            | 0                                  | (39)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 6.042                    | 599                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CAD                    | 50.030                   | 36.500                           | 0                                  | (167)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.537                    | 1.843                            | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNY                    | 2.478                    | 346                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 68.375.388               | 4.190                            | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 918.000                  | 6.446                            | 91                                 | 91                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 83.902                   | 23.404                           | 0                                  | (226)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 6.226                    | IDR 101.456.417                  | 22                                 | 22                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 29                       | ILS 99                           | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 21.751                   | INR 1.865.085                    | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | ¥ 728                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4.201                    | PEN 15.055                       | 39                                 | 39                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.012                    | SGD 3.884                        | 38                                 | 38                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 30.519                   | TWD 898.825                      | 424                                | 424                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 165.179                  | \$ 22.968                        | 0                                  | (178)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.868.909                | 21.751                           | 10                                 | 10                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 726                      | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 3.876                    | 3.012                            | 0                                  | (39)                                                 | 0,00                    |
| SOG        | 08.2025               | TWD                    | 85.004                   | 2.605                            | 0                                  | (349)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 36.156                   | CNH 261.656                      | 510                                | 510                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 346                      | CNY 2.472                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 5.065                    | INR 434.874                      | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 7.414                    | \$ 2.048                         | 0                                  | (37)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 351                      | 405                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.232                    | CAD 1.680                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 590                      | ¥ 85.171                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 63                       | NOK 629                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 3.459                    | \$ 10                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 84.858                   | 590                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 629                      | 63                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 08.2025               | \$                     | 8                        | INR 666                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 81.535                   | \$ 110.398                       | 0                                  | (1.333)                                              | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.231                    | CAD 1.677                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | 9.327                    | \$ 2.528                         | 0                                  | (91)                                                 | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | IDR                    | 68.071.056               | 4.195                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 35.070                   | 242                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 6.414.978                | 4.730                            | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 6.033                    | 594                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 14.948                   | 450                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.138                    | £ 840                            | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4.195                    | IDR 68.053.312                   | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 275                      | ILS 989                          | 18                                 | 18                                                   | 0,00                    |
| WST        | 07.2025               |                        | 4.730                    | KRW 6.411.876                    | 11                                 | 11                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 61.725                   | \$ 3.184                         | 0                                  | (57)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.215                    | AUD 1.884                        | 20                                 | 20                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 6.796                    | ¥ 978.644                        | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 975.042                  | \$ 6.796                         | 20                                 | 20                                                   | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 30.439                        | \$ (66.157)                        | \$ (35.718)                                          | (0,82)                  |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CAD                    | 1.866 \$                 | 1.368                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 08.2025               | \$                     | 1.368                    | CAD 1.863                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 52                       | 71                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               |                        | 2.231                    | 3.072                            | 20                                 | 20                                                   | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               |                        | 2.384                    | 3.295                            | 31                                 | 31                                                   | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               |                        | 76                       | 103                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | CAD                    | 3.330                    | \$ 2.423                         | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.383                    | CAD 3.272                        | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
| SCX        | 08.2025               |                        | 2.423                    | 3.325                            | 18                                 | 18                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | CAD                    | 3.333                    | \$ 2.442                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.442                    | CAD 3.327                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 86                            | \$ (19)                            | \$ 67                                                | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025           | CHF 3.388           | \$ 4.242              | \$ 0                          | \$ (14)                         | \$ (14)                                        | 0,00                 |
|            | 08.2025           | \$ 4.242            | CHF 3.374             | 14                            | 0                               | 14                                             | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025           | 78                  | 64                    | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025           | CHF 53              | \$ 64                 | 0                             | (3)                             | (3)                                            | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025           | \$ 15               | CHF 12                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025           | CHF 3.368           | \$ 4.208              | 0                             | (24)                            | (24)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$ 4.023            | CHF 3.313             | 139                           | 0                               | 139                                            | 0,01                 |
|            | 08.2025           | 4.208               | 3.355                 | 24                            | 0                               | 24                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025           | CHF 18              | \$ 22                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$ 4.173            | CHF 3.427             | 133                           | 0                               | 133                                            | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025           | 3.850               | 3.158                 | 117                           | 0                               | 117                                            | 0,00                 |
|            |                   |                     |                       | \$ 429                        | \$ (41)                         | \$ 388                                         | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und G Retail EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025           | € 42.842            | \$ 50.163             | \$ 0                          | \$ (127)                        | \$ (127)                                       | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$ 45.179           | € 39.763              | 1.496                         | 0                               | 1.496                                          | 0,03                 |
|            | 08.2025           | 50.273              | 42.842                | 127                           | 0                               | 127                                            | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025           | 47.688              | 41.940                | 1.543                         | 0                               | 1.543                                          | 0,04                 |
| BPS        | 07.2025           | € 73                | \$ 85                 | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025           | 51                  | 58                    | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$ 47.776           | € 42.069              | 1.607                         | 0                               | 1.607                                          | 0,04                 |
| CBK        | 07.2025           | € 224               | \$ 256                | 0                             | (7)                             | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$ 183              | € 160                 | 4                             | 0                               | 4                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025           | € 42.734            | \$ 49.575             | 0                             | (588)                           | (588)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025           | \$ 49.575           | € 42.640              | 587                           | 0                               | 587                                            | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025           | € 19                | \$ 22                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$ 2.056            | € 1.778               | 31                            | 0                               | 31                                             | 0,00                 |
|            |                   |                     |                       | \$ 5.395                      | \$ (724)                        | \$ 4.671                                       | 0,11                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025           | £ 811.518           | \$ 1.113.565          | \$ 1.502                      | \$ 0                            | \$ 1.502                                       | 0,03                 |
|            | 08.2025           | \$ 1.113.721        | £ 811.518             | 0                             | (1.497)                         | (1.497)                                        | (0,03)               |
| BRC        | 07.2025           | £ 875.910           | \$ 1.191.720          | 0                             | (8.584)                         | (8.584)                                        | (0,20)               |
|            | 07.2025           | \$ 1.098.599        | £ 813.663             | 16.405                        | (1)                             | 16.404                                         | 0,38                 |
|            | 08.2025           | 1.172.923           | 861.939               | 8.407                         | 0                               | 8.407                                          | 0,19                 |
| CBK        | 07.2025           | 7.471               | 5.513                 | 84                            | 0                               | 84                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025           | 1.144.187           | 849.320               | 19.679                        | 0                               | 19.679                                         | 0,46                 |
| MBC        | 07.2025           | 35.413              | 26.094                | 346                           | (1)                             | 345                                            | 0,01                 |
| SSB        | 07.2025           | £ 854.425           | \$ 1.171.585          | 724                           | 0                               | 724                                            | 0,02                 |
|            | 07.2025           | \$ 1.146.310        | £ 846.599             | 13.826                        | 0                               | 13.826                                         | 0,32                 |
|            | 08.2025           | 1.171.736           | 854.425               | 0                             | (706)                           | (706)                                          | (0,02)               |
| UAG        | 07.2025           | 900                 | 664                   | 11                            | 0                               | 11                                             | 0,00                 |
|            |                   |                     |                       | \$ 60.984                     | \$ (10.789)                     | \$ 50.195                                      | 1,16                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BRC        | 07.2025           | \$ 5                | NOK 50                | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025           | 0                   | 2                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025           | NOK 46              | \$ 5                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025           | \$ 5                | NOK 50                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025           | 5                   | 46                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| RYL        | 07.2025           | 0                   | 1                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SOG        | 07.2025           | NOK 51              | \$ 5                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025           | \$ 5                | NOK 51                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025           | 4                   | 45                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                   |                     |                       | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 0                                | \$                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        |                          | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               |                        |                          | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| IND        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               |                        |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               |                        |                          | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 58                            | \$ (23)                            | \$ 35                                                | 0,00                    |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 42.833 0,99

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                          |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 10.500      | \$ 1.260                 | 0,03                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | \$ 1.260                 | 0,03                         |

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

|                                       |        |                |         |
|---------------------------------------|--------|----------------|---------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>          |        |                |         |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |        |                |         |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055          | 56.000 | (44.343)       | (1,02)  |
| 2,000 % fällig am 01.08.2055          | 44.900 | (35.569)       | (0,82)  |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere       |        | \$ (79.912)    | (1,84)  |
| Summe Anlagen                         |        | \$ 6.837.481   | 157,30  |
| Sonstige Aktiva und Passiva           |        | \$ (2.490.665) | (57,30) |
| Nettovermögen                         |        | \$ 4.346.816   | 100,00  |

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

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only - („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (e) Nullkuponwertpapier.
- (f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (h) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (i) Mit dem Fonds verbunden.
- (j) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,12 %):

| Emittentenbeschreibung                                        | Kauf-<br>datum | Kosten    | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------------------------|----------------|-----------|----------------|-------------------------|
| Altice France S.A. 11,500 % fällig am 01.02.2027              | 20.12.2023     | \$ 2.168  | \$ 2.286       | 0,05                    |
| Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 | 10.06.2022     | 0         | 0              | 0,00                    |
| Hardwood Funding LLC 4,840 % fällig am 07.06.2028             | 11.03.2025     | 1.200     | 1.207          | 0,03                    |
| Hardwood Funding LLC 4,980 % fällig am 07.06.2030             | 11.03.2025     | 1.600     | 1.616          | 0,04                    |
| Hardwood Funding LLC 5,160 % fällig am 07.06.2032             | 11.03.2025     | 1.400     | 1.417          | 0,03                    |
| Hardwood Funding LLC 5,430 % fällig am 07.06.2037             | 11.03.2025     | 1.500     | 1.521          | 0,03                    |
| Intelsat Emergence S.A.                                       | 05.09.2018     | 2.000     | 668            | 0,01                    |
| Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032                   | 29.07.2022     | 2.682     | 2.499          | 0,06                    |
|                                                               |                | \$ 12.550 | \$ 11.214      | 0,25                    |

- (l) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 16.523 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.867 USD (31. Dezember 2024: 3.115 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 73 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 79.245 USD (31. Dezember 2024: 65.780 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 14.840 USD (31. Dezember 2024: 22.380 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 5.403.572                                                    | \$ 39.237                                                    | \$ 5.442.809        |
| Investmentfonds                     | 420.149                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 420.149             |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 1.000.272                                                       | 0                                                            | 1.000.272           |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 2.117                                                                       | 50.786                                                          | 0                                                            | 52.903              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 1.260                                                           | 0                                                            | 1.260               |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (79.912)                                                        | 0                                                            | (79.912)            |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 422.266</b>                                                           | <b>\$ 6.375.978</b>                                             | <b>\$ 39.237</b>                                             | <b>\$ 6.837.481</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 187.084                                                                  | \$ 4.678.766                                                    | \$ 11.123                                                    | \$ 4.876.973        |
| Investmentfonds                     | 232.411                                                                     | 133.749                                                         | 0                                                            | 366.160             |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 813.745                                                         | 0                                                            | 813.745             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 2.173                                                                       | 32.982                                                          | 0                                                            | 35.155              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 1.311                                                           | 0                                                            | 1.311               |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (78.560)                                                        | 0                                                            | (78.560)            |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 421.668</b>                                                           | <b>\$ 5.581.993</b>                                             | <b>\$ 11.123</b>                                             | <b>\$ 6.014.784</b> |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                       | 4,000 %         | 23.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (731)          | \$ (732)                                                        | (0,02)                  |
|                                           | 4,250           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (1.812)           | (1.813)                                                         | (0,04)                  |
|                                           | 4,290           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (5.193)           | (5.198)                                                         | (0,12)                  |
|                                           | 4,300           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (145)             | (146)                                                           | 0,00                    |
| BRC                                       | 0,900           | 23.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (1.077)         | (1.264)                                                         | (0,03)                  |
|                                           | 3,800           | 23.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | £ (2.122)         | (2.920)                                                         | (0,07)                  |
| MEI                                       | 4,290           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (3.140)        | (3.143)                                                         | (0,07)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                   | <b>\$ (15.216)</b>                                              | <b>(0,35)</b>           |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.348                            | \$ (1.210)                            | \$ 138                              | \$ (235)                            | \$ 0                                  | \$ (235)                            |
| BOA        | 11.863                              | (980)                                 | 10.883                              | 8.280                               | 0                                     | 8.280                               |
| BPS        | (2.528)                             | 2.070                                 | (458)                               | 1.552                               | (1.500)                               | 52                                  |
| BRC        | (1.163)                             | (120)                                 | (1.283)                             | (2.098)                             | 1.650                                 | (448)                               |
| BSH        | (889)                               | 1.770                                 | 881                                 | 144                                 | (290)                                 | (146)                               |
| CBK        | (8.427)                             | 6.980                                 | (1.447)                             | 1.477                               | (1.530)                               | (53)                                |
| DUB        | 289                                 | (270)                                 | 19                                  | (2.149)                             | 2.160                                 | 11                                  |
| FAR        | (3.832)                             | 3.070                                 | (762)                               | 1.944                               | (1.770)                               | 174                                 |
| GLM        | (420)                               | 380                                   | (40)                                | 5.698                               | (6.000)                               | (302)                               |
| GST        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | 901                                 | (2.540)                               | (1.639)                             |
| IND        | (353)                               | 220                                   | (133)                               | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| JPM        | 27.529                              | (22.600)                              | 4.929                               | 3.862                               | 0                                     | 3.862                               |
| MBC        | (287)                               | 320                                   | 33                                  | (10.293)                            | 9.590                                 | (703)                               |
| MYC        | 7.041                               | 30                                    | 7.071                               | 7.561                               | (590)                                 | 6.971                               |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| MYI        | \$ 4                                | \$ (80)                               | \$ (76)                             | \$ (2.699)                          | \$ 3.010                              | \$ 311                              |
| RBC        | 116                                 | 0                                     | 116                                 | 368                                 | (300)                                 | 68                                  |
| RYL        | (168)                               | 0                                     | (168)                               | (33)                                | 0                                     | (33)                                |
| SCX        | 251                                 | (670)                                 | (419)                               | (4.152)                             | 5.630                                 | 1.478                               |
| SOG        | (10)                                | 0                                     | (10)                                | (316)                               | 330                                   | 14                                  |
| SSB        | 12.420                              | (12.960)                              | (540)                               | 95                                  | 0                                     | 95                                  |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (164)                               | 0                                     | (164)                               |
| UAG        | 30                                  | 0                                     | 30                                  | (190)                               | 10                                    | (180)                               |
| WST        | 20                                  | 0                                     | 20                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

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

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                           | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere         | 25,26             | 14,92             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 26,93             | 32,74             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                     | 0,42              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                       | 4,06              | 3,61              |
| Pensionsgeschäfte                                                     | 9,67              | 8,03              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                   | 0,18              | 0,16              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                   | 0,39              | 0,39              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                            | 1,18              | 0,47              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                   | 0,01              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva                                                       | 31,90             | 39,67             |
| Summe Aktiva                                                          | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 1,22              | 1,36              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 20,50             | 19,49             |
| Wandelanleihen & Wechsel                                                               | k. A.             | 0,21              |
| Kommunalanleihen und Wechsel                                                           | 0,17              | 0,20              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 61,38             | 68,77             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 10,45             | 11,18             |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 4,61              | 5,17              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 9,97              | 12,05             |
| Staatsemissionen                                                                       | 13,88             | 9,06              |
| Stammaktien                                                                            | 0,10              | 5,18              |
| Optionsscheine                                                                         | 0,00              | 0,00              |
| Vorzugswertpapiere                                                                     | 0,03              | 0,03              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 2,90              | 0,18              |
| Investmentfonds                                                                        | 9,67              | 9,98              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 23,01             | 22,17             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | (0,06)            | 0,28              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | (0,02)            | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,01              | (0,03)            |
| Zinsswaps                                                                              | 0,30              | 0,45              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,56              | 0,63              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,03)            | (0,08)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,00              | 0,00              |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere                                                     | k. A.             | 0,02              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,82)            | 0,62              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,28              | (0,93)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,03              | 0,04              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (1,84)            | (2,14)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (57,30)           | (63,89)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

|                                                |  |        |            |          | % DES                                                                                                                                                              |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         | % DES  |                                  |         |        |      |
|------------------------------------------------|--|--------|------------|----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|------------|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|---------|--------|----------------------------------|---------|--------|------|
| BESCHREIBUNG                                   |  | PARI   | MARKT-     | NETTO-   | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                       |                             | PARI                                                                                                  | MARKT-      | NETTO-     | BESCHREIBUNG                                  |                                                  | PARI           | MARKT-  | NETTO- | % DES                            |         |        |      |
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                       |  | (000S) | WERT       | VERMÖ-   |                                                                                                                                                                    |                             | (000S)                                                                                                | WERT        | VERMÖ-     |                                               |                                                  | (000S)         | WERT    | VERMÖ- | GENS                             |         |        |      |
| ASERBAIDSCHAN                                  |  |        |            | GENS     | CHINA                                                                                                                                                              |                             |                                                                                                       |             |            | DÄNEMARK                                      |                                                  |                |         |        | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL |         |        |      |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |  |        |            |          | Flourish Century                                                                                                                                                   |                             |                                                                                                       |             |            | Jyske Realkredit A/S                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC   |  |        |            |          | 6,600 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            | 1,500 % fällig am                             |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 7,230 % fällig am                              |  |        |            |          | 04.02.2022 ^ (h)                                                                                                                                                   |                             |                                                                                                       | \$          | 2.800      | \$                                            | 99                                               | 0,00           |         |        |                                  |         |        |      |
| 17.03.2026                                     |  | \$     | 8.300      | \$ 8.246 | 0,19                                                                                                                                                               |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                | DKK     | 0      | \$                               | 0 0,00  |        |      |
| BRASILIEN                                      |  |        |            |          | STAATSEMISSIONEN                                                                                                                                                   |                             |                                                                                                       |             |            | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |  |        |            |          | China Government International Bond <th></th> <th></th> <th></th> <th colspan="2">1,000 % fällig am</th> <th></th> <th></th> <th></th> <th colspan="2"></th>       |                             |                                                                                                       |             |            | 1,000 % fällig am                             |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Banco do Brasil S.A.                           |  |        |            |          | 2,190 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            | 01.10.2050                                    |                                                  | 0              |         | 0      | 0,00                             |         |        |      |
| 8,500 % fällig am                              |  |        |            |          | 25.09.2054                                                                                                                                                         |                             | CNY                                                                                                   | 221.000     | 32.676     | 0,77                                          | 1,500 % fällig am                                |                |         |        | 0                                | 0,00    |        |      |
| 29.07.2026                                     |  | MXN    | 222.000    | 11.790   | 0,28                                                                                                                                                               | 2,600 % fällig am           |                                                                                                       |             |            |                                               | 01.10.2053                                       |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Vale S.A.                                      |  |        |            |          | 01.09.2032                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 84.310      | 12.555     | 0,29                                          | Realkredit Danmark A/S                           |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 0,000 % (f)                                    |  | BRL    | 99.420     | 6.245    | 0,15                                                                                                                                                               | 2,680 % fällig am           |                                                                                                       |             |            |                                               | 1,500 % fällig am                                |                |         |        | 0                                | 0 0,00  |        |      |
|                                                |  |        |            | 18.035   | 0,43                                                                                                                                                               | 21.05.2030                  |                                                                                                       |             | 37.300     | 5.491                                         | 0,13                                             | 01.10.2053     |         |        |                                  |         |        |      |
| KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG             |  |        |            |          | 2,750 % fällig am <th></th> <td></td> <td>59.200</td> <td>8.849</td> <td>0,21</td> <td colspan="2"></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td colspan="2">0 0,00</td> |                             |                                                                                                       |             | 59.200     | 8.849                                         | 0,21                                             |                |         |        |                                  |         | 0 0,00 |      |
| Oi S.A.                                        |  |        |            |          | 17.02.2032                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  | Summe Dänemark |         |        |                                  | 0       | 0,00   |      |
| 0,000 % fällig am                              |  |        |            |          | 3,020 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 30.12.2050                                     |  | \$     | 11.660     | 117      | 0,00                                                                                                                                                               | 27.05.2031                  |                                                                                                       |             | 15.740     | 2.380                                         | 0,06                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Summe Brasilien                                |  |        |            | 18.152   | 0,43                                                                                                                                                               | 3,120 % fällig am           |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
|                                                |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    | 25.10.2052                  |                                                                                                       |             | 39.380     | 6.867                                         | 0,16                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
|                                                |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    | 3,810 % fällig am           |                                                                                                       |             | 34.300     | 6.559                                         | 0,15                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
|                                                |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    | 14.09.2050                  |                                                                                                       |             |            | 75.377                                        | 1,77                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
|                                                |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    |                             |                                                                                                       |             |            | 75.476                                        | 1,77                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
|                                                |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    | Summe China                 |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| KAIMANINSELN                                   |  |        |            |          | KOLUMBIEN                                                                                                                                                          |                             |                                                                                                       |             |            | DOMINIKANISCHE REPUBLIK                       |                                                  |                |         |        | STAATSEMISSIONEN                 |         |        |      |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE               |  |        |            |          | STAATSEMISSIONEN                                                                                                                                                   |                             |                                                                                                       |             |            | Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Betony CLO Ltd.                                |  |        |            |          | Colombia Government International Bond                                                                                                                             |                             |                                                                                                       |             |            | 13,000 % fällig am                            |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 5,621 % fällig am 30.04.2031                   |  | 366    | 366        | 0,01     | 1,000 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            | 05.12.2025                                    |                                                  | DOP            | 347.800 | 5.799  | 0,14                             |         |        |      |
| Voya CLO Ltd.                                  |  |        |            |          | 28.04.2028                                                                                                                                                         |                             | COP                                                                                                   | 182.796.300 | 40.324     | 0,95                                          | Dominican Republic Government International Bond |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 5,481 % fällig am 19.04.2031                   |  | 389    | 390        | 0,01     | 1,000 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               | 10,500 % fällig am                               |                |         |        | 7.872.700                        | 133.938 | 3,14   |      |
| Wind River CLO Ltd.                            |  |        |            |          | 09.02.2033                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 21.637.400  | 5.536      | 0,13                                          | 10,750 % fällig am                               |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 5,581 % fällig am 18.07.2031                   |  | 36     | 36         | 0,00     | 9,850 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               | 15.03.2037                                       |                |         |        | 1.629.500                        | 28.174  | 0,66   |      |
|                                                |  |        |            | 792      | 0,02                                                                                                                                                               | 28.06.2027                  |                                                                                                       |             | 67.297.000 | 16.230                                        | 0,38                                             | 01.06.2036     |         |        |                                  | 110.250 | 1.961  | 0,05 |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |  |        |            |          | Colombian TES <th></th> <td></td> <td></td> <td></td> <td colspan="2">11,250 % fällig am</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>                    |                             |                                                                                                       |             |            |                                               | 11,250 % fällig am                               |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Fish Pond Re Ltd.                              |  |        |            |          | 6,250 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       | 47.919.000  | 7.581      | 0,18                                          | 15.09.2035                                       |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 8,328 % fällig am 08.01.2027                   |  | 1.000  | 1.018      | 0,02     | 7,000 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               | 13,625 % fällig am                               |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Interoceanica Finance Ltd.                     |  |        |            |          | 30.06.2032                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 7.777.700   | 3.339      | 0,08                                          | 03.02.2033                                       |                |         |        | 1.030.400                        | 20.260  | 0,47   |      |
| 0,000 % fällig am                              |  |        |            |          | 7,250 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               | 13,625 % fällig am                               |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 30.11.2025 (c)                                 |  | 34     | 34         | 0,00     | 26.10.2050                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 3.461.100   | 511        | 0,01                                          | 10.02.2034                                       |                |         |        | 344.300                          | 6.940   | 0,16   |      |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                      |  |        |            |          | 11,000 % fällig am                                                                                                                                                 |                             |                                                                                                       |             |            |                                               | Summe Dominikanische Republik                    |                |         |        | 197.072                          | 4,62    |        |      |
| 9,750 % fällig am                              |  |        |            |          | 22.08.2029                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 99.520.000  | 24.317     | 0,57                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 28.09.2023 ^                                   |  | 8.000  | 360        | 0,01     | 11,500 % fällig am                                                                                                                                                 |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 10,500 % fällig am                             |  |        |            |          | 25.07.2046                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 148.057.600 | 32.789     | 0,77                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 15.01.2025 ^                                   |  | 1.900  | 85         | 0,00     | 12,750 % fällig am                                                                                                                                                 |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 10,875 % fällig am                             |  |        |            |          | 28.11.2040                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 97.629.400  | 23.795     | 0,56                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 23.07.2023 ^                                   |  | 500    | 23         | 0,00     | 13,250 % fällig am                                                                                                                                                 |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 11,700 % fällig am                             |  |        |            |          | 09.02.2033                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 384.282.300 | 98.494     | 2,31                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 11.11.2025 ^                                   |  | 1.900  | 85         | 0,00     | Summe Kolumbien                                                                                                                                                    |                             |                                                                                                       |             | 261.015    | 6,13                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Peru Payroll Deduction Finance Ltd.            |  |        |            |          | TSCHS                                                                                                                                                              |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 0,000 % fällig am                              |  |        |            |          | CZECHISCHE REPUBLIK                                                                                                                                                |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 01.11.2029 (c)                                 |  | 2.207  | 1.926      | 0,05     | STAATSEMISSIONEN                                                                                                                                                   |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Poinsettia Finance Ltd.                        |  |        |            |          | Czech Republic Government International Bond                                                                                                                       |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 6,625 % fällig am 17.06.2031                   |  | 6.191  | 5.799      | 0,14     | 0,950 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Red Dorsalal Finance Ltd.                      |  |        |            |          | 15.05.2030                                                                                                                                                         |                             | CZK                                                                                                   | 82.700      | 3.444      | 0,08                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 5,875 % fällig am 12.10.2031                   |  | 2.764  | 2.740      | 0,06     | 1,200 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| TIB Diversified Payment Rights Finance Co.     |  |        |            |          | 13.03.2031                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 45.800      | 1.885      | 0,04                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 7,226 % fällig am 15.11.2034                   |  | 5.550  | 5.551      | 0,13     | 1,750 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| VD DPR Finance Co.                             |  |        |            |          | 23.06.2032                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 366.400     | 15.119     | 0,36                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 6,833 % fällig am 15.03.2035                   |  | 10.900 | 10.687     | 0,25     | 2,000 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       | 429.100     | 17.396     | 0,41                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
|                                                |  |        |            | 28.308   | 0,66                                                                                                                                                               | 13.10.2033                  |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Summe Kaimaninseln                             |  |        |            | 29.100   | 0,68                                                                                                                                                               | 3,500 % fällig am           |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| CHILE                                          |  |        |            |          | 3,600 % fällig am <th><td></td><td></td><td></td><td colspan="2"></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></th>                                           |                             | <td></td> <td></td> <td></td> <td colspan="2"></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| STAATSEMISSIONEN                               |  |        |            |          | 03.06.2036                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 58.850      | 2.628      | 0,06                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos |  |        |            |          | 4,200 % fällig am                                                                                                                                                  |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 4,700 % fällig am                              |  |        |            |          | 04.12.2036                                                                                                                                                         |                             |                                                                                                       | 163.800     | 7.665      | 0,18                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 01.09.2030                                     |  | CLP    | 56.085.000 | 58.177   | 1,36                                                                                                                                                               | 4,500 % fällig am           |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 5,000 % fällig am                              |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    | 11.11.2032 (i)              |                                                                                                       |             | 805.500    | 39.393                                        | 0,92                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 01.10.2028                                     |  |        | 7.215.000  | 7.722    | 0,18                                                                                                                                                               | 4,900 % fällig am           |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 5,000 % fällig am                              |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    | 14.04.2034                  |                                                                                                       |             | 712.900    | 35.698                                        | 0,84                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 01.03.2035                                     |  |        | 6.595.000  | 6.751    | 0,16                                                                                                                                                               | 5,000 % fällig am           |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 6,000 % fällig am                              |  |        |            |          |                                                                                                                                                                    | 30.09.2030                  |                                                                                                       |             | 634.200    | 31.829                                        | 0,75                                             |                |         |        |                                  |         |        |      |
| 01.04.2033                                     |  |        | 27.845.000 | 30.551   | 0,72                                                                                                                                                               | Summe Tschechische Republik |                                                                                                       |             | 168.852    | 3,96                                          |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |
| Summe Chile                                    |  |        |            | 103.201  | 2,42                                                                                                                                                               |                             |                                                                                                       |             |            |                                               |                                                  |                |         |        |                                  |         |        |      |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

|                                       |      |            |        | % DES  |        |                                      |      | % DES  |        |        |        |                                  |        | % DES  |        |        |        |      |
|---------------------------------------|------|------------|--------|--------|--------|--------------------------------------|------|--------|--------|--------|--------|----------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|------|
| BESCHREIBUNG                          | PARI | MARKT-     | NETTO- | VERMÖ- | GENS   | BESCHREIBUNG                         | PARI | MARKT- | NETTO- | VERMÖ- | GENS   | BESCHREIBUNG                     | PARI   | MARKT- | NETTO- | VERMÖ- | GENS   |      |
|                                       |      |            |        | (000S) | (000S) |                                      |      |        |        | (000S) | (000S) |                                  |        |        |        | (000S) | (000S) | GENS |
| UNGARN                                |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
| STAATSEMISSIONEN                      |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
| Hungary Government International Bond |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
| 3,000 % fällig am                     |      |            |        |        |        | Republic of Panama                   |      |        |        |        |        | 3,885 % fällig am 15.08.2029 MYR | 14.470 | \$     | 3.528  | 0,08   |        |      |
| 21.08.2030 (i)                        | HUF  | 15.369.600 | \$     | 38.596 | 0,91   | 4,103 % fällig am 05.03.2027         | €    | 14.500 | \$     | 17.144 | 0,40   | 4,054 % fällig am 18.04.2039     | 34.960 |        | 8.655  | 0,20   |        |      |
| 3,000 % fällig am                     |      |            |        |        |        | Summe Irland                         |      |        |        | 55.159 | 1,29   | 4,065 % fällig am 15.06.2050     | 34.445 |        | 8.286  | 0,19   |        |      |
| 27.10.2038 (i)                        |      | 895.900    |        | 1.717  | 0,04   | ISRAEL                               |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
| 4,750 % fällig am                     |      |            |        |        |        | STAATSEMISSIONEN                     |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
| 24.11.2032 (i)                        |      | 9.720.000  |        | 25.352 | 0,59   | Israel Government International Bond |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
| 7,000 % fällig am                     |      |            |        |        |        | 0,500 % fällig am 27.02.2026         | ILS  | 46.300 |        | 13.438 | 0,32   | 4,457 % fällig am 31.05.2035     | 21.770 |        | 5.495  | 0,13   |        |      |
| 24.10.2035 (i)                        |      | 508.500    |        | 1.492  | 0,04   | 5,375 % fällig am 19.02.2030         | \$   | 7.700  |        | 7.857  | 0,18   | 4,642 % fällig am 07.11.2033     | 40.580 |        | 10.456 | 0,25   |        |      |
| Summe Ungarn                          |      |            |        | 67.157 | 1,58   | 5,625 % fällig am                    |      |        |        |        |        | 4,696 % fällig am 15.10.2042     | 47.547 |        | 12.598 | 0,30   |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |
|                                       |      |            |        |        |        |                                      |      |        |        |        |        |                                  |        |        |        |        |        |      |

| BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>PARAGUAY<br/>STAATSEMISSIONEN</b>   |                |                          |                                   |
| Paraguay Government International Bond |                |                          |                                   |
| 7,900 % fällig am<br>09.02.2031        | PYG 67.884.000 | \$ 8.234                 | 0,19                              |
| 8,500 % fällig am<br>04.03.2035        | 85.530.000     | 10.462                   | 0,25                              |
| Summe Paraguay                         |                | 18.696                   | 0,44                              |

|                                                  |            |        |      |
|--------------------------------------------------|------------|--------|------|
| <b>PERU<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |            |        |      |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.     |            |        |      |
| 9,700 % fällig am<br>05.03.2045                  | PEN 30.300 | 8.918  | 0,21 |
| 10,100 % fällig am<br>15.12.2043                 | 108.650    | 32.532 | 0,76 |
|                                                  |            | 41.450 | 0,97 |

|                                    |         |         |      |
|------------------------------------|---------|---------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |         |         |      |
| Peru Government International Bond |         |         |      |
| 5,350 % fällig am<br>12.08.2040    | 6.300   | 1.527   | 0,04 |
| 5,400 % fällig am<br>12.08.2034    | 46.500  | 12.405  | 0,29 |
| 5,400 % fällig am<br>12.08.2034    | 18.500  | 4.935   | 0,12 |
| 6,150 % fällig am<br>12.08.2032    | 292.451 | 85.251  | 2,00 |
| 6,850 % fällig am<br>12.08.2035    | 51.400  | 14.958  | 0,35 |
| 6,850 % fällig am<br>12.02.2042    | 18.900  | 5.372   | 0,13 |
| 6,950 % fällig am<br>12.08.2031    | 117.282 | 35.939  | 0,84 |
| 7,300 % fällig am<br>12.08.2033    | 78.000  | 23.979  | 0,56 |
|                                    |         | 184.366 | 4,33 |
| Summe Peru                         |         | 225.816 | 5,30 |

|                                           |               |         |      |
|-------------------------------------------|---------------|---------|------|
| <b>PHILIPPINEN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>   |               |         |      |
| Philippines Government International Bond |               |         |      |
| 6,250 % fällig am<br>28.02.2029           | PHP 8.019.550 | 144.680 | 3,40 |
| 6,250 % fällig am<br>14.01.2036           | 613.000       | 10.650  | 0,25 |
| 6,375 % fällig am<br>28.04.2035           | 1.269.010     | 22.722  | 0,53 |
| Summe Philippinen                         |               | 178.052 | 4,18 |

|                                      |             |         |      |
|--------------------------------------|-------------|---------|------|
| <b>POLEN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>    |             |         |      |
| Poland Government International Bond |             |         |      |
| 1,750 % fällig am<br>25.04.2032      | PLN 168.000 | 37.501  | 0,88 |
| 2,750 % fällig am<br>25.10.2029      | 89.500      | 22.847  | 0,54 |
| 4,750 % fällig am<br>25.07.2029 (i)  | 243.400     | 67.301  | 1,58 |
| 5,000 % fällig am<br>25.01.2030      | 15.400      | 4.286   | 0,10 |
| 5,750 % fällig am<br>25.04.2029 (i)  | 537.300     | 153.941 | 3,61 |
| 6,000 % fällig am<br>25.10.2033      | 133.700     | 38.540  | 0,90 |
| Summe Polen                          |             | 324.416 | 7,61 |

|                                       |            |        |      |
|---------------------------------------|------------|--------|------|
| <b>RUMÄNIEN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>  |            |        |      |
| Romania Government International Bond |            |        |      |
| 4,150 % fällig am<br>26.01.2028       | RON 98.300 | 21.113 | 0,49 |
| 4,250 % fällig am<br>28.04.2036       | 196.000    | 35.199 | 0,83 |
| 4,750 % fällig am<br>11.10.2034       | 14.900     | 2.847  | 0,07 |

| BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SERBIEN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>  |                |                          |                                   |
| Serbia Government International Bond |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 20.08.2032 RSD     | 371.800        | 3.624                    | 0,09                              |
| 5,250 % fällig am 27.07.2035         | 1.972.800      | 19.813                   | 0,46                              |
| Summe Serbien                        |                | 23.437                   | 0,55                              |

|                                                      |          |       |      |
|------------------------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>SINGAPUR<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |       |      |
| Yinson Production Financial Services Pte Ltd.        |          |       |      |
| 9,625 % fällig am 03.05.2029                         | \$ 3.600 | 3.743 | 0,09 |

|                                                       |             |       |      |
|-------------------------------------------------------|-------------|-------|------|
| <b>SÜDAFRIKA<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |             |       |      |
| Eskom Holdings SOC Ltd.                               |             |       |      |
| 0,000 % fällig am<br>18.08.2027 (c)                   | ZAR 100.100 | 4.157 | 0,10 |
| 0,000 % fällig am<br>31.12.2032 (c)                   | 254.000     | 4.642 | 0,11 |
|                                                       |             | 8.799 | 0,21 |

|                                           |         |       |      |
|-------------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |         |       |      |
| Transnet SOC Ltd.                         |         |       |      |
| 11,558 % fällig am<br>02.03.2028          | 121.029 | 6.755 | 0,16 |

|                                            |           |         |      |
|--------------------------------------------|-----------|---------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |           |         |      |
| South Africa Government International Bond |           |         |      |
| 6,250 % fällig am 31.03.2036               | 276.100   | 11.584  | 0,27 |
| 6,500 % fällig am 28.02.2041               | 650.051   | 24.696  | 0,58 |
| 7,000 % fällig am 28.02.2031               | 1.329.346 | 68.817  | 1,62 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030               | 1.716.052 | 94.957  | 2,23 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037               | 1.271.500 | 62.284  | 1,46 |
| 8,750 % fällig am 31.01.2044               | 364.600   | 16.685  | 0,39 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035               | 1.323.500 | 69.543  | 1,63 |
| 9,000 % fällig am 31.01.2040               | 685.500   | 33.354  | 0,78 |
|                                            |           | 381.920 | 8,96 |
| Summe Südafrika                            |           | 397.474 | 9,33 |

|                                                           |         |        |      |
|-----------------------------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>SUPRANATIONAL<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |        |      |
| Asian Infrastructure Investment Bank                      |         |        |      |
| 7,000 % fällig am 01.03.2029 INR                          | 979.200 | 11.572 | 0,27 |
| Europäische Investitionsbank                              |         |        |      |
| 2,875 % fällig am 15.11.2029 PLN                          | 108.500 | 27.529 | 0,64 |
| Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung      |         |        |      |
| 7,050 % fällig am 22.07.2029 INR                          | 453.000 | 5.390  | 0,13 |
| Summe Supranational                                       |         | 44.491 | 1,04 |

|                                                        |          |        |      |
|--------------------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>TANSANIA<br/>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |          |        |      |
| Ministry of Finance of Tanzania                        |          |        |      |
| TBD % fällig am 26.04.2028                             | € 4.909  | 5.771  | 0,14 |
| TBD % fällig am 20.06.2030                             | \$ 6.600 | 6.574  | 0,15 |
| Summe Tansania                                         |          | 12.345 | 0,29 |

|                                        |           |        |      |
|----------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>THAILAND<br/>STAATSEMISSIONEN</b>   |           |        |      |
| Thailand Government International Bond |           |        |      |
| 1,600 % fällig am 17.12.2029 THB       | 134.500   | 4.172  | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 17.06.2042           | 230.910   | 7.159  | 0,17 |
| 2,980 % fällig am 17.06.2045           | 135.695   | 4.792  | 0,11 |
| 3,300 % fällig am 17.06.2038           | 27.950    | 1.022  | 0,02 |
| 3,400 % fällig am 17.06.2036           | 335.224   | 12.151 | 0,28 |
| 3,450 % fällig am 17.06.2043           | 1.007.799 | 37.448 | 0,88 |
| 4,000 % fällig am 17.06.2055           | 269.700   | 11.442 | 0,27 |
| Summe Thailand                         |           | 78.186 | 1,83 |

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>TÜRKEI<br/>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   |
| SOCAR Turkey Enerji A/S                              |                |                          |                                   |
| TBD % fällig am<br>11.08.2026                        | € 12.200       | \$ 14.294                | 0,33                              |
| Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.                      |                |                          |                                   |
| 5,001 % fällig am<br>15.12.2028                      | 3.900          | 4.595                    | 0,11                              |
|                                                      |                | 18.889                   | 0,44                              |

|                                      |           |        |      |
|--------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |           |        |      |
| Turkey Government International Bond |           |        |      |
| 27,700 % fällig am 27.09.2034 TRY    | 1.168.300 | 28.174 | 0,66 |
| 49,053 % fällig am 20.05.2026        | 34.850    | 880    | 0,02 |
| 49,053 % fällig am 19.08.2026        | 59.500    | 1.502  | 0,04 |
| 49,053 % fällig am 17.05.2028        | 1.315.656 | 32.070 | 0,75 |
|                                      |           | 62.626 | 1,47 |
| Summe Türkei                         |           | 81.515 | 1,91 |

|                                                  |                |        |      |
|--------------------------------------------------|----------------|--------|------|
| <b>UGANDA<br/>STAATSEMISSIONEN</b>               |                |        |      |
| Republic of Uganda Government International Bond |                |        |      |
| 15,800 % fällig am<br>23.06.2039                 | UGX 52.186.200 | 13.381 | 0,31 |

|                                       |          |       |      |
|---------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>UKRAINE<br/>STAATSEMISSIONEN</b>   |          |       |      |
| Ukraine Government International Bond |          |       |      |
| 0,000 % fällig am 01.02.2034          | \$ 1.661 | 645   | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 01.02.2035          | 1.404    | 667   | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 01.02.2036          | 1.170    | 553   | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 01.08.2041          | 320      | 231   | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2029          | 466      | 289   | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2035          | 2.537    | 1.301 | 0,03 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2036          | 3.245    | 1.622 | 0,04 |
| Summe Ukraine                         |          | 5.308 | 0,12 |

|                                                                          |                |       |      |
|--------------------------------------------------------------------------|----------------|-------|------|
| <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |       |      |
| ADCB Finance Cayman Ltd.                                                 |                |       |      |
| 7,500 % fällig am<br>15.10.2029                                          | IDR 29.000.000 | 1.797 | 0,04 |

|                                           |           |       |      |
|-------------------------------------------|-----------|-------|------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |           |       |      |
| NMC Healthcare LLC                        |           |       |      |
| TBD % fällig am<br>25.03.2027             | AED 8.245 | 2.248 | 0,06 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate        |           | 4.045 | 0,10 |

|                                                             |           |        |      |
|-------------------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>GROSSBRITANNIEN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |           |        |      |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC              |           |        |      |
| 0,000 % fällig am<br>05.04.2032 (c)                         | \$ 33.100 | 23.555 | 0,55 |

|                                           |         |        |      |
|-------------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                     |         |        |      |
| Canada Square Funding PLC                 |         |        |      |
| 5,161 % fällig am<br>17.01.2059           | £ 1.353 | 1.859  | 0,04 |
| Rochester Financing PLC                   |         |        |      |
| 4,939 % fällig am<br>18.12.2044           | 1.011   | 1.385  | 0,03 |
| Tower Bridge Funding PLC                  |         |        |      |
| 4,959 % fällig am<br>20.12.2063           | 482     | 660    | 0,02 |
| Warwick Finance Residential Mortgages PLC |         |        |      |
| 0,000 % fällig am<br>21.12.2049 (c)       | 0       | 585    | 0,02 |
|                                           |         | 4.489  | 0,11 |
| Summe Großbritannien                      |         | 28.044 | 0,66 |

|                                                 |          |     |      |
|-------------------------------------------------|----------|-----|------|
| <b>USA<br/>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |          |     |      |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.             |          |     |      |
| 4,754 % fällig am<br>25.12.2036                 | \$ 1.159 | 635 | 0,01 |
| 5,034 % fällig am<br>25.10.2036                 | 387      | 228 | 0,01 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>GSAMP Trust</b>                                                        |                |                          |                                   | <b>JPMorgan Resecuritization Trust</b>               |                |                          |                                   | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,524 % fällig am 25.01.2037 \$                                           | 797            | \$ 480                   | 0,01                              | 2,500 % fällig am                                    |                |                          |                                   | <b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,534 % fällig am 25.12.2046                                              | 407            | 201                      | 0,00                              | 25.03.2056                                           | \$ 69          | \$ 67                    | 0,00                              | <b>Standard Chartered Bank</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Lehman XS Trust</b>                                                    |                |                          |                                   | <b>Lehman XS Trust</b>                               |                |                          |                                   | 22,238 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 4,984 % fällig am 25.01.2036                                              | 1.295          | 1.157                    | 0,03                              | 4,814 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 01.12.2025 (c)(d) PKR                                   | 1.072.400      | \$ 3.315                 | 0,08                              |
| <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>                                |                |                          |                                   | 25.09.2046                                           | 1.263          | 1.126                    | 0,03                              | 22,242 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 5,584 % fällig am 25.08.2037                                              | 541            | 475                      | 0,01                              | <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>            |                |                          |                                   | 03.11.2025 (c)(d)                                       | 963.700        | 3.003                    | 0,07                              |
| <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>                             |                |                          |                                   | 6,075 % fällig am                                    |                |                          |                                   |                                                         |                | 6.318                    | 0,15                              |
| 4,734 % fällig am 25.06.2036                                              | 145            | 125                      | 0,00                              | 25.06.2036                                           | 1              | 1                        | 0,00                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.11.2036                                              | 6.438          | 3.646                    | 0,09                              | <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>        |                |                          |                                   | <b>EGYPT TREASURY BILLS</b>                             |                |                          |                                   |
| 5,589 % fällig am 25.01.2035                                              | 1.732          | 1.727                    | 0,04                              | 5,500 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 27,448 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                                    |                |                          |                                   | 25.03.2037                                           | 240            | 198                      | 0,01                              | 12.08.2025 (c)(d) EGP                                   | 27.950         | 546                      | 0,01                              |
| 4,774 % fällig am 25.01.2037                                              | 1.622          | 537                      | 0,01                              | <b>Sequoia Mortgage Trust</b>                        |                |                          |                                   | 27,497 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| <b>Option One Mortgage Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   | 4,157 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 12.08.2025 (c)(d)                                       | 1.000.000      | 19.545                   | 0,46                              |
| 4,654 % fällig am 25.04.2037                                              | 419            | 282                      | 0,01                              | 20.01.2038                                           | 204            | 163                      | 0,00                              | 27,500 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| <b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>   |                |                          |                                   | 23.09.2025 (c)(d)                                       | 767.475        | 14.532                   | 0,34                              |
| 5,169 % fällig am 25.08.2035                                              | 47             | 47                       | 0,00                              | 4,734 % fällig am                                    |                |                          |                                   |                                                         |                | 34.623                   | 0,81                              |
| <b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>                           |                |                          |                                   | 25.02.2037                                           | 504            | 482                      | 0,01                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 6,084 % fällig am 25.07.2035                                              | 1.372          | 1.357                    | 0,03                              | <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                |                          |                                   | <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>              |                |                          |                                   | 4,257 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 22,542 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.10.2037                                              | 4.539          | 2.859                    | 0,07                              | 25.02.2037                                           | 19             | 17                       | 0,00                              | 25.11.2025 (c)(d) NGN                                   | 2.964.480      | 1.752                    | 0,04                              |
| <b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>              |                |                          |                                   | 4,804 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 22,930 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.07.2036                                              | 1.300          | 1.283                    | 0,03                              | 25.05.2034                                           | 90             | 84                       | 0,00                              | 02.12.2025 (c)(d)                                       | 459.378        | 270                      | 0,01                              |
|                                                                           |                | 15.039                   | 0,35                              | <b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>  |                |                          |                                   | 23,031 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                                                           |                |                          |                                   | 7,414 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 09.12.2025 (c)(d)                                       | 1.669.651      | 978                      | 0,02                              |
|                                                                           |                |                          |                                   | 25.10.2036                                           | 179            | 172                      | 0,00                              | 23,286 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                                                           |                |                          |                                   |                                                      |                | 17.983                   | 0,42                              | 04.11.2025 (c)(d)                                       | 2.800.000      | 1.677                    | 0,04                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                   |                |                          |                                   |                                                      |                |                          |                                   | 19.08.2025 (c)(d)                                       | 4.251.337      | 2.680                    | 0,06                              |
| <b>Indonesia Government International Bond</b>                            |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | 26,510 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 15.07.2035 IDR 664.270.000                              | 41.301         | 0,97                     |                                   | <b>Indonesia Government International Bond</b>       |                |                          |                                   | 11.11.2025 (c)(d)                                       | 4.907.104      | 2.913                    | 0,07                              |
| <b>Rio Oil Finance Trust</b>                                              |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 26,683 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 \$                                           | 2.002          | 2.088                    | 0,05                              | 15.07.2030                                           | IDR 74.911.000 | 4.655                    | 0,11                              | 19.08.2025 (c)(d)                                       | 9.380.985      | 5.914                    | 0,14                              |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027                                              | 271            | 281                      | 0,01                              | 6,750 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 26,691 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                                                           |                | 43.670                   | 1,03                              | 15.07.2035                                           | 91.104.000     | 5.664                    | 0,13                              | 11.11.2025 (c)(d)                                       | 14.539.095     | 8.632                    | 0,20                              |
|                                                                           |                |                          |                                   |                                                      |                | 10.319                   | 0,24                              | 30,612 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Summe USA</b>                                     |                | 116.223                  | 2,73                              | 29.06.2026 (c)(d)                                       | 23.713.224     | 12.450                   | 0,29                              |
| <b>Finance Ministry Angola</b>                                            |                |                          |                                   |                                                      |                |                          |                                   | 30,864 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| <b>TBD % fällig am 11.12.2025</b>                                         | 8.400          | 8.404                    | 0,20                              | <b>USBEKISTAN</b>                                    |                |                          |                                   | 26.06.2026 (c)(d)                                       | 17.073.407     | 8.978                    | 0,21                              |
| <b>Stepstone Group Midco GmbH</b>                                         |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | 31,337 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 6,673 % fällig am 26.04.2032 €                                            | 10.800         | 12.456                   | 0,29                              | <b>Uzbek Industrial and Construction Bank ATB</b>    |                |                          |                                   | 07.10.2025 (c)(d)                                       | 2.343.000      | 1.428                    | 0,03                              |
| <b>Ziraat Bank</b>                                                        |                |                          |                                   | 8,950 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 31,577 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| <b>TBD % fällig am 15.06.2034</b>                                         | 8.400          | 8.352                    | 0,20                              | 24.07.2029                                           | \$ 2.800       | 2.952                    | 0,07                              | 07.10.2025 (c)(d)                                       | 19.321.000     | 11.776                   | 0,28                              |
|                                                                           |                | 29.212                   | 0,69                              |                                                      |                |                          |                                   | 33,126 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                                                           |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | 12.06.2026 (c)(d)                                       | 37.434.494     | 19.829                   | 0,47                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                     |                |                          |                                   | <b>National Bank of Uzbekistan</b>                   |                |                          |                                   | 33,156 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                                     |                |                          |                                   | 19,875 % fällig am                                   |                |                          |                                   | 11.06.2026 (c)(d)                                       | 37.468.681     | 19.857                   | 0,47                              |
| 5,056 % fällig am 25.02.2036                                              | 1              | 0                        | 0,00                              | 05.07.2027                                           | UZS 95.600.000 | 7.725                    | 0,18                              |                                                         |                | 99.134                   | 2,33                              |
| <b>BCAP LLC Trust</b>                                                     |                |                          |                                   | <b>Republic of Uzbekistan International Bond</b>     |                |                          |                                   | <b>Summe kurzfristige Instrumente</b>                   |                | 140.075                  | 3,29                              |
| 4,155 % fällig am 26.05.2037                                              | 2.835          | 2.534                    | 0,06                              | 16,250 % fällig am                                   | 5.000.000      | 408                      | 0,01                              | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>                   | \$ 4.073.387   | 95,58                    |                                   |
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                        |                |                          |                                   | 12.10.2026                                           |                |                          |                                   | <b>AKTIEN</b>                                           |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 25.05.2047                                              | 9              | 9                        | 0,00                              | 16,625 % fällig am                                   | 6.870.000      | 553                      | 0,01                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                                  |                |                          |                                   |
| 4,847 % fällig am 25.03.2035                                              | 5              | 5                        | 0,00                              | 29.05.2027                                           |                | 8.686                    | 0,20                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                |                |                          |                                   |
| 5,166 % fällig am 25.01.2035                                              | 0              | 0                        | 0,00                              |                                                      |                |                          |                                   | <b>PIMCO Funds: Global</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                                           |                |                          |                                   | <b>Summe Usbekistan</b>                              |                | 11.638                   | 0,27                              | <b>Investors Series plc -</b>                           |                |                          |                                   |
| 4,037 % fällig am 25.04.2037                                              | 5.005          | 3.476                    | 0,08                              |                                                      |                |                          |                                   | <b>Asia Strategic Interest</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,326 % fällig am 25.10.2035                                              | 187            | 156                      | 0,00                              | <b>VENEZUELA</b>                                     |                |                          |                                   | <b>Bond Fund (g)</b>                                    | 250.000        | 2.620                    | 0,06                              |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                                |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | <b>PIMCO Funds: Global</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,783 % fällig am 25.09.2037                                              | 2.130          | 1.965                    | 0,05                              | <b>Venezuela Government International Bond</b>       |                |                          |                                   | <b>Investors Series plc -</b>                           |                |                          |                                   |
| 6,756 % fällig am 25.03.2034                                              | 1              | 1                        | 0,00                              | 7,750 % fällig am                                    | \$ 11.900      | 1.771                    | 0,04                              | <b>Emerging Local Bond</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   | 13.10.2019 ^                                         |                |                          |                                   | <b>ESG Fund (g)</b>                                     | 740.626        | 10.509                   | 0,25                              |
| 4,794 % fällig am 25.04.2046                                              | 77             | 72                       | 0,00                              | 9,250 % fällig am                                    | 9.800          | 1.997                    | 0,05                              | <b>PIMCO Funds: Global</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,072 % fällig am 20.12.2035                                              | 346            | 327                      | 0,01                              | 15.09.2027 ^                                         |                |                          |                                   | <b>Investors Series plc -</b>                           |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                                              | 3.816          | 2.070                    | 0,05                              |                                                      |                | 3.768                    | 0,09                              | <b>PIMCO Emerging Markets</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>                  |                |                          |                                   | <b>Summe Venezuela</b>                               |                |                          |                                   | <b>Opportunities Fund (g)</b>                           | 2.527.794      | 34.252                   | 0,80                              |
| 4,607 % fällig am 25.11.2037                                              | 261            | 249                      | 0,01                              |                                                      |                |                          |                                   | <b>PIMCO Select Funds plc -</b>                         |                |                          |                                   |
| 5,234 % fällig am 25.03.2035                                              | 24             | 22                       | 0,00                              | <b>SAMBIA</b>                                        |                |                          |                                   | <b>PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)</b> | 29.053.597     | 289.715                  | 6,80                              |
| <b>GSMPs Mortgage Loan Trust</b>                                          |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   | <b>PIMCO Specialty Funds</b>                            |                |                          |                                   |
| 4,784 % fällig am 25.01.2036                                              | 107            | 87                       | 0,00                              | <b>Zambia Government International Bond</b>          |                |                          |                                   | <b>Ireland p.l.c. - PIMCO</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                                            |                |                          |                                   | 12,000 % fällig am                                   | ZMW 50.600     | 2.118                    | 0,05                              | <b>China Bond Fund (g)</b>                              | 384.409        | 5.632                    | 0,13                              |
| 4,729 % fällig am 25.01.2036                                              | 3              | 3                        | 0,00                              | 04.07.2025                                           |                |                          |                                   |                                                         |                | 342.728                  | 8,04                              |
| <b>Impac CMB Trust</b>                                                    |                |                          |                                   | 12,000 % fällig am                                   | 5.600          | 214                      | 0,01                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                                              | 60             | 58                       | 0,00                              | 03.05.2028                                           |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
| <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                                        |                |                          |                                   | 22,000 % fällig am                                   | 5.150          | 247                      | 0,01                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 25.11.2037                                              | 159            | 131                      | 0,00                              | 22.01.2029                                           |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
| 4,774 % fällig am 25.11.2036                                              | 4.244          | 4.199                    | 0,10                              | 23,000 % fällig am                                   | 48.800         | 2.513                    | 0,05                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.02.2037                                              | 327            | 309                      | 0,01                              | 22.01.2031                                           |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                                           |                |                          |                                   | <b>Summe Sambia</b>                                  |                | 5.092                    | 0,12                              | <b>Summe Investmentfonds</b>                            | \$ 342.728     | 8,04                     |                                   |



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

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

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025          | 56                      | \$ (162)                                        | 0,00                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025          | 42                      | 150                                             | 0,00                    |
|                                                                |       |                  |                         | <b>\$ (12)</b>                                  | <b>0,00</b>             |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | <b>\$ (12)</b>                                  | <b>0,00</b>             |

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

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

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

| Referenzeinheit   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Barclays Bank PLC | 1,000 %                        | 20.12.2025            | € 1.600                        | \$ (2)                                          | 0,00                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day ILS-SHIR Compounded-OIS     | 3,950 %            | 14.07.2030            | ILS 1.000       | \$ (2)                                          | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 5,699              | 18.06.2030            | INR 1.807.000   | (18)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000              | 17.09.2035            | 2.047.890       | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,992              | 18.06.2030            | SGD 19.100      | 216                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750              | 19.03.2030            | 12.960          | 438                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,322              | 20.12.2028            | 40.920          | (1.546)                                         | (0,04)                  |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day THB-THOR Compounded-OIS     | 2,000              | 17.09.2030            | THB 5.604.490   | 852                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 21.06.2028            | \$ 26.400       | 329                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2030            | 344.500         | 1.638                                           | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 19.03.2034            | 21.500          | 825                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2034            | 11.600          | 148                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 20.12.2053            | 4.000           | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 19.03.2055            | 56.300          | 866                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2055            | 50.000          | 218                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2055            | 109.000         | (2.710)                                         | (0,06)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.12.2030            | 3.900           | (174)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.12.2033            | 4.460           | 308                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.06.2054            | 16.600          | (20)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.06.2054            | 23.000          | 336                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 18.12.2054            | 39.000          | (1.282)                                         | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 18.12.2054            | 400             | 13                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 17.09.2055            | 82.300          | 606                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,600              | 17.01.2034            | 1.000           | 9                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 20.12.2028            | 28.100          | (293)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 17.09.2030            | 39.700          | 529                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 20.06.2031            | 27.900          | (1.007)                                         | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 20.06.2034            | 87.030          | (3.996)                                         | (0,09)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 18.12.2034            | 500             | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 17.09.2035            | 43.300          | 610                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 20.06.2036            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 18.12.2036            | 4.700           | (61)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,870              | 17.10.2053            | 2.000           | (19)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,880              | 16.10.2053            | 500             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,994              | 02.07.2034            | 6.300           | (106)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,060              | 02.07.2034            | 2.500           | (56)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,080              | 05.06.2034            | 4.300           | (129)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,086              | 13.01.2055            | 21.000          | (617)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,155              | 02.10.2033            | 5.080           | 208                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,170              | 03.10.2033            | 7.000           | 295                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 6,151              | 04.01.2027            | BRL 528.200     | (17.909)                                        | (0,42)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,630              | 04.01.2027            | 85.900          | (1.207)                                         | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 9,783              | 04.01.2027            | 498.300         | 6.629                                           | 0,16                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,795              | 04.01.2027            | 227.500         | (2.980)                                         | (0,07)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,815              | 04.01.2027            | 156.000         | (1.988)                                         | (0,05)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,830              | 02.01.2026            | 540.400         | (4.749)                                         | (0,11)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 9,840              | 04.01.2027            | 185.700         | (2.398)                                         | (0,06)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 9,840              | 04.01.2027            | 195.800         | 2.514                                           | 0,06                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,842              | 04.01.2027            | 234.800         | (2.967)                                         | (0,07)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,044             | 02.01.2029            | 153.100         | (1.716)                                         | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,076             | 04.01.2027            | 325.100         | (4.560)                                         | (0,11)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,235             | 04.01.2027            | 98.900          | (1.081)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,512             | 04.01.2027            | 115.000         | (1.192)                                         | (0,03)                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 10,529 %           | 02.01.2026            | BRL             | 178.300                                         | \$ 1.264                | 0,03   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,565             | 04.01.2027            |                 | 141.200                                         | (1.355)                 | (0,03) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,602             | 04.01.2027            |                 | 259.100                                         | (3.005)                 | (0,07) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 10,671             | 04.01.2027            |                 | 311.000                                         | 2.856                   | 0,07   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,691             | 02.01.2026            |                 | 193.000                                         | (1.204)                 | (0,03) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,751             | 02.01.2026            |                 | 73.100                                          | (441)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 10,768             | 04.01.2027            |                 | 59.800                                          | 553                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,792             | 04.01.2027            |                 | 356.400                                         | (3.347)                 | (0,08) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 10,872             | 04.01.2027            |                 | 135.200                                         | 1.187                   | 0,03   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 10,880             | 04.01.2027            |                 | 441.200                                         | 3.689                   | 0,09   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,064             | 04.01.2027            |                 | 259.100                                         | (2.065)                 | (0,05) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,133             | 04.01.2027            |                 | 102.100                                         | 765                     | 0,02   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,135             | 04.01.2027            |                 | 96.300                                          | 720                     | 0,02   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,169             | 04.01.2027            |                 | 96.950                                          | (260)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,490             | 02.01.2029            |                 | 132.400                                         | (902)                   | (0,02) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,510             | 04.01.2027            |                 | 399.700                                         | 2.463                   | 0,06   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,513             | 04.01.2027            |                 | 198.100                                         | 1.264                   | 0,03   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,523             | 02.01.2029            |                 | 206.300                                         | (1.339)                 | (0,03) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,575             | 03.01.2028            |                 | 102.600                                         | 615                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,600             | 04.01.2027            |                 | 283.100                                         | 1.655                   | 0,04   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,695             | 03.01.2028            |                 | 223.200                                         | (1.218)                 | (0,03) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,730             | 02.01.2029            |                 | 274.000                                         | (1.501)                 | (0,04) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,736             | 04.01.2027            |                 | 164.500                                         | 976                     | 0,02   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,880             | 02.01.2031            |                 | 122.200                                         | (709)                   | (0,02) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,940             | 03.01.2033            |                 | 155.600                                         | (968)                   | (0,02) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 12,140             | 02.01.2031            |                 | 127.200                                         | (545)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 12,243             | 02.01.2029            |                 | 269.500                                         | 878                     | 0,02   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 12,255             | 02.01.2029            |                 | 64.700                                          | 213                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 12,320             | 02.01.2029            |                 | 163.500                                         | (479)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 12,760             | 02.01.2029            |                 | 399.000                                         | 380                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,270             | 02.01.2029            |                 | 158.100                                         | (169)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,291             | 02.01.2029            |                 | 405.900                                         | 620                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,320             | 02.01.2029            |                 | 43.300                                          | 74                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,335             | 02.01.2029            |                 | 53.900                                          | (72)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,405             | 02.01.2029            |                 | 398.400                                         | 612                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,425             | 02.01.2029            |                 | 120.100                                         | 195                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,430             | 02.01.2029            |                 | 235.600                                         | 387                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,500             | 02.01.2029            |                 | 297.400                                         | 527                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,518             | 02.01.2029            |                 | 287.700                                         | (538)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,545             | 02.01.2029            |                 | 190.100                                         | (381)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,589             | 02.01.2029            |                 | 388.400                                         | (857)                   | (0,02) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,680             | 02.01.2029            |                 | 323.700                                         | 829                     | 0,02   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,844             | 02.01.2029            |                 | 1.300                                           | (4)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,923             | 02.01.2029            |                 | 225.900                                         | (768)                   | (0,02) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,926             | 04.01.2027            |                 | 253.000                                         | (132)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,927             | 04.01.2027            |                 | 1.079.800                                       | (560)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,998             | 02.01.2029            |                 | 465.300                                         | 1.715                   | 0,04   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,013             | 02.01.2029            |                 | 30.000                                          | 112                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,020             | 04.01.2027            |                 | 166.400                                         | 31                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,026             | 02.01.2029            |                 | 158.200                                         | (601)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,028             | 04.01.2027            |                 | 158.300                                         | 26                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,087             | 02.01.2029            |                 | 77.100                                          | (348)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,185             | 02.01.2029            |                 | 291.300                                         | 1.310                   | 0,03   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,213             | 02.01.2029            |                 | 156.700                                         | 722                     | 0,02   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,245             | 02.01.2029            |                 | 36.500                                          | (170)                   | 0,00   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,350             | 04.01.2027            |                 | 588.000                                         | (319)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,455             | 02.01.2029            |                 | 290.300                                         | (1.632)                 | (0,04) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,524             | 02.01.2029            |                 | 3.500                                           | (21)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,570             | 02.01.2029            |                 | 125.700                                         | 748                     | 0,02   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,995             | 04.01.2027            |                 | 283.200                                         | 614                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 15,036             | 02.01.2029            |                 | 167.900                                         | 1.339                   | 0,03   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 15,065             | 02.01.2029            |                 | 161.900                                         | 1.360                   | 0,03   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500              | 18.06.2030            | CNY             | 1.773.210                                       | 1.289                   | 0,03   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500              | 17.09.2030            |                 | 232.260                                         | (62)                    | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,115              | 01.02.2031            | COP             | 14.558.000                                      | 215                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,120              | 01.02.2031            |                 | 10.388.000                                      | 154                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,155              | 15.01.2031            |                 | 5.060.000                                       | 79                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,675              | 18.06.2031            |                 | 20.000.000                                      | 662                     | 0,02   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,105              | 26.09.2029            |                 | 30.923.000                                      | (395)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,110              | 02.10.2029            |                 | 84.000.000                                      | (1.163)                 | (0,03) |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,140              | 26.09.2029            |                 | 63.562.000                                      | (794)                   | (0,02) |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,290              | 22.01.2029            |                 | 65.042.000                                      | (636)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,390              | 05.09.2029            |                 | 57.712.100                                      | (598)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,400              | 09.09.2029            |                 | 32.137.300                                      | (330)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,410              | 09.08.2028            |                 | 27.919.200                                      | 206                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,410              | 30.09.2031            |                 | 11.364.700                                      | 49                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,498              | 28.04.2028            |                 | 37.947.620                                      | 235                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,520              | 13.08.2031            |                 | 25.415.600                                      | 391                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,530              | 02.01.2029            |                 | 16.771.600                                      | (68)                    | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,540              | 09.08.2031            |                 | 27.300.000                                      | 414                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,580              | 09.08.2031            |                 | 27.142.600                                      | 399                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,650              | 12.08.2031            |                 | 20.330.800                                      | 282                     | 0,01   |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum |     | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,705 %            | 26.03.2031            | COP | 62.868.510      | \$ 737                                          | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,750              | 18.12.2029            |     | 13.699.000      | (108)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,760              | 21.11.2029            |     | 68.819.000      | (535)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,765              | 05.12.2029            |     | 19.609.600      | (151)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,770              | 18.07.2029            |     | 177.931.600     | (1.259)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,825              | 10.06.2030            |     | 11.230.000      | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,830              | 02.08.2029            |     | 33.701.500      | 221                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,900              | 28.04.2028            |     | 25.279.200      | 90                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,930              | 17.05.2029            |     | 70.869.400      | 364                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,950              | 18.06.2028            |     | 108.440.700     | (341)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,970              | 28.04.2028            |     | 58.558.000      | 181                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,990              | 12.06.2029            |     | 50.723.000      | 235                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,990              | 25.11.2034            |     | 88.471.800      | 1.596                                           | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,010              | 30.07.2029            |     | 18.250.500      | 91                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,020              | 04.12.2030            |     | 24.925.400      | 191                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,085              | 16.05.2029            |     | 75.630.200      | (292)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,090              | 21.06.2029            |     | 20.565.500      | 78                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,140              | 18.06.2030            |     | 37.816.000      | (201)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,150              | 19.03.2027            |     | 1.901.600       | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,150              | 28.04.2028            |     | 54.611.800      | 104                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,152              | 25.04.2029            |     | 100.846.700     | (335)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,155              | 24.06.2029            |     | 40.481.600      | 133                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,168              | 17.06.2029            |     | 28.186.700      | (90)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,180              | 05.07.2029            |     | 36.000.000      | (126)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,180              | 16.12.2029            |     | 60.262.400      | 239                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,200              | 18.06.2030            |     | 70.650.800      | 335                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,210              | 05.11.2029            |     | 56.599.000      | (207)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,210              | 18.06.2030            |     | 23.495.000      | (109)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,215              | 14.11.2028            |     | 29.612.100      | 148                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,250              | 18.06.2030            |     | 7.036.000       | 30                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,260              | 26.12.2027            |     | 81.641.400      | 53                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,260              | 18.06.2030            |     | 11.803.000      | (49)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,280              | 18.06.2030            |     | 44.652.000      | 176                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,300              | 20.12.2029            |     | 37.342.200      | 107                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,300              | 18.06.2030            |     | 88.944.100      | (334)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,340              | 20.12.2029            |     | 23.365.600      | 59                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,350              | 18.06.2030            |     | 78.510.600      | 207                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,360              | 31.05.2029            |     | 64.790.200      | 103                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,370              | 26.04.2029            |     | 105.284.000     | 157                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,375              | 19.03.2030            |     | 41.217.200      | (106)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,400              | 23.12.2029            |     | 54.000.000      | 106                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,400              | 19.03.2030            |     | 4.703.400       | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,415              | 04.06.2029            |     | 66.242.000      | 75                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,430              | 15.05.2030            |     | 26.162.500      | 63                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,460              | 23.12.2029            |     | 9.860.600       | 14                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,498              | 16.05.2030            |     | 103.299.000     | 180                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,510              | 29.04.2029            |     | 27.597.500      | 9                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,535              | 18.06.2030            |     | 70.770.000      | (102)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,540              | 19.03.2030            |     | 42.204.000      | 43                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,565              | 30.12.2027            |     | 65.850.600      | (68)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,600              | 11.04.2026            |     | 34.161.170      | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,611              | 19.03.2030            |     | 60.831.300      | (22)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,650              | 19.03.2030            |     | 51.456.000      | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,687              | 19.03.2030            |     | 49.104.200      | 18                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,690              | 26.12.2031            |     | 6.412.000       | (15)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,710              | 17.09.2030            |     | 131.991.100     | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,740              | 26.12.2031            |     | 86.000.000      | (145)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,755              | 17.09.2030            |     | 24.990.300      | 10                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,770              | 10.06.2030            |     | 33.683.000      | 30                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,790              | 19.03.2030            |     | 37.527.000      | 50                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,790              | 10.06.2030            |     | 22.456.000      | 25                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,800              | 18.06.2030            |     | 106.647.000     | (138)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,045              | 30.12.2031            |     | 33.177.900      | 64                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,300              | 26.03.2031            |     | 35.440.700      | (201)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,490              | 30.06.2032            |     | 6.936.040       | 47                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,525              | 18.06.2035            |     | 38.158.000      | (161)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,820              | 27.02.2033            |     | 9.049.540       | (98)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,368              | 18.06.2030            | KRW | 15.876.300      | (70)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,500              | 17.09.2027            |     | 116.536.800     | 323                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,500              | 17.09.2030            |     | 2.713.470       | (13)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month KRW-KORIBOR            | 3,820              | 20.12.2028            | SEK | 9.481.180       | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,021              | 07.10.2029            |     | 739.100         | (458)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,298              | 07.10.2029            |     | 744.300         | 1.523                                           | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,210              | 22.04.2027            | ZAR | 137.000         | (24)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,370              | 26.08.2030            |     | 198.400         | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,560              | 23.08.2029            |     | 210.700         | 93                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,560              | 22.09.2030            |     | 193.990         | 83                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,565              | 22.03.2026            |     | 300.200         | (54)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,570              | 27.05.2030            |     | 150.000         | 92                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,650              | 20.06.2030            |     | 391.370         | (194)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,700              | 18.06.2030            |     | 783.890         | (477)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,730              | 12.03.2030            |     | 460.400         | 545                                             | 0,01                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|---------------------------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 7,775 %            | 18.03.2030            | ZAR             | 355.000                                         | \$ (409)                | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 7,790              | 31.01.2030            |                 | 61.800                                          | 75                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 7,810              | 27.03.2030            |                 | 285.200                                         | (294)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 7,810              | 20.06.2030            |                 | 152.280                                         | 177                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 7,860              | 18.06.2030            |                 | 436.900                                         | 516                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 7,881              | 09.02.2026            |                 | 502.300                                         | (47)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 7,980              | 31.01.2030            |                 | 546.600                                         | 905                     | 0,02   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,000              | 03.01.2031            |                 | 120.500                                         | 174                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,020              | 28.02.2031            |                 | 203.700                                         | 299                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,070              | 30.11.2028            |                 | 83.300                                          | (148)                   | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,100              | 05.06.2026            |                 | 326.200                                         | (178)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,160              | 31.03.2032            |                 | 97.500                                          | 130                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,190              | 31.03.2032            |                 | 195.600                                         | 279                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,355              | 31.01.2030            |                 | 177.700                                         | (227)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,410              | 13.07.2025            |                 | 312.500                                         | (102)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,440              | 02.11.2028            |                 | 254.500                                         | 591                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,599              | 05.06.2029            |                 | 126.100                                         | (175)                   | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,735              | 31.01.2030            |                 | 110.200                                         | (372)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,820              | 31.01.2030            |                 | 804.500                                         | (1.237)                 | (0,03) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 8,872              | 24.07.2034            |                 | 386.900                                         | 689                     | 0,02   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR      | 10,150             | 18.05.2033            |                 | 121.800                                         | 906                     | 0,02   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 3,420              | 01.09.2030            | CLP             | 1.005.150                                       | 35                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,410              | 01.09.2030            |                 | 2.839.400                                       | 43                      | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,540              | 01.10.2028            |                 | 5.222.200                                       | 4                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,555              | 08.10.2029            |                 | 1.248.400                                       | 3                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,640              | 01.10.2028            |                 | 4.335.000                                       | (18)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,690              | 18.06.2030            |                 | 10.090.800                                      | 15                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,715              | 18.06.2030            |                 | 11.547.000                                      | (31)                    | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,750              | 10.04.2030            |                 | 28.532.500                                      | (132)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,765              | 18.06.2030            |                 | 4.336.000                                       | 22                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,775              | 23.02.2026            |                 | 46.910.600                                      | (212)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,800              | 13.02.2026            |                 | 8.882.500                                       | 1                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,855              | 18.12.2033            |                 | 5.907.500                                       | (49)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,890              | 01.10.2034            |                 | 5.270.800                                       | (65)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,920              | 13.02.2034            |                 | 2.120.600                                       | (8)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,960              | 19.03.2027            |                 | 12.968.000                                      | (123)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 4,970              | 18.06.2032            |                 | 8.384.100                                       | 63                      | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,000              | 19.07.2029            |                 | 14.528.500                                      | 250                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,020              | 01.09.2030            |                 | 2.050.000                                       | (36)                    | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,030              | 20.03.2033            |                 | 5.309.140                                       | (41)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,030              | 23.02.2034            |                 | 11.055.300                                      | 139                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,120              | 18.06.2035            |                 | 4.560.900                                       | 7                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,150              | 18.06.2030            |                 | 14.129.300                                      | 334                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,180              | 18.06.2030            |                 | 10.667.500                                      | 268                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,220              | 01.10.2028            |                 | 4.896.800                                       | (121)                   | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,240              | 01.09.2030            |                 | 3.103.000                                       | (90)                    | 0,00   |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,250              | 13.05.2033            |                 | 6.921.100                                       | 24                      | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,280              | 28.02.2030            |                 | 47.124.800                                      | (764)                   | (0,02) |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,285              | 19.03.2030            |                 | 5.946.900                                       | 182                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,300              | 18.05.2033            |                 | 2.475.470                                       | (67)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,313              | 25.04.2034            |                 | 10.208.500                                      | 254                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,350              | 01.09.2030            |                 | 4.575.000                                       | (158)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,350              | 01.10.2034            |                 | 6.370.000                                       | 166                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,360              | 28.06.2026            |                 | 47.053.000                                      | 468                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,360              | 18.05.2033            |                 | 2.594.000                                       | (80)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,360              | 26.04.2034            |                 | 8.585.800                                       | 246                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,400              | 01.04.2033            |                 | 3.613.700                                       | (125)                   | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,400              | 16.11.2033            |                 | 4.525.900                                       | 148                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,400              | 03.07.2034            |                 | 6.190.500                                       | 201                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,440              | 28.02.2035            |                 | 11.706.000                                      | 376                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,450              | 28.06.2034            |                 | 11.513.000                                      | (421)                   | (0,01) |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,500              | 13.11.2028            |                 | 8.851.800                                       | 134                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,500              | 19.03.2030            |                 | 8.333.200                                       | 343                     | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,550              | 01.10.2028            |                 | 3.722.930                                       | (61)                    | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,560              | 01.04.2033            |                 | 4.616.000                                       | 214                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,660              | 01.04.2033            |                 | 8.265.000                                       | 443                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,730              | 19.03.2035            |                 | 3.083.000                                       | 175                     | 0,00   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,750              | 13.05.2034            |                 | 7.085.400                                       | (4)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,780              | 03.10.2028            |                 | 4.803.000                                       | (213)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,790              | 06.10.2033            |                 | 8.590.000                                       | (566)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,820              | 01.09.2030            |                 | 1.514.470                                       | (91)                    | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,870              | 11.10.2033            |                 | 4.522.700                                       | (313)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,940              | 20.10.2033            |                 | 1.991.300                                       | (148)                   | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 5,990              | 20.10.2033            |                 | 18.919.110                                      | (1.483)                 | (0,03) |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 6,000              | 02.10.2028            |                 | 3.721.000                                       | (192)                   | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 6,146              | 30.10.2032            |                 | 32.521.400                                      | (2.823)                 | (0,07) |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 6,235              | 26.10.2033            |                 | 5.823.100                                       | (563)                   | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,130              | 09.04.2030            | CZK             | 623.500                                         | 500                     | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,145              | 09.04.2030            |                 | 95.400                                          | (76)                    | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,258              | 05.05.2030            |                 | 232.600                                         | 188                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,290              | 30.04.2030            |                 | 189.100                                         | 139                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,315              | 06.05.2030            |                 | 260.600                                         | 178                     | 0,00   |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum |     | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,325 %            | 06.05.2030            | CZK | 656.700         | \$ 433                                          | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,363              | 29.05.2030            |     | 899.000         | (512)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,365              | 28.11.2029            |     | 175.200         | 121                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,405              | 14.05.2030            |     | 236.800         | 112                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,445              | 01.08.2034            |     | 163.840         | 99                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,475              | 31.07.2034            |     | 95.050          | 47                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,480              | 15.07.2029            |     | 362.600         | (27)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,485              | 16.05.2030            |     | 218.200         | 65                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,513              | 30.09.2030            |     | 198.000         | (39)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,524              | 16.02.2034            |     | 334.600         | 343                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,525              | 13.03.2031            |     | 177.400         | (65)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,528              | 29.07.2034            |     | 235.400         | 66                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,530              | 15.07.2029            |     | 94.900          | (64)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,550              | 24.01.2030            |     | 102.500         | (20)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,554              | 11.06.2030            |     | 883.264         | 56                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,566              | 30.07.2034            |     | 95.200          | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,645              | 01.02.2029            |     | 1.498.300       | 37                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 3,765              | 09.01.2029            |     | 425.000         | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 4,070              | 23.11.2028            |     | 255.900         | 220                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR     | 4,130              | 03.06.2029            |     | 335.900         | (326)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 4,250              | 18.04.2029            |     | 396.300         | (26)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR     | 4,388              | 15.11.2028            |     | 1.295.400       | 1.225                                           | 0,03                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250              | 17.09.2030            | €   | 1.100           | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,100              | 20.09.2030            |     | 18.000          | (434)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 1,760              | 21.01.2030            | HUF | 1.296.900       | 436                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 2,420              | 02.08.2026            |     | 3.964.700       | (531)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 2,680              | 29.06.2031            |     | 1.938.800       | (620)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 4,790              | 17.01.2027            |     | 5.742.020       | (182)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 5,440              | 15.01.2029            |     | 2.611.700       | 182                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 5,850              | 06.05.2030            |     | 637.500         | (22)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 5,880              | 08.02.2029            |     | 4.459.930       | 102                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 5,890              | 09.05.2030            |     | 16.426.200      | (480)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,040              | 12.02.2034            |     | 163.400         | 14                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,079              | 22.10.2029            |     | 7.213.600       | 1.022                                           | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,080              | 12.02.2034            |     | 411.700         | 31                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,090              | 21.10.2029            |     | 26.235.400      | 3.535                                           | 0,08                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,100              | 08.02.2034            |     | 2.716.000       | 192                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,210              | 26.06.2030            |     | 29.679.800      | (367)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,250              | 09.04.2030            |     | 7.830.700       | (144)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,265              | 08.04.2030            |     | 6.467.400       | (106)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,265              | 28.04.2032            |     | 6.409.000       | 19                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,270              | 16.06.2030            |     | 8.974.000       | 164                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,299              | 10.06.2029            |     | 2.872.900       | (72)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,363              | 31.01.2030            |     | 9.453.400       | 265                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,392              | 11.03.2030            |     | 8.878.000       | 236                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,430              | 04.02.2030            |     | 6.173.700       | 226                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,450              | 06.06.2029            |     | 3.099.500       | (125)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,511              | 05.02.2030            |     | 11.657.900      | 546                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR        | 6,580              | 16.05.2035            |     | 1.988.000       | (15)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 6,650              | 13.03.2030            |     | 3.144.500       | 203                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 7,330              | 06.11.2028            |     | 4.993.600       | 371                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 8,740              | 28.04.2028            |     | 1.060.580       | 83                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR        | 9,230              | 26.08.2032            |     | 1.440.400       | 934                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR      | 0,925              | 16.10.2030            | PLN | 1.500           | (31)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 1,460              | 28.05.2026            |     | 67.700          | (896)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 2,585              | 14.10.2029            |     | 15.200          | 152                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 2,920              | 13.12.2031            |     | 3.800           | 66                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 3,962              | 06.05.2030            |     | 110.800         | 384                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,015              | 17.04.2030            |     | 50.500          | 157                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,019              | 18.04.2030            |     | 49.900          | 151                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,048              | 18.04.2030            |     | 25.100          | 67                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,049              | 18.04.2030            |     | 36.000          | 95                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,065              | 18.04.2030            |     | 24.900          | 61                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,075              | 07.03.2027            |     | 37.000          | 119                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,180              | 15.05.2029            |     | 205.200         | 47                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,259              | 08.08.2029            |     | 36.900          | (181)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,313              | 25.07.2029            |     | 19.100          | (62)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,320              | 25.07.2029            |     | 14.400          | (49)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,328              | 25.07.2029            |     | 19.300          | (66)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,360              | 25.07.2028            |     | 76.900          | (266)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,388              | 09.08.2029            |     | 12.400          | (81)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,415              | 12.08.2029            |     | 65.700          | (447)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,495              | 22.11.2029            |     | 31.500          | 426                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,510              | 25.04.2029            |     | 116.000         | (325)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,545              | 25.04.2029            |     | 60.800          | (192)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,560              | 06.11.2028            |     | 262.600         | (2.388)                                         | (0,06)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,560              | 02.09.2029            |     | 125.700         | 1.027                                           | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,660              | 19.02.2029            |     | 43.700          | 130                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,680              | 03.11.2028            |     | 14.200          | (174)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,680              | 25.04.2029            |     | 35.500          | 160                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,695              | 28.03.2030            |     | 22.400          | (70)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,710              | 25.05.2027            |     | 73.900          | (139)                                           | 0,00                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,730 %            | 16.02.2029            | PLN 41.100      | \$ 151                                          | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,735              | 09.10.2028            | 62.400          | (648)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,740              | 25.10.2033            | 46.000          | (568)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,750              | 02.08.2029            | 38.000          | 420                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,760              | 25.10.2033            | 14.700          | 162                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,810              | 16.02.2029            | 49.600          | 222                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,820              | 25.07.2029            | 80.200          | (720)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,850              | 25.10.2033            | 33.300          | 425                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,855              | 10.02.2030            | 225.000         | 1.128                                           | 0,03                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,865              | 18.07.2029            | 47.600          | 595                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,910              | 25.07.2027            | 29.920          | (271)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,923              | 22.03.2029            | 167.900         | 1.077                                           | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,930              | 25.07.2029            | 58.600          | (561)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,970              | 21.03.2029            | 96.300          | 595                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,970              | 25.10.2033            | 8.000           | 122                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,000              | 25.04.2029            | 83.600          | (647)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,010              | 25.07.2029            | 79.300          | (832)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,020              | 21.03.2029            | 26.100          | 179                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,055              | 25.10.2033            | 48.300          | 897                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,105              | 12.07.2029            | 78.700          | 1.219                                           | 0,03                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,155              | 25.10.2034            | 60.000          | 1.227                                           | 0,03                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,158              | 22.03.2027            | 339.900         | 1.171                                           | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,220              | 20.03.2033            | 4.100           | (58)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,310              | 21.03.2033            | 40.800          | (482)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,870              | 22.04.2027            | 1.000           | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 5,960              | 25.04.2027            | 67.900          | (545)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 6,456              | 25.05.2027            | 20.800          | (228)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 6,480              | 25.05.2027            | 45.100          | (500)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 6,560              | 25.05.2027            | 15.800          | (182)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR      | 7,310              | 30.06.2027            | 15.300          | (239)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,582              | 02.04.2030            | MXN 544.400     | (110)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,720              | 01.04.2030            | 250.300         | 23                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,748              | 02.04.2030            | 116.800         | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 7,750              | 13.06.2029            | 1.021.100       | (251)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,750              | 01.04.2030            | 382.100         | 44                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,753              | 16.04.2030            | 701.400         | 122                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,760              | 01.03.2029            | 372.500         | 117                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 7,768              | 12.06.2030            | 481.100         | (89)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,775              | 01.04.2030            | 349.800         | 74                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 7,775              | 12.06.2030            | 390.300         | (79)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,790              | 31.05.2029            | 435.000         | 142                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,790              | 01.04.2030            | 149.900         | 37                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 7,790              | 12.06.2030            | 229.000         | (54)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 7,800              | 12.06.2030            | 292.800         | (75)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,820              | 31.05.2029            | 451.000         | 172                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,825              | 31.05.2029            | 428.900         | 168                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 7,936              | 12.06.2030            | 574.900         | (321)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,075              | 17.03.2027            | 788.800         | 378                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,250              | 01.03.2029            | 247.100         | (101)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,267              | 28.02.2030            | 1.393.400       | (1.787)                                         | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,270              | 07.03.2035            | 76.100          | 52                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,280              | 01.03.2029            | 21.400          | (26)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,285              | 06.06.2035            | 232.600         | (168)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,290              | 27.02.2032            | 126.700         | 160                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,330              | 01.03.2029            | 21.800          | (28)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,365              | 28.03.2035            | 81.700          | 86                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,485              | 31.05.2029            | 716.300         | (342)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,495              | 31.05.2029            | 5.600           | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,500              | 31.05.2029            | 1.130.000       | (1.849)                                         | (0,04)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,515              | 22.02.2035            | 194.100         | (313)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,545              | 23.11.2034            | 113.600         | 199                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,550              | 22.02.2035            | 129.900         | (226)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,595              | 13.03.2030            | 660.600         | (1.309)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,620              | 05.12.2029            | 578.600         | 1.144                                           | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,640              | 07.03.2035            | 155.600         | (321)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,650              | 31.01.2030            | 246.600         | 511                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,655              | 07.03.2035            | 193.100         | (409)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,665              | 11.12.2029            | 399.600         | (830)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,740              | 07.03.2035            | 18.900          | (46)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,800              | 12.12.2029            | 769.700         | 1.436                                           | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,820              | 23.11.2034            | 271.100         | (741)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,855              | 09.02.2035            | 598.400         | (1.707)                                         | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,065              | 01.03.2029            | 73.600          | 188                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,150              | 31.12.2029            | 56.000          | 172                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 9,180              | 08.01.2030            | 72.300          | (229)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,295              | 29.12.2025            | 83.600          | 27                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 28-Day MXN-TIIE        | 9,295              | 30.10.2028            | 83.600          | 129                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,295              | 28.12.2034            | 223.100         | 988                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,295              | 29.12.2034            | 441.900         | 1.971                                           | 0,05                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,370              | 21.12.2034            | 278.500         | 1.310                                           | 0,03                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                    |                       |                 | \$ (25.271)                                     | (0,59)                  |
|                                                |                        |                    |                       |                 | \$ (25.273)                                     | (0,59)                  |

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

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

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

**OPTIONSKAUF**
**DEISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|----------|------------|-----------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,650     | 11.03.2026     | 24.134                     | \$ 165   | \$ 176     | 0,01                  |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000    | 27.08.2025     | 19.971                     | 92       | 121        | 0,00                  |
|            | Put - OTC USD versus COP  | COP 3.825,000  | 29.08.2025     | 2.324                      | 237      | 164        | 0,00                  |
| GLM        | Put - OTC USD versus JPY  | ¥ 135,000      | 19.08.2025     | 13.333                     | 1.187    | 849        | 0,02                  |
|            | Put - OTC USD versus MXN  | MXN 18,500     | 10.07.2025     | 1.984                      | 387      | 105        | 0,00                  |
| JPM        | Put - OTC USD versus MXN  | 19,250         | 19.11.2025     | 46.309                     | 865      | 1.308      | 0,03                  |
|            | Put - OTC USD versus ZAR  | ZAR 17,650     | 08.08.2025     | 40.068                     | 580      | 409        | 0,01                  |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,750     | 09.12.2025     | 22.579                     | 135      | 172        | 0,01                  |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,700         | 16.12.2025     | 13.611                     | 85       | 92         | 0,00                  |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000    | 27.08.2025     | 19.863                     | 90       | 120        | 0,00                  |
|            | Put - OTC USD versus BRL  | BRL 5,660      | 27.08.2025     | 42.462                     | 762      | 1.441      | 0,03                  |
|            | Put - OTC USD versus COP  | COP 3.825,000  | 04.09.2025     | 2.320                      | 225      | 179        | 0,01                  |
|            | Call - OTC USD versus ILS | ILS 3,880      | 04.09.2025     | 1.520                      | 180      | 14         | 0,00                  |
|            |                           |                |                |                            | \$ 4.990 | \$ 5.150   | 0,12                  |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|--------|------------|-----------------------|
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Zahlung                           | 3,850 %        | 10.07.2025     | 92.400                     | \$ 162 | \$ 113     | 0,00                  |

**VERKAUFSOPTIONEN**
**DEISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|------------|------------|-----------------------|
| GLM        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,300     | 15.07.2025     | 1.831                      | \$ (39)    | \$ 0       | 0,00                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 45,800         | 15.07.2025     | 1.831                      | (23)       | (3)        | 0,00                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 53,500         | 11.12.2025     | 42.152                     | (1.369)    | (1.125)    | (0,02)                |
| JPM        | Put - OTC USD versus MXN  | MXN 18,250     | 19.11.2025     | 46.309                     | (222)      | (300)      | (0,01)                |
|            | Put - OTC USD versus ZAR  | ZAR 17,250     | 08.08.2025     | 80.137                     | (500)      | (273)      | (0,01)                |
| MYI        | Put - OTC USD versus BRL  | BRL 5,400      | 27.08.2025     | 42.462                     | (217)      | (346)      | (0,01)                |
|            | Call - OTC USD versus BRL | 6,050          | 27.08.2025     | 42.462                     | (557)      | (108)      | 0,00                  |
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750     | 11.08.2025     | 4.008                      | (125)      | (3)        | 0,00                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750         | 11.08.2025     | 4.008                      | (88)       | (21)       | 0,00                  |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 40,575         | 19.08.2025     | 5.392                      | (189)      | (28)       | 0,00                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 52,725         | 19.08.2025     | 5.392                      | (117)      | (29)       | 0,00                  |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600         | 12.11.2025     | 4.140                      | (157)      | (23)       | 0,00                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900         | 12.11.2025     | 4.140                      | (116)      | (77)       | 0,00                  |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,635         | 07.01.2026     | 16.835                     | (571)      | (146)      | 0,00                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 07.01.2026     | 16.835                     | (382)      | (488)      | (0,01)                |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,800         | 08.01.2026     | 25.138                     | (862)      | (244)      | (0,01)                |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 08.01.2026     | 25.138                     | (577)      | (735)      | (0,02)                |
|            |                           |                |                |                            | \$ (6.111) | \$ (3.949) | (0,09)                |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|----------|------------|-----------------------|
| BOA        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,270 %        | 26.08.2025     | 440.900                    | \$ (104) | \$ (110)   | 0,00                  |
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 04.07.2025     | 182.200                    | (129)    | (1)        | 0,00                  |
|            | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 10.07.2025     | 92.400                     | (54)     | (3)        | 0,00                  |
| MYC        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,430          | 22.09.2025     | 461.886                    | (141)    | (232)      | (0,01)                |
|            |                                      |                         |                                   |                |                |                            | \$ (428) | \$ (346)   | (0,01)                |

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



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond       | (1,000) %                   | 20.06.2029       | \$ 7.400                  | \$ 159                                 | \$ (113)                                  | \$ 46     | 0,00                 |
|            | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.12.2029       | 18.800                    | 563                                    | (306)                                     | 257       | 0,01                 |
|            | Chile Government International Bond        | (1,000)                     | 20.12.2029       | 3.600                     | (69)                                   | (9)                                       | (78)      | 0,00                 |
| BRC        | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.06.2029       | 12.300                    | 277                                    | (200)                                     | 77        | 0,00                 |
|            | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.12.2029       | 3.100                     | 102                                    | (59)                                      | 43        | 0,00                 |
|            | Chile Government International Bond        | (1,000)                     | 20.12.2028       | 6.400                     | (125)                                  | (8)                                       | (133)     | (0,01)               |
|            | Chile Government International Bond        | (1,000)                     | 20.12.2029       | 1.200                     | (23)                                   | (3)                                       | (26)      | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2033       | 27.300                    | (67)                                   | 36                                        | (31)      | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.06.2034       | 14.400                    | (126)                                  | 144                                       | 18        | 0,00                 |
| CBK        | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2034       | 6.750                     | (24)                                   | 48                                        | 24        | 0,00                 |
|            | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.12.2029       | 16.200                    | 478                                    | (256)                                     | 222       | 0,01                 |
| JPM        | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.06.2029       | 19.900                    | 463                                    | (339)                                     | 124       | 0,00                 |
| MYC        | Chile Government International Bond        | (1,000)                     | 20.12.2029       | 3.300                     | (64)                                   | (8)                                       | (72)      | 0,00                 |
|            | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.06.2029       | 38.400                    | 922                                    | (682)                                     | 240       | 0,01                 |
|            |                                            |                             |                  |                           | \$ 2.466                               | \$ (1.755)                                | \$ 711    | 0,02                 |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Peru Government International Bond         | 1,000 %                     | 20.12.2029       | \$ 3.600                  | \$ 23                                  | \$ 16                                     | \$ 39     | 0,00                 |
| BPS        | Mexico Government International Bond       | 1,000                       | 20.12.2025       | 7.070                     | 34                                     | (8)                                       | 26        | 0,00                 |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                       | 20.12.2027       | 6.800                     | 14                                     | 49                                        | 63        | 0,00                 |
|            | Romania Government International Bond      | 1,000                       | 20.12.2025       | 17.275                    | 28                                     | (3)                                       | 25        | 0,00                 |
| BRC        | Peru Government International Bond         | 1,000                       | 20.12.2029       | 1.200                     | 8                                      | 5                                         | 13        | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000                       | 20.06.2030       | 72.700                    | 1.025                                  | 40                                        | 1.065     | 0,03                 |
|            | South Korea Government International Bond  | 1,000                       | 20.12.2025       | 6.200                     | 42                                     | (16)                                      | 26        | 0,00                 |
|            | Israel Government International Bond       | 1,000                       | 20.06.2030       | 625                       | (8)                                    | 11                                        | 3         | 0,00                 |
| DUB        | Eskom Holdings SOC Ltd.                    | 4,650                       | 30.06.2029       | 11.200                    | 0                                      | 664                                       | 664       | 0,02                 |
| GST        | Israel Government International Bond       | 1,000                       | 20.12.2025       | 13.800                    | 15                                     | 27                                        | 42        | 0,00                 |
|            | Israel Government International Bond       | 1,000                       | 20.06.2026       | 2.100                     | 0                                      | 11                                        | 11        | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 3,750                       | 24.12.2025       | 8.403                     | 0                                      | 14                                        | 14        | 0,00                 |
| JPM        | Petroleos Mexicanos                        | 4,850                       | 07.05.2026       | 15.840                    | 0                                      | 194                                       | 194       | 0,00                 |
|            | Israel Government International Bond       | 1,000                       | 20.06.2030       | 800                       | (9)                                    | 12                                        | 3         | 0,00                 |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                       | 20.12.2029       | 3.300                     | 21                                     | 14                                        | 35        | 0,00                 |
|            |                                            |                             |                  |                           | \$ 1.193                               | \$ 1.030                                  | \$ 2.223  | 0,05                 |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                        | Zahlung                                                                                                          | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------------------------|--------------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung             | 18.09.2030       | \$ 44.985                     | IDR 2.588.952                  | \$ (112)                               | \$ (491)                                  | \$ (603)  | (0,01)               |
| CBK        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day IDR-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,682 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2035       | IDR 163.955.280               | \$ 9.958                       | 76                                     | 297                                       | 373       | 0,01                 |

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                                        | Zahlung                                                                                                                          | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag<br>erhaltener<br>Währung | Nenn-<br>betrag<br>gelieferter<br>Währung | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |        |
|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|--------|
| DUB        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day KRW-<br>SOFR abzgl. 0,510 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der erhaltenen<br>Währung               | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.09.2028            | KRW                                 | 17.617.620                                | \$ 12.926                                | \$ 0                                            | \$ 1           | \$ 1                         | 0,00   |
| GLM        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day IDR-SOFR<br>Compounded-OIS zzgl.<br>0,639 % basierend auf dem<br>Nennbetrag der erhaltenen<br>Währung  | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.09.2030            | INR                                 | 5.244.540                                 | 60.595                                   | 824                                             | 352            | 1.176                        | 0,03   |
|            | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day KRW-<br>SOFR abzgl. 0,500 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der erhaltenen<br>Währung               | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.09.2028            | KRW                                 | 40.765.380                                | 30.064                                   | (155)                                           | 11             | (144)                        | (0,01) |
|            | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>zzgl. 0,486 % basierend auf<br>dem Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 3-Month PHP-<br>LIBOR basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung                | 17.09.2030            | \$                                  | 8.443                                     | PHP 486.106                              | (24)                                            | (93)           | (117)                        | 0,00   |
| JPM        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>zzgl. 0,486 % basierend auf<br>dem Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 3-Month PHP-<br>LIBOR basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung                | 17.09.2030            |                                     | 12.629                                    | 724.510                                  | 9                                               | (138)          | (129)                        | 0,00   |
| SCX        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day IDR-SOFR<br>Compounded-OIS zzgl.<br>0,651 % basierend auf dem<br>Nennbetrag der erhaltenen<br>Währung  | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 18.03.2033            | IDR                                 | 216.990.030                               | \$ 12.708                                | 239                                             | 214            | 453                          | 0,01   |
|            |                                                                                                                                               |                                                                                                                                  |                       |                                     |                                           | \$ 857                                   | \$ 153                                          | \$ 1.010       |                              | 0,03   |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt     | variabler<br>Zinssatz          | variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------------|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Zahlung <sup>(1)</sup> | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500 %                 | 18.03.2031         | CNY                   | 244.020         | \$ (223)                                     | \$ 267                                          | \$ 44          | 0,00                         |
|            | Zahlung                | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,500                   | 18.09.2026         | MYR                   | 886.300         | (2)                                          | 782                                             | 780            | 0,02                         |
|            | Erhalt                 | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,500                   | 18.06.2030         |                       | 99.620          | (220)                                        | (118)                                           | (338)          | (0,01)                       |
|            | Zahlung                | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,868                   | 20.12.2028         |                       | 42.600          | 125                                          | 123                                             | 248            | 0,01                         |
| BSH        | Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,300                   | 21.06.2029         | CLP                   | 3.450.000       | 0                                            | 172                                             | 172            | 0,01                         |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,750                   | 22.03.2026         |                       | 8.000.000       | 0                                            | (87)                                            | (87)           | 0,00                         |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,790                   | 14.03.2026         |                       | 3.885.000       | 7                                            | (49)                                            | (42)           | 0,00                         |
| CBK        | Erhalt                 | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,960                   | 10.05.2029         | COP                   | 27.236.900      | 0                                            | 585                                             | 585            | 0,01                         |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,763                   | 24.05.2029         | CLP                   | 1.841.700       | 10                                           | (68)                                            | (58)           | 0,00                         |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,770                   | 19.03.2026         |                       | 64.800          | 0                                            | (1)                                             | (1)            | 0,00                         |
| GLM        | Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,015                   | 20.06.2026         |                       | 5.555.000       | 0                                            | 92                                              | 92             | 0,00                         |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,265                   | 14.06.2029         |                       | 4.122.200       | 0                                            | (211)                                           | (211)          | (0,01)                       |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,830                   | 22.05.2029         |                       | 7.729.900       | 0                                            | (225)                                           | (225)          | (0,01)                       |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 4,095                   | 01.06.2027         |                       | 12.230.000      | 0                                            | (83)                                            | (83)           | 0,00                         |
|            | Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 4,319                   | 22.05.2029         |                       | 19.808.000      | 0                                            | (190)                                           | (190)          | 0,00                         |
| GST        | Zahlung                | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,500                   | 20.03.2027         | MYR                   | 188.350         | 25                                           | 251                                             | 276            | 0,01                         |
|            | Zahlung                | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,868                   | 20.12.2028         |                       | 298.400         | 896                                          | 842                                             | 1.738          | 0,04                         |
| JPM        | Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR           | 3,540                   | 04.06.2029         | CLP                   | 4.115.000       | 0                                            | 167                                             | 167            | 0,00                         |
| MYC        | Zahlung                | 1-Year BRL-CDI                 | 7,813                   | 04.01.2027         | BRL                   | 12.200          | 17                                           | (290)                                           | (273)          | (0,01)                       |
| SCX        | Zahlung <sup>(1)</sup> | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500                   | 18.03.2031         | CNY                   | 49.670          | (32)                                         | 41                                              | 9              | 0,00                         |
|            |                        |                                |                         |                    |                       |                 | \$ 603                                       | \$ 2.000                                        | \$ 2.603       | 0,06                         |

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

## TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier                                      | Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Einheiten | Variabler<br>Zinssatz | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------|-------------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|-----------------|-----------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| SCX        | Erhalt         | U.S. Treasury Inflation<br>Protected Securities | 0                                          | 4,940 %               | INR 10.015.210  | 24.09.2025            | \$ 0                                         | \$ 1.178                                        | \$ 1.178       | 0,03                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

### VOLATILITÄTSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>Volatilität | Referenzeinheit                                              | Volatilität<br>Ausübungskurs | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------------------------|-----------------------|-----------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Zahlung                           | USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 6,850 %                      | 11.09.2025            | \$ 142          | \$ 0                                         | \$ 376                                          | \$ 376         | 0,01                         |
|            | Erhalt                            | USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 7,000                        | 11.12.2025            | 142             | 0                                            | 351                                             | 351            | 0,01                         |
| JPM        | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,600                        | 24.11.2025            | 83              | 0                                            | (113)                                           | (113)          | (0,01)                       |
|            | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,725                        | 26.11.2025            | 44              | 0                                            | (55)                                            | (55)           | 0,00                         |
| SCX        | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,450                        | 21.11.2025            | 49              | 0                                            | (74)                                            | (74)           | 0,00                         |
|            |                                   |                                                              |                              |                       |                 | \$ 0                                         | \$ 485                                          | \$ 485         | 0,01                         |

<sup>(1)</sup> Varianz-Swap.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD                    | 1.636                    | \$ 1.063                         | \$ 0                               | \$ (9)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 35.406                   | 41.456                           | 0                                  | (105)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 3.097                    | CNH 22.314                       | 21                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.861                    | NZD 3.092                        | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NZD                    | 3.092                    | \$ 1.863                         | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.063                    | AUD 1.636                        | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 45.051                   | CNH 321.943                      | 62                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 41.547                   | € 35.406                         | 105                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PHP                    | 927.871                  | \$ 16.586                        | 163                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 45.344                   | 7.917                            | 0                                  | (391)                                                | (0,01)                  |
| BOA        | 07.2025               | DOP                    | 793.423                  | 13.287                           | 66                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 76.961                   | 87.509                           | 0                                  | (2.833)                                              | (0,07)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 95.138.018               | 5.831                            | 0                                  | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MYR                    | 89.186                   | 21.030                           | 0                                  | (164)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 36.816                   | 10.080                           | 0                                  | (293)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 9                        | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 4.536                    | BRL 25.572                       | 149                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.272                    | IDR 37.038.598                   | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.153                    | KRW 2.935.152                    | 17                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 65.926                   | MYR 279.224                      | 449                                | 0                                                    | 0,01                    |
| BPS        | 07.2025               |                        | 9.000                    | PLN 32.684                       | 41                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.778                    | UYU 72.578                       | 36                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 7.260                    | \$ 1.015                         | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CZK                    | 630.179                  | 29.509                           | 0                                  | (464)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | DOP                    | 155.336                  | 2.594                            | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 2.422.461                | € 5.991                          | 0                                  | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 4.492                    | \$ 12                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 497                      | 15                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 22.953                   | CNH 164.998                      | 168                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 7                        | SGD 9                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 09.2025               | COP                    | 23.196.113               | \$ 5.578                         | 0                                  | (53)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 61.335                   | 3.222                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 41.688                   | 11.413                           | 0                                  | (310)                                                | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 6.205                    | MXN 120.383                      | 116                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 03.2030               |                        | 12.534                   | IDR 246.110.438                  | 1.065                              | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 1.952.200                | \$ 13.561                        | 46                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 13.096                   | 3.587                            | 0                                  | (103)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 555.105                  | 13.719                           | 0                                  | (93)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 97.161                   | 2.991                            | 0                                  | (354)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 21.100                   | BRL 121.074                      | 1.084                              | 0                                                    | 0,03                    |
| BPS        | 07.2025               |                        | 43.748                   | CNH 313.738                      | 99                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 23.955                   | CNY 171.436                      | 27                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 321                      | € 278                            | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 17.645                   | IDR 288.237.479                  | 107                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 10                       | PHP 583                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.533                    | PLN 9.180                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.521                    | RON 11.033                       | 26                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 74.112                   | THB 2.405.466                    | 8                                  | (120)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 132.852                  | \$ 18.334                        | 1                                  | (284)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | CNY                    | 264                      | 37                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 08.2025               | TRY                    | 670.414                  | 16.150                           | 0                                  | (185)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 216.396                  | 6.701                            | 0                                  | (821)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 76.250                   | CNH 549.442                      | 743                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 08.2025               |                        | 526                      | CNY 3.759                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 3.989                    | CZK 88.689                       | 230                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 819                      | HUF 286.460                      | 20                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 12.919                   | INR 1.122.923                    | 143                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 14.029                   | TWD 415.532                      | 415                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 11.660.414               | \$ 2.826                         | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 3.715                    | PEN 13.471                       | 73                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 10.2025               | €                      | 13.244                   | \$ 14.237                        | 0                                  | (1.422)                                              | (0,03)                  |
|            | 05.2026               | \$                     | 9.910                    | KWD 3.020                        | 0                                  | (37)                                                 | 0,00                    |
|            | 06.2026               |                        | 2.621                    | 800                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 06.2027               |                        | 3.252                    | 986                              | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                    |
|            | 05.2029               | KWD                    | 14.212                   | \$ 48.857                        | 2.136                              | 0                                                    | 2,136                   |
|            | 07.2029               |                        | 1.703                    | 5.859                            | 255                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 05.2030               |                        | 9.995                    | 34.422                           | 1.375                              | 0                                                    | 1,375                   |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende |            | Zu erhaltende |             | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte               |                         |         |        |
|------------|-----------------------|-------------|------------|---------------|-------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|-------------------------|---------|--------|
|            |                       | Währung     |            | Währung       |             |                                  |                                    | Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |         |        |
| BRC        | 07.2025               | €           | 11.163     | \$            | 12.791      | \$                               | 0                                  | \$ (313)                        | \$ (313)                | (0,01)  |        |
|            | 07.2025               | ILS         | 2.708      |               | 802         |                                  | 0                                  | (2)                             | (2)                     | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | KRW         | 21.352     |               | 16          |                                  | 0                                  | 0                               | 0                       | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | MYR         | 87.863     |               | 20.745      |                                  | 0                                  | (135)                           | (135)                   | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | PLN         | 15.734     |               | 4.200       |                                  | 0                                  | (154)                           | (154)                   | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | TRY         | 534.519    |               | 13.090      |                                  | 0                                  | (119)                           | (119)                   | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | \$          | 6.370      | £             | 4.682       |                                  | 46                                 | 0                               | 46                      | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 3.370      | IDR           | 55.033.426  |                                  | 20                                 | 0                               | 20                      | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 1.617      | ILS           | 5.631       |                                  | 55                                 | 0                               | 55                      | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 61         | ¥             | 8.729       |                                  | 0                                  | 0                               | 0                       | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 18         | KRW           | 25.005      |                                  | 0                                  | 0                               | 0                       | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 58.182     | MYR           | 246.290     |                                  | 358                                | 0                               | 358                     | 0,01    |        |
|            | 07.2025               |             | 153        | NOK           | 1.553       |                                  | 1                                  | 0                               | 1                       | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 115.305    | PLN           | 428.638     |                                  | 3.262                              | 0                               | 3.262                   | 0,08    |        |
|            | 07.2025               |             | 7.398      | THB           | 241.391     |                                  | 43                                 | 0                               | 43                      | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 33.001     | TRY           | 1.350.795   |                                  | 484                                | 0                               | 484                     | 0,01    |        |
|            | 07.2025               |             | 3.095      | ZAR           | 54.993      |                                  | 0                                  | (6)                             | (6)                     | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | ZAR         | 1.360.882  | \$            | 76.201      |                                  | 189                                | (445)                           | (256)                   | (0,01)  |        |
|            | 08.2025               | €           | 5.991      | HUF           | 2.422.521   |                                  | 34                                 | 0                               | 34                      | 0,00    |        |
|            | 08.2025               | £           | 4.682      | \$            | 6.371       |                                  | 0                                  | (46)                            | (46)                    | 0,00    |        |
|            | 08.2025               | \$          | 39.780     | CZK           | 884.693     |                                  | 2.299                              | 0                               | 2.299                   | 0,05    |        |
|            | 08.2025               |             | 44.117     | TRY           | 1.837.141   |                                  | 518                                | 0                               | 518                     | 0,01    |        |
|            | 09.2025               |             | 349        | COP           | 1.453.365   |                                  | 4                                  | 0                               | 4                       | 0,00    |        |
|            | 09.2025               |             | 287        | MXN           | 5.498       |                                  | 1                                  | 0                               | 1                       | 0,00    |        |
|            | 10.2025               | PEN         | 75.554     | \$            | 20.638      |                                  | 0                                  | (592)                           | (592)                   | (0,01)  |        |
|            | 11.2025               |             | 92.066     |               | 25.050      |                                  | 0                                  | (802)                           | (802)                   | (0,02)  |        |
|            | 12.2025               | \$          | 3.233      | TRY           | 150.727     |                                  | 65                                 | 0                               | 65                      | 0,00    |        |
|            | BSH                   | 07.2025     | PEN        | 50.424        | \$          | 13.578                           |                                    | 0                               | (629)                   | (629)   | (0,01) |
|            |                       | 07.2025     | \$         | 14.408        | PEN         | 52.003                           |                                    | 243                             | 0                       | 243     | 0,01   |
|            |                       | 08.2025     | PEN        | 101.220       | \$          | 27.437                           |                                    | 0                               | (1.045)                 | (1.045) | (0,02) |
|            |                       | 09.2025     | \$         | 10.899        | PEN         | 39.873                           |                                    | 313                             | 0                       | 313     | 0,01   |
|            | CBK                   | 11.2025     | PEN        | 56.454        | \$          | 15.537                           |                                    | 0                               | (310)                   | (310)   | (0,01) |
|            |                       | 07.2025     | CNY        | 164.058       |             | 22.887                           |                                    | 0                               | (60)                    | (60)    | 0,00   |
|            |                       | 07.2025     | EGP        | 47.661        |             | 864                              |                                    | 0                               | (88)                    | (88)    | 0,00   |
|            |                       | 07.2025     | KRW        | 4.441.766     |             | 3.237                            |                                    | 0                               | (48)                    | (48)    | 0,00   |
|            |                       | 07.2025     | PEN        | 151.413       |             | 41.789                           |                                    | 0                               | (874)                   | (874)   | (0,02) |
| 07.2025    |                       | PHP         | 505.711    |               | 8.991       |                                  | 29                                 | 0                               | 29                      | 0,00    |        |
| 07.2025    |                       | SEK         | 14.750     |               | 1.554       |                                  | 6                                  | 0                               | 6                       | 0,00    |        |
| 07.2025    |                       | THB         | 2.739.309  |               | 83.211      |                                  | 0                                  | (1.053)                         | (1.053)                 | (0,02)  |        |
| 07.2025    |                       | TWD         | 524.536    |               | 17.157      |                                  | 0                                  | (900)                           | (900)                   | (0,02)  |        |
| 07.2025    |                       | \$          | 24.586     | CNY           | 176.064     |                                  | 50                                 | 0                               | 50                      | 0,00    |        |
| 07.2025    |                       |             | 5.833      | €             | 4.980       |                                  | 13                                 | 0                               | 13                      | 0,00    |        |
| 07.2025    |                       |             | 51.389     | IDR           | 836.860.403 |                                  | 151                                | 0                               | 151                     | 0,00    |        |
| 07.2025    |                       |             | 2.676      | PEN           | 9.707       |                                  | 59                                 | 0                               | 59                      | 0,00    |        |
| 07.2025    |                       |             | 162.931    | THB           | 5.340.276   |                                  | 1.513                              | 0                               | 1.513                   | 0,04    |        |
| 07.2025    |                       |             | 921        | TWD           | 27.310      |                                  | 19                                 | 0                               | 19                      | 0,00    |        |
| 08.2025    |                       | CLP         | 19.415.039 | \$            | 20.218      |                                  | 0                                  | (583)                           | (583)                   | (0,01)  |        |
| 08.2025    |                       | COP         | 88.097.663 |               | 21.125      |                                  | 0                                  | (328)                           | (328)                   | (0,01)  |        |
| 08.2025    |                       | EGP         | 35.113     |               | 654         |                                  | 0                                  | (40)                            | (40)                    | 0,00    |        |
| 08.2025    |                       | PEN         | 31.363     |               | 8.409       |                                  | 0                                  | (422)                           | (422)                   | (0,01)  |        |
| 08.2025    |                       | TWD         | 191.189    |               | 5.868       |                                  | 0                                  | (778)                           | (778)                   | (0,02)  |        |
| 08.2025    |                       | \$          | 8.276      | CNH           | 59.672      |                                  | 86                                 | 0                               | 86                      | 0,00    |        |
| 08.2025    |                       |             | 56.759     | CNY           | 406.128     |                                  | 120                                | 0                               | 120                     | 0,00    |        |
| 08.2025    |                       |             | 0          | EGP           | 0           |                                  | 0                                  | 0                               | 0                       | 0,00    |        |
| 08.2025    |                       |             | 93.545     | INR           | 8.063.083   |                                  | 312                                | (63)                            | 249                     | 0,01    |        |
| 08.2025    |                       |             | 2.545      | KES           | 350.745     |                                  | 159                                | 0                               | 159                     | 0,00    |        |
| 09.2025    |                       | COP         | 50.498.028 | \$            | 12.253      |                                  | 21                                 | 0                               | 21                      | 0,00    |        |
| 09.2025    |                       | PEN         | 60.701     |               | 16.484      |                                  | 0                                  | (587)                           | (587)                   | (0,01)  |        |
| 09.2025    |                       | \$          | 67.828     | BRL           | 392.973     |                                  | 3.091                              | 0                               | 3.091                   | 0,07    |        |
| 09.2025    |                       |             | 5.103      | COP           | 21.264.201  |                                  | 55                                 | 0                               | 55                      | 0,00    |        |
| 09.2025    |                       |             | 20.508     | PEN           | 73.289      |                                  | 94                                 | 0                               | 94                      | 0,00    |        |
| 10.2025    |                       | PEN         | 25.260     | \$            | 6.915       |                                  | 0                                  | (183)                           | (183)                   | 0,00    |        |
| 10.2025    |                       | \$          | 3.831      | COP           | 18.664.632  |                                  | 677                                | 0                               | 677                     | 0,02    |        |
| 11.2025    |                       | PEN         | 4.375      | \$            | 1.191       |                                  | 0                                  | (38)                            | (38)                    | 0,00    |        |
| 12.2025    |                       | CNH         | 1.033.998  |               | 143.135     |                                  | 0                                  | (3.012)                         | (3.012)                 | (0,07)  |        |
| 12.2025    |                       | PEN         | 17.278     |               | 4.667       |                                  | 0                                  | (181)                           | (181)                   | 0,00    |        |
| 02.2026    |                       | GHS         | 12.268     |               | 858         |                                  | 0                                  | (183)                           | (183)                   | 0,00    |        |
| DUB        | 06.2026               | ARS         | 3.200.637  |               | 2.106       |                                  | 0                                  | 0                               | 0                       | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | CNY         | 150.038    |               | 20.936      |                                  | 0                                  | (48)                            | (48)                    | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | IDR         | 93.554.789 |               | 5.668       |                                  | 0                                  | (94)                            | (94)                    | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | THB         | 1.447.430  |               | 44.103      |                                  | 0                                  | (421)                           | (421)                   | (0,01)  |        |
|            | 07.2025               | UGX         | 9.803.900  |               | 2.686       |                                  | 0                                  | (40)                            | (40)                    | 0,00    |        |
|            | 07.2025               | \$          | 11.459     | CNY           | 81.758      |                                  | 1                                  | (24)                            | (23)                    | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 45.931     | €             | 39.592      |                                  | 544                                | 0                               | 544                     | 0,01    |        |
|            | 07.2025               |             | 5.661      | IDR           | 92.127.114  |                                  | 13                                 | 0                               | 13                      | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 789        | ILS           | 2.734       |                                  | 23                                 | 0                               | 23                      | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 4.298      | KES           | 586.742     |                                  | 239                                | 0                               | 239                     | 0,01    |        |
|            | 07.2025               |             | 5.236      | KZT           | 2.743.534   |                                  | 8                                  | 0                               | 8                       | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 9.983      | MYR           | 42.376      |                                  | 90                                 | 0                               | 90                      | 0,00    |        |
|            | 07.2025               |             | 44.165     | THB           | 1.447.430   |                                  | 450                                | 0                               | 450                     | 0,01    |        |
|            | 07.2025               |             | 415        | TWD           | 12.346      |                                  | 10                                 | 0                               | 10                      | 0,00    |        |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| FAR        | 08.2025               | CNH                    | \$                       | 73.440                           | \$ 0                               | \$ (1.104)                                           | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | CZK                    |                          | 1.868                            | 0                                  | (81)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | €                      |                          | 45.931                           | 0                                  | (544)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | KES                    |                          | 2.436                            | 0                                  | (269)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | CNH                      | 277.921                          | 238                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | INR                      | 3.869.179                        | 183                                | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | TWD                      | 77.917                           | 70                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | KZT                      | 106.233                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | MXN                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | PEN                      | 27.405                           | 255                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 09.2025               |                        | RSD                      | 133.773                          | 22                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | \$                       | 3.811                            | 0                                  | (396)                                                | (0,01)                  |
|            | 11.2025               | PKR                    |                          | 1.190                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025               | INR                    |                          | 44.092                           | 0                                  | (705)                                                | (0,02)                  |
|            | 12.2025               | UGX                    |                          | 2.568                            | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025               | \$                     | KZT                      | 110.409                          | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CHF                    | \$                       | 1.041                            | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      |                          | 19                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      |                          | 8.327                            | 0                                  | (64)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    |                          | 13.682                           | 0                                  | (485)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | AUD                      | 1.636                            | 17                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | BRL                      | 193.236                          | 1.528                              | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | CHF                      | 834                              | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | CNH                      | 11.351                           | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | ¥                        | 4.816.025                        | 0                                  | (229)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               |                        | MYR                      | 14.604                           | 32                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | PEN                      | 30.304                           | 59                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | PLN                      | 46.388                           | 253                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | CHF                      | 830                              | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | CNH                      | 280.017                          | 108                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | INR                      | 1.853.102                        | 129                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | ¥                        | 1.207.633                        | 64                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | \$                       | 72.432                           | 0                                  | (1.620)                                              | (0,04)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | PEN                      | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | \$                       | 9.296                            | 0                                  | (319)                                                | (0,01)                  |
|            | 12.2025               |                        |                          | 8.479                            | 0                                  | (61)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | BRL                    |                          | 291.590                          | 0                                  | (3.046)                                              | (0,07)                  |
|            | 07.2025               | DOP                    |                          | 6.617                            | 83                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | RON                    |                          | 1.995                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    |                          | 119.602                          | 21                                 | (376)                                                | (0,01)                  |
| GLM        | 07.2025               | TWD                    |                          | 522                              | 0                                  | (63)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | CNY                      | 37.869                           | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | €                        | 94                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | IDR                      | 193.206.067                      | 42                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | MYR                      | 229                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | RON                      | 17.708                           | 23                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | THB                      | 3.577.994                        | 417                                | (2)                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | TRY                      | 51.564                           | 40                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | TWD                      | 535                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | \$                       | 283                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    |                          | 38.646                           | 231                                | (1.234)                                              | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | HUF                    |                          | 11.355                           | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | CNY                      | 563                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | HUF                      | 14.779.081                       | 2.353                              | 0                                                    | 0,06                    |
|            | 09.2025               | AED                    | \$                       | 1.244                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | DOP                    |                          | 54.513                           | 768                                | (997)                                                | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | PHP                    |                          | 82.054                           | 101                                | (2.824)                                              | (0,06)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | MXN                      | 159.711                          | 84                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | \$                       | 5.745                            | 0                                  | (555)                                                | (0,01)                  |
|            | 10.2025               | \$                     | BRL                      | 1.546.137                        | 2.630                              | 0                                                    | 0,06                    |
|            | 11.2025               | DOP                    | \$                       | 655                              | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               | TRY                    |                          | 4.847                            | 0                                  | (98)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2026               | ARS                    |                          | 1.061                            | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 14.769                           | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SEK                    | \$                       | 1.561                            | 12                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PHP                    |                          | 15.911                           | 158                                | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | BRL                    |                          | 15.673                           | 0                                  | (1.408)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | KRW                    |                          | 123                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    |                          | 1.844                            | 0                                  | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    |                          | 45.014                           | 0                                  | (1.760)                                              | (0,04)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    |                          | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    |                          | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    |                          | 4.325                            | 0                                  | (389)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | BRL                      | 1.377.203                        | 11.680                             | 0                                                    | 0,27                    |
|            | 07.2025               |                        | CNH                      | 68.704                           | 36                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | CNY                      | 76.556                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | PHP                      | 1.676.650                        | 0                                  | (304)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               |                        | PLN                      | 83.664                           | 507                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | SGD                      | 66                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | THB                      | 748.256                          | 28                                 | (24)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | TRY                      | 290.313                          | 119                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | TWD                      | 333                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MBC        | 07.2025               | ZAR                    | 177.744                  | \$ 9.946                         | \$ 0                               | \$ (40)                                              | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.766                    | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 99.472                   | 3.053                            | 0                                  | (405)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 4.290                    | BRL 24.497                       | 164                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 59.135                   | CNH 423.078                      | 151                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 17.039                   | INR 1.475.181                    | 125                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 5                        | SGD 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 40                       | TWD 1.305                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 150.491.711              | \$ 35.629                        | 0                                  | (823)                                                | (0,02)                  |
|            | 09.2025               | THB                    | 530                      | 16                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 145.635                  | 2.545                            | 0                                  | (275)                                                | (0,01)                  |
|            | 10.2025               | \$                     | 940                      | BRL 5.300                        | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | GHS                    | 12.933                   | \$ 914                           | 0                                  | (240)                                                | (0,01)                  |
|            | 11.2025               | PKR                    | 695.896                  | 2.351                            | 0                                  | (48)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2026               | EGP                    | 235.372                  | 3.815                            | 0                                  | (259)                                                | (0,01)                  |
|            | 03.2030               | IDR                    | 252.540.875              | 12.118                           | 0                                  | (1.837)                                              | (0,04)                  |
|            | 03.2030               | \$                     | 11.598                   | IDR 246.110.438                  | 2.001                              | 0                                                    | 0,05                    |
|            | 07.2025               | CAD                    | 632                      | \$ 460                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 2.917.200                | 20.336                           | 140                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 120.865                  | 32.279                           | 0                                  | (1.161)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 166                      | 128                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 47.747                   | 1.465                            | 0                                  | (179)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 460                      | CAD 631                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.431                    | CNH 10.310                       | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 89.510                   | € 77.293                         | 1.220                              | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 07.2025               |                        | 78                       | HKD 610                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 24.616                   | IDR 399.250.588                  | 6                                  | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.470                    | ¥ 211.255                        | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 16.953                   | PHP 946.526                      | 0                                  | (179)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 310                      | PLN 1.156                        | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 124                      | SGD 160                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 654                      | THB 21.810                       | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 64.900                   | \$ 9.068                         | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | COP                    | 6.665.499                | 1.620                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 77.014                   | 2.379                            | 0                                  | (298)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 460                      | CAD 631                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 8.588                    | CNH 62.094                       | 114                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 612                      | EGP 33.728                       | 54                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 33.276                   | HUF 11.958.356                   | 1.750                              | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 08.2025               |                        | 128                      | SGD 165                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 10.2025               | EGP                    | 145.508                  | \$ 2.545                         | 0                                  | (273)                                                | (0,01)                  |
|            | 02.2026               | ILS                    | 46.536                   | 12.728                           | 0                                  | (1.150)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | ¥                      | 383.630                  | 2.630                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 14.700                   | 1.457                            | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 11.345                   | ¥ 1.637.711                      | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 734                      | MYR 3.106                        | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 66                       | PLN 242                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.295                    | THB 74.348                       | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 239                      | ZAR 4.318                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 123.449                  | \$ 6.828                         | 0                                  | (108)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 1.738.918                | 4.996                            | 0                                  | (97)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 1.523.294                | 10.592                           | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 39.866                   | CNH 285.411                      | 128                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 22.306                   | CNY 159.544                      | 41                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 7.711                    | CZK 166.989                      | 232                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 4.924                    | HUF 1.734.042                    | 155                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 2.630                    | ¥ 382.219                        | 25                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 1.457                    | NOK 14.697                       | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 50.600.698               | \$ 12.213                        | 7                                  | (58)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 235.848                  | 12.333                           | 0                                  | (50)                                                 | 0,00                    |
| RYL        | 09.2025               | \$                     | 5.551                    | MXN 106.720                      | 52                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 163.246                  | \$ 2.869                         | 0                                  | (272)                                                | (0,01)                  |
|            | 10.2025               | \$                     | 2.605                    | EGP 148.736                      | 269                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 12.2025               | CZK                    | 86.726                   | € 3.437                          | 0                                  | (61)                                                 | 0,00                    |
|            | 10.2026               | \$                     | 4.342                    | AZN 7.768                        | 24                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2027               |                        | 8.684                    | 15.979                           | 0                                  | (52)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 2.673                    | CNH 19.360                       | 40                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 3.966                    | CZK 85.578                       | 104                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 4.491                    | HUF 1.604.057                    | 207                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               | GHS                    | 42.699                   | \$ 3.248                         | 0                                  | (854)                                                | (0,02)                  |
| SCX        | 07.2025               | KES                    | 586.742                  | 3.998                            | 0                                  | (539)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | PEN                    | 41.712                   | 11.499                           | 0                                  | (253)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 33                       | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 111.659                  | 3.836                            | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 55.144                   | IDR 898.539.720                  | 195                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 12                       | ILS 42                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.005                    | ¥ 289.628                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 21.028                   | MYR 89.186                       | 167                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 45.456                   | PEN 163.943                      | 732                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 91.768                   | THB 2.989.841                    | 202                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 13.696                   | TWD 407.244                      | 324                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 340.325                  | \$ 47.086                        | 0                                  | (604)                                                | (0,01)                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| SOG                              | 08.2025               | INR                    | 603.781                  | \$ 7.040                         | \$ 16                              | \$ 16                                                | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | ¥                      | 288.561                  | 2.005                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | TWD                    | 26.712                   | 819                              | 0                                  | (110)                                                | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 93.256                   | CNH 668.373                      | 403                                | 0                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 33.960                   | INR 2.934.081                    | 191                                | (20)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 26                       | SGD 33                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 20.080                   | TWD 613.596                      | 1.248                              | 0                                                    | 0,03                    |
|                                  | 09.2025               | PHP                    | 6.011.672                | \$ 107.779                       | 1.376                              | 0                                                    | 0,03                    |
|                                  | 10.2025               | \$                     | 3.490                    | NGN 6.127.103                    | 353                                | 0                                                    | 0,01                    |
|                                  | 12.2025               | UGX                    | 11.362.397               | \$ 3.038                         | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 03.2030               | IDR                    | 239.680.000              | 10.700                           | 0                                  | (2.544)                                              | (0,06)                  |
|                                  | 07.2025               | GHS                    | 28.202                   | 2.089                            | 0                                  | (618)                                                | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025               | ¥                      | 672.732                  | 4.660                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | NOK                    | 1.530                    | 152                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 2.785                    | BRL 15.446                       | 45                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 863                      | € 749                            | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 20.278                   | RON 88.967                       | 257                                | 0                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               | CZK                    | 12.959                   | \$ 599                           | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 1.753                    | HUF 635.589                      | 109                                | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 87                       | INR 7.481                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB                              | 08.2025               |                        | 4.660                    | ¥ 670.264                        | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 152                      | NOK 1.530                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | £                      | 4.687                    | \$ 6.347                         | 0                                  | (76)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | PEN                    | 15.014                   | 4.075                            | 0                                  | (154)                                                | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 3.055                    | BRL 16.831                       | 29                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 7.734                    | € 6.669                          | 95                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 6                        | £ 4                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 2.130                    | BRL 11.825                       | 20                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 12.391                   | INR 1.071.696                    | 76                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 11.2025               | PEN                    | 29.265                   | \$ 7.933                         | 0                                  | (286)                                                | (0,01)                  |
| UAG                              | 07.2025               | CLP                    | 37.640.264               | 40.090                           | 0                                  | (236)                                                | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 27.531                   | CLP 25.760.160                   | 67                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 115                      | ILS 414                          | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 490                      | ¥ 70.986                         | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 1.445                    | NOK 14.676                       | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 15.359                   | RON 67.482                       | 217                                | 0                                                    | 0,01                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 248                      | THB 8.135                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 19.497                   | CNH 139.526                      | 55                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 1.720                    | TRY 76.485                       | 128                                | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | COP                    | 45.923.625               | \$ 11.133                        | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | MXN                    | 583.387                  | 30.446                           | 15                                 | (200)                                                | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | \$                     | 5.578                    | COP 23.171.012                   | 47                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 11.2025               |                        | 704                      | TRY 33.170                       | 39                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 12.2025               | €                      | 3.437                    | CZK 86.722                       | 61                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 12.2025               | \$                     | 3.924                    | MXN 75.966                       | 24                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 01.2026               |                        | 8.209                    | TRY 391.336                      | 170                                | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 61.266                        | \$ (56.476)                        | \$ 4.790                                             | 0,11                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 13.968                                            | 0,33                    |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 4.404.798                                         | 103,36                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (143.069)                                         | (3,36)                  |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 4.261.729                                         | 100,00                  |

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

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,28 %):

| Emittentenbeschreibung                       | Kauf-<br>datum | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------|----------------|----------|----------------|-------------------------|
| DrillCo Holding Lux S.A.                     | 08.06.2023     | \$ 158   | \$ 161         | 0,01                    |
| Florish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022 | 25.08.2021     | 2.759    | 99             | 0,00                    |
|                                              |                | \$ 2.917 | \$ 260         | 0,01                    |

- (i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 207.476 USD (31. Dezember 2024: 250.262 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 1.485 USD) als Sicherheiten verpfändet.



Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 249 USD) und Barmittel in Höhe von 2.044 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 43.463 USD (31. Dezember 2024: 47.300 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 12.010 USD (31. Dezember 2024: 38.720 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 3.863.379                                                    | \$ 210.008                                                   | \$ 4.073.387        |
| Investmentfonds               | 342.728                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 342.728             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | (11.317)                                                        | 0                                                            | (11.317)            |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 342.728</b>                                                           | <b>\$ 3.852.062</b>                                             | <b>\$ 210.008</b>                                            | <b>\$ 4.404.798</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 2.718.209                                                    | \$ 156.561                                                   | \$ 2.874.770        |
| Investmentfonds               | 221.131                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 221.131             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (766)                                                                       | (40.235)                                                        | 782                                                          | (40.219)            |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 220.365</b>                                                           | <b>\$ 2.677.974</b>                                             | <b>\$ 157.343</b>                                            | <b>\$ 3.055.682</b> |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS                                       | 5,450 %         | 16.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | PLN (191.784)     | \$ (53.189)                                                     | (1,25)                  |
|                                           | 5,450           | 17.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (138.166)         | (38.313)                                                        | (0,90)                  |
|                                           | 6,360           | 25.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | HUF (20.798.288)  | (61.145)                                                        | (1,44)                  |
| BRC                                       | 4,550           | 08.01.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (4.038)        | (4.127)                                                         | (0,10)                  |
|                                           | 6,400           | 24.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | HUF (932.910)     | (2.743)                                                         | (0,06)                  |
|                                           | 6,500           | 07.11.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (373.434)         | (1.139)                                                         | (0,03)                  |
| DBL                                       | 4,650           | 28.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (29.756)       | (30.119)                                                        | (0,71)                  |
| JML                                       | 3,500           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | CZK (250.620)     | (11.925)                                                        | (0,28)                  |
| MBC                                       | 5,450           | 17.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | PLN (98.690)      | (27.367)                                                        | (0,64)                  |
|                                           | 6,430           | 24.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | HUF (500.482)     | (1.472)                                                         | (0,03)                  |
| MEI                                       | 4,300           | 26.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (955)          | (966)                                                           | (0,02)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                   | <b>\$ (232.505)</b>                                             | <b>(5,46)</b>           |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 246                              | \$ (320)                              | \$ (74)                             | \$ 580                              | \$ (280)                              | \$ 300                              |
| BOA        | (2.426)                             | 2.040                                 | (386)                               | (1.860)                             | 1.810                                 | (50)                                |
| BPS        | 4.199                               | (3.950)                               | 249                                 | (8.183)                             | 7.340                                 | (843)                               |
| BRC        | 5.841                               | (4.790)                               | 1.051                               | 3.398                               | (3.100)                               | 298                                 |
| BSH        | (1.385)                             | 1.210                                 | (175)                               | 91                                  | 0                                     | 91                                  |
| CBK        | (1.842)                             | 2.760                                 | 918                                 | (3.216)                             | 3.680                                 | 464                                 |
| DUB        | (874)                               | 820                                   | (54)                                | (559)                               | (20)                                  | (579)                               |
| FAR        | (546)                               | 950                                   | 404                                 | (5.519)                             | 5.670                                 | 151                                 |
| GLM        | (1.569)                             | 2.020                                 | 451                                 | (7.724)                             | 9.390                                 | 1.666                               |
| GST        | 2.275                               | (2.030)                               | 245                                 | (734)                               | 920                                   | 186                                 |
| IND        | 159                                 | (320)                                 | (161)                               | 69                                  | 0                                     | 69                                  |
| JPM        | 8.080                               | (6.140)                               | 1.940                               | (1.881)                             | 1.660                                 | (221)                               |
| MBC        | 13                                  | 300                                   | 313                                 | 4.118                               | (3.380)                               | 738                                 |
| MYC        | (265)                               | 0                                     | (265)                               | 1.821                               | (1.770)                               | 51                                  |
| MYI        | 1.781                               | (1.300)                               | 481                                 | 827                                 | (310)                                 | 517                                 |
| RBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (5.017)                             | 3.640                                 | (1.377)                             |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| RVL        | \$ 351                              | \$ (290)                              | \$ 61                               | \$ (63)                             | \$ 0                                  | \$ (63)                             |
| SCX        | 1.814                               | (2.520)                               | (706)                               | (3.080)                             | 3.390                                 | 310                                 |
| SOG        | (206)                               | 0                                     | (206)                               | 5                                   | 0                                     | 5                                   |
| SSB        | (296)                               | 310                                   | 14                                  | 3.929                               | (3.430)                               | 499                                 |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 1.653                               | (1.290)                               | 363                                 |
| UAG        | (1.382)                             | 1.600                                 | 218                                 | (1.642)                             | 1.220                                 | (422)                               |

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

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 70,79             | 64,32             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 8,40              | 9,79              |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,23              | 0,00              |
| Investmentfonds                                                        | 6,68              | 5,70              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 2,06              | 2,73              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,52              | 1,75              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 10,32             | 15,71             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert        | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------|-------------------|-------------------|
| Aserbaidshan                 | 0,19              | 0,29              |
| Brasilien                    | 0,43              | 0,57              |
| Bulgarien                    | k. A.             | 0,43              |
| Kaimaninseln                 | 0,68              | 0,69              |
| Chile                        | 2,42              | 3,68              |
| China                        | 1,77              | 1,29              |
| Kolumbien                    | 6,13              | 2,30              |
| Tschechische Republik        | 3,96              | 5,32              |
| Dänemark                     | 0,00              | 0,00              |
| Dominikanische Republik      | 4,62              | 2,86              |
| Ecuador                      | 0,25              | 0,46              |
| Ägypten                      | 1,44              | k. A.             |
| Frankreich                   | 0,03              | k. A.             |
| Deutschland                  | 1,71              | 0,97              |
| Ghana                        | 0,33              | 0,28              |
| Ungarn                       | 1,58              | 0,58              |
| Indien                       | 0,13              | 0,57              |
| Indonesien                   | 5,36              | 6,68              |
| International                | 0,14              | 0,19              |
| Irland                       | 1,29              | 1,27              |
| Israel                       | 0,63              | k. A.             |
| Elfenbeinküste               | 0,70              | 1,29              |
| Jersey, Kanalinseln          | 0,01              | k. A.             |
| Kasachstan                   | 0,13              | 0,07              |
| Kenia                        | 0,09              | 0,14              |
| Libanon                      | k. A.             | 0,16              |
| Luxemburg                    | 0,15              | 0,01              |
| Malaysia                     | 6,84              | 6,06              |
| Mexiko                       | 11,82             | 9,37              |
| Mongolei                     | k. A.             | 0,27              |
| Niederlande                  | 0,18              | k. A.             |
| Nigeria                      | 0,19              | 0,25              |
| Oman                         | k. A.             | 0,22              |
| Paraguay                     | 0,44              | 0,31              |
| Peru                         | 5,30              | 6,81              |
| Philippinen                  | 4,18              | 4,93              |
| Polen                        | 7,61              | 6,00              |
| Katar                        | k. A.             | 0,60              |
| Rumänien                     | 2,12              | 1,60              |
| Serbien                      | 0,55              | 0,11              |
| Singapur                     | 0,09              | 0,44              |
| Südafrika                    | 9,33              | 8,95              |
| Supranational                | 1,04              | 3,07              |
| Tansania                     | 0,29              | 0,44              |
| Thailand                     | 1,83              | 3,98              |
| Türkei                       | 1,91              | 3,94              |
| Uganda                       | 0,31              | k. A.             |
| Ukraine                      | 0,12              | 0,38              |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,10              | 0,85              |
| Großbritannien               | 0,66              | 1,10              |
| USA                          | 2,73              | 6,06              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Uruguay                                                                                | k. A.             | 0,71              |
| Usbekistan                                                                             | 0,27              | 0,40              |
| Venezuela                                                                              | 0,09              | 0,11              |
| Sambia                                                                                 | 0,12              | 0,21              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 3,29              | 3,94              |
| Investmentfonds                                                                        | 8,04              | 7,78              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,00              | (0,05)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,59)            | (0,56)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,12              | 0,15              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,09)            | (0,29)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | 0,02              | 0,31              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,05              | (0,07)            |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | 0,03              | (0,01)            |
| Zinsswaps                                                                              | 0,06              | (0,01)            |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere                                                     | 0,03              | 0,00              |
| Volatilitätsswaps                                                                      | 0,01              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | 0,11              | (0,89)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (3,36)            | (7,57)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund

| BESCHREIBUNG                                   | MARKT-<br>PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                       |                          |                          |                          |       |
| <b>CHILE</b>                                   |                          |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                          |                          |                          |       |
| Bonos de la Tesorería de la República en Pesos |                          |                          |                          |       |
| 2,800 % fällig am 01.10.2033                   | CLP                      | 45.000                   | \$ 39                    | 0,03  |
| 4,700 % fällig am 01.09.2030                   |                          | 890.000                  | 923                      | 0,69  |
| 5,000 % fällig am 01.10.2028                   |                          | 230.000                  | 246                      | 0,19  |
| 5,000 % fällig am 01.03.2035                   |                          | 240.000                  | 246                      | 0,18  |
| 5,800 % fällig am 01.10.2034                   |                          | 260.000                  | 282                      | 0,21  |
| 6,000 % fällig am 01.04.2033                   |                          | 1.420.000                | 1.558                    | 1,17  |
| 6,200 % fällig am 01.10.2040                   |                          | 140.000                  | 160                      | 0,12  |
| 7,000 % fällig am 01.05.2034                   |                          | 20.000                   | 24                       | 0,02  |
| Summe Chile                                    |                          | 3.478                    | 2,61                     |       |

|                                        |     |            |       |      |
|----------------------------------------|-----|------------|-------|------|
| <b>KOLUMBIEN</b>                       |     |            |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |     |            |       |      |
| Colombia Government International Bond |     |            |       |      |
| 1,000 % fällig am 28.04.2028           | COP | 3.138.900  | 692   | 0,52 |
| 1,000 % fällig am 09.02.2033           |     | 426.700    | 109   | 0,08 |
| Colombian TES                          |     |            |       |      |
| 6,250 % fällig am 09.07.2036           |     | 1.110.000  | 176   | 0,13 |
| 7,000 % fällig am 26.03.2031           |     | 16.270.800 | 3.198 | 2,40 |
| 7,000 % fällig am 30.06.2032           |     | 710.700    | 134   | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 18.10.2034           |     | 1.651.000  | 295   | 0,22 |
| 11,000 % fällig am 22.08.2029          |     | 3.234.000  | 790   | 0,59 |
| 11,500 % fällig am 25.07.2046          |     | 2.425.200  | 537   | 0,40 |
| 12,750 % fällig am 28.11.2040          |     | 2.101.700  | 512   | 0,39 |
| 13,250 % fällig am 09.02.2033          |     | 6.889.800  | 1.766 | 1,33 |
| Summe Kolumbien                        |     | 8.209      | 6,16  |      |

|                                              |     |        |       |      |
|----------------------------------------------|-----|--------|-------|------|
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                 |     |        |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |     |        |       |      |
| Czech Republic Government International Bond |     |        |       |      |
| 0,050 % fällig am 29.11.2029                 | CZK | 55.400 | 2.245 | 1,68 |
| 0,950 % fällig am 15.05.2030                 |     | 12.000 | 500   | 0,38 |
| 1,200 % fällig am 13.03.2031                 |     | 1.200  | 50    | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 24.04.2040                 |     | 400    | 13    | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 23.06.2032                 |     | 11.000 | 454   | 0,34 |
| 1,950 % fällig am 30.07.2037                 |     | 200    | 7     | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 13.10.2033                 |     | 28.100 | 1.139 | 0,85 |
| 4,200 % fällig am 04.12.2036                 |     | 5.600  | 262   | 0,20 |
| 4,500 % fällig am 11.11.2032                 |     | 52.200 | 2.553 | 1,91 |
| 4,900 % fällig am 14.04.2034                 |     | 1.100  | 55    | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 30.09.2030                 |     | 22.900 | 1.149 | 0,86 |
| Summe Tschechische Republik                  |     | 8.427  | 6,32  |      |

|                                                  |     |         |       |      |
|--------------------------------------------------|-----|---------|-------|------|
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                   |     |         |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |     |         |       |      |
| Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik    |     |         |       |      |
| 13,000 % fällig am 05.12.2025                    | DOP | 19.100  | 319   | 0,24 |
| 13,000 % fällig am 30.01.2026                    |     | 5.300   | 88    | 0,07 |
| Dominican Republic Government International Bond |     |         |       |      |
| 10,500 % fällig am 15.03.2037                    |     | 259.500 | 4.415 | 3,31 |
| 10,750 % fällig am 01.06.2036                    |     | 68.100  | 1.177 | 0,88 |
| 11,250 % fällig am 15.09.2035                    |     | 13.500  | 240   | 0,18 |
| 13,625 % fällig am 03.02.2033                    |     | 29.500  | 580   | 0,43 |
| 13,625 % fällig am 10.02.2034                    |     | 9.200   | 186   | 0,14 |
| Summe Dominikanische Republik                    |     | 7.005   | 5,25  |      |

|                                       |    |     |      |      |
|---------------------------------------|----|-----|------|------|
| <b>ECUADOR</b>                        |    |     |      |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |    |     |      |      |
| Ecuador Government International Bond |    |     |      |      |
| 0,000 % fällig am 31.07.2030 (b)      | \$ | 35  | 26   | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 31.07.2035          |    | 52  | 38   | 0,03 |
| 6,900 % fällig am 31.07.2030          |    | 484 | 421  | 0,31 |
| Summe Ecuador                         |    | 485 | 0,36 |      |

|                                     |     |         |       |      |
|-------------------------------------|-----|---------|-------|------|
| <b>ÄGYPTEN</b>                      |     |         |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>             |     |         |       |      |
| Egypt Government International Bond |     |         |       |      |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028       | EGP | 113.100 | 2.252 | 1,69 |

| BESCHREIBUNG                            | MARKT-<br>PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-----------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>FRANKREICH</b>                       |                          |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                          |                          |                          |       |
| New Immo Holding S.A.                   |                          |                          |                          |       |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026            | €                        | 200                      | \$ 232                   | 0,17  |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                      |                          |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                          |                          |                          |       |
| Deutsche Bank AG                        |                          |                          |                          |       |
| 8,010 % fällig am 18.07.2034            | INR                      | 142.000                  | 1.717                    | 1,29  |
| Kreditanstalt für Wiederaufbau          |                          |                          |                          |       |
| 0,625 % fällig am 25.07.2025            | PLN                      | 500                      | 138                      | 0,10  |
| 5,800 % fällig am 19.01.2028            | ZAR                      | 2.500                    | 136                      | 0,10  |
| Summe Deutschland                       |                          | 1.991                    | 1,49                     |       |

|                                       |     |         |       |      |
|---------------------------------------|-----|---------|-------|------|
| <b>UNGARN</b>                         |     |         |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |     |         |       |      |
| Hungary Government International Bond |     |         |       |      |
| 3,000 % fällig am 21.08.2030          | HUF | 165.400 | 415   | 0,31 |
| 3,000 % fällig am 27.10.2038          |     | 14.500  | 28    | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 28.04.2051          |     | 205.700 | 378   | 0,28 |
| 4,500 % fällig am 27.05.2032          |     | 416.900 | 1.079 | 0,81 |
| 4,750 % fällig am 24.11.2032          |     | 229.200 | 598   | 0,45 |
| Summe Ungarn                          |     | 2.498   | 1,87  |      |

|                                     |     |       |     |      |
|-------------------------------------|-----|-------|-----|------|
| <b>INDIEN</b>                       |     |       |     |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>             |     |       |     |      |
| India Government International Bond |     |       |     |      |
| 7,300 % fällig am 19.06.2053        | INR | 9.130 | 110 | 0,08 |

|                                         |     |             |       |      |
|-----------------------------------------|-----|-------------|-------|------|
| <b>INDONESIEN</b>                       |     |             |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |     |             |       |      |
| Indonesia Government International Bond |     |             |       |      |
| 6,375 % fällig am 15.04.2042            | IDR | 7.704.000   | 446   | 0,33 |
| 6,750 % fällig am 15.07.2035            |     | 105.209.000 | 6.541 | 4,91 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2042            |     | 17.000      | 1     | 0,00 |
| 7,375 % fällig am 15.10.2030            |     | 4.148.000   | 265   | 0,20 |
| 7,500 % fällig am 15.05.2038            |     | 3.214.000   | 208   | 0,16 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2040            |     | 7.850.000   | 507   | 0,38 |
| 8,250 % fällig am 15.05.2036            |     | 7.846.000   | 539   | 0,40 |
| 8,375 % fällig am 15.04.2039            |     | 5.734.000   | 399   | 0,30 |
| Summe Indonesien                        |     | 8.906       | 6,68  |      |

|                                         |    |     |      |      |
|-----------------------------------------|----|-----|------|------|
| <b>IRLAND</b>                           |    |     |      |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |     |      |      |
| CIMA Finance DAC                        |    |     |      |      |
| 2,950 % fällig am 05.09.2029            | \$ | 142 | 131  | 0,10 |
| Iridium Capital PLC                     |    |     |      |      |
| 9,250 % fällig am 18.06.2029            | €  | 600 | 764  | 0,57 |
| Summe Irland                            |    | 895 | 0,67 |      |

|                                           |  |       |      |      |
|-------------------------------------------|--|-------|------|------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |  |       |      |      |
| Republic of Panama                        |  |       |      |      |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027              |  | 600   | 709  | 0,53 |
| Summe Irland                              |  | 1.604 | 1,20 |      |

|                                           |  |       |      |      |
|-------------------------------------------|--|-------|------|------|
| <b>ELFENBEINKÜSTE</b>                     |  |       |      |      |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |  |       |      |      |
| Republik Elfenbeinküste                   |  |       |      |      |
| 0,000 % fällig am 06.03.2026              |  | 600   | 702  | 0,52 |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |  |       |      |      |
| Ivory Coast Government International Bond |  |       |      |      |
| 4,875 % fällig am 30.01.2032              |  | 180   | 190  | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 22.03.2030              |  | 100   | 112  | 0,09 |
| Summe Elfenbeinküste                      |  | 302   | 0,23 |      |
| Summe Elfenbeinküste                      |  | 1.004 | 0,75 |      |

|                                    |     |         |     |      |
|------------------------------------|-----|---------|-----|------|
| <b>KASACHSTAN</b>                  |     |         |     |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |     |         |     |      |
| Development Bank of Kazakhstan JSC |     |         |     |      |
| 10,950 % fällig am 06.05.2026      | KZT | 100.000 | 185 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG                           | MARKT-<br>PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|----------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>MALAYSIA</b>                        |                          |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |                          |                          |                          |       |
| Malaysia Government International Bond |                          |                          |                          |       |
| 2,632 % fällig am 15.04.2031           | MYR                      | 1.340                    | \$ 307                   | 0,23  |
| 4,054 % fällig am 18.04.2039           |                          | 910                      | 225                      | 0,17  |
| 4,065 % fällig am 15.06.2050           |                          | 1.522                    | 366                      | 0,28  |
| 4,232 % fällig am 30.06.2031           |                          | 1.400                    | 348                      | 0,26  |
| 4,254 % fällig am 31.05.2035           |                          | 960                      | 242                      | 0,18  |
| 4,457 % fällig am 31.03.2053           |                          | 5.970                    | 1.529                    | 1,15  |
| 4,696 % fällig am 15.10.2042           |                          | 1.974                    | 523                      | 0,39  |
| 4,762 % fällig am 07.04.2037           |                          | 2.222                    | 584                      | 0,44  |
| 4,893 % fällig am 08.06.2038           |                          | 60                       | 16                       | 0,01  |
| Malaysia Government Investment Issue   |                          |                          |                          |       |
| 3,804 % fällig am 08.10.2031           |                          | 570                      | 139                      | 0,10  |
| 4,291 % fällig am 14.08.2043           |                          | 2.170                    | 548                      | 0,41  |
| 4,417 % fällig am 30.09.2041           |                          | 334                      | 86                       | 0,07  |
| 4,662 % fällig am 31.03.2038           |                          | 6.300                    | 1.645                    | 1,23  |
| 5,357 % fällig am 15.05.2052           |                          | 160                      | 46                       | 0,03  |
| Summe Malaysia                         |                          | 6.604                    | 4,95                     |       |

|                                      |     |        |       |      |
|--------------------------------------|-----|--------|-------|------|
| <b>MEXIKO</b>                        |     |        |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |     |        |       |      |
| Mexico Government International Bond |     |        |       |      |
| 4,000 % fällig am 24.08.2034 (d)     | MXN | 3.054  | 150   | 0,11 |
| 5,850 % fällig am 02.07.2032 (a)     | \$  | 200    | 203   | 0,15 |
| 6,625 % fällig am 29.01.2038 (a)     |     | 200    | 203   | 0,15 |
| 7,500 % fällig am 26.05.2033         | MXN | 8.000  | 388   | 0,29 |
| 7,750 % fällig am 29.05.2031         |     | 5.000  | 253   | 0,19 |
| 7,750 % fällig am 13.11.2042         |     | 30.700 | 1.350 | 1,01 |
| 8,000 % fällig am 24.05.2035         |     | 46.000 | 2.303 | 1,73 |
| 8,000 % fällig am 07.11.2047         |     | 26.200 | 1.157 | 0,87 |
| 8,000 % fällig am 31.07.2053         |     | 200    | 9     | 0,01 |
| 8,500 % fällig am 02.03.2028         |     | 40.000 | 2.125 | 1,59 |
| 8,500 % fällig am 01.03.2029         |     | 64.130 | 3.390 | 2,54 |
| 8,500 % fällig am 31.05.2029         |     | 29.200 | 1.543 | 1,16 |
| 8,500 % fällig am 28.02.2030         |     | 20.000 | 1.053 | 0,79 |
| 8,500 % fällig am 18.11.2038         |     | 6.200  | 302   | 0,23 |
| Summe Mexiko                         |     | 14.429 | 10,82 |      |

|                                        |     |           |      |      |
|----------------------------------------|-----|-----------|------|------|
| <b>PARAGUAY</b>                        |     |           |      |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |     |           |      |      |
| Paraguay Government International Bond |     |           |      |      |
| 7,900 % fällig am 09.02.2031           | PYG | 2.750.000 | 334  | 0,25 |
| 8,500 % fällig am 04.03.2035           |     | 2.315.000 | 283  | 0,21 |
| Summe Paraguay                         |     | 617       | 0,46 |      |

|                                              |     |       |      |      |
|----------------------------------------------|-----|-------|------|------|
| <b>PERU</b>                                  |     |       |      |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |     |       |      |      |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |     |       |      |      |
| 9,700 % fällig am 05.03.2045                 | PEN | 1.100 | 324  | 0,24 |
| 10,100 % fällig am 15.12.2043                |     | 2.700 | 808  | 0,61 |
| Summe Peru                                   |     | 1.132 | 0,85 |      |

|                                    |  |        |       |      |
|------------------------------------|--|--------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |  |        |       |      |
| Peru Government International Bond |  |        |       |      |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034       |  | 100    | 26    | 0,02 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032       |  | 4.800  | 1.399 | 1,05 |
| 6,850 % fällig am 12.08.2035       |  | 1.700  | 495   | 0,37 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031       |  | 3.041  | 932   | 0,70 |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033       |  | 13.950 | 4.290 | 3,22 |
| Summe Peru                         |  | 7.142  | 5,36  |      |
| Summe Peru                         |  | 8.274  | 6,21  |      |

|                    |  |  |
|--------------------|--|--|
| <b>PHILIPPINEN</b> |  |  |
|--------------------|--|--|

|                                      |     |        |       |      | % DES                                                |        |           |       |      |                              |    |     | % DES  |        |                                       |  |  |  |  |
|--------------------------------------|-----|--------|-------|------|------------------------------------------------------|--------|-----------|-------|------|------------------------------|----|-----|--------|--------|---------------------------------------|--|--|--|--|
|                                      |     |        |       |      | MARKT-                                               | NETTO- |           |       |      |                              |    |     | MARKT- | NETTO- |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | WERT                                                 | VERMÖ- |           |       |      |                              |    |     | WERT   | VERMÖ- |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | (000S)                                               | (000S) | GENS      |       |      |                              |    |     | (000S) | (000S) | GENS                                  |  |  |  |  |
| BESCHREIBUNG                         |     |        |       |      | BESCHREIBUNG                                         |        |           |       |      | BESCHREIBUNG                 |    |     |        |        | BESCHREIBUNG                          |  |  |  |  |
| POLEN                                |     |        |       |      | Asian Infrastructure Investment Bank                 |        |           |       |      | UKRAINE                      |    |     |        |        | UKRAINE                               |  |  |  |  |
| STAATSEMISSIONEN                     |     |        |       |      | 4,250 % fällig am 27.01.2027                         |        |           |       |      | STAATSEMISSIONEN             |    |     |        |        | Ukraine Government International Bond |  |  |  |  |
| Poland Government International Bond |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
| 1,250 % fällig am 25.10.2030         | PLN | 159    | \$ 36 | 0,03 | 7,000 % fällig am 01.03.2029                         | INR    | 36.500    | 431   | 0,32 | 0,000 % fällig am 01.02.2034 | \$ | 80  | \$ 31  | 0,02   |                                       |  |  |  |  |
| 1,750 % fällig am 25.04.2032         |     | 1.250  | 279   | 0,21 | 7,200 % fällig am 25.01.2029                         |        | 800       | 10    | 0,01 | 0,000 % fällig am 01.02.2035 |    | 67  | 32     | 0,03   |                                       |  |  |  |  |
| 2,750 % fällig am 25.10.2029 (f)     |     | 8.500  | 2.170 | 1,63 | 7,200 % fällig am 02.07.2031                         |        | 10.200    | 122   | 0,09 | 0,000 % fällig am 01.02.2036 |    | 56  | 26     | 0,02   |                                       |  |  |  |  |
| 4,750 % fällig am 25.07.2029 (f)     |     | 12.500 | 3.456 | 2,59 | Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung    |        |           |       |      | 0,000 % fällig am 01.08.2041 |    | 20  | 14     | 0,01   |                                       |  |  |  |  |
| 5,000 % fällig am 25.01.2030 (f)     |     | 7.900  | 2.199 | 1,65 | 3,010 % fällig am 13.03.2028                         | PLN    | 600       | 158   | 0,12 | 1,750 % fällig am 01.02.2029 |    | 62  | 39     | 0,03   |                                       |  |  |  |  |
| 5,750 % fällig am 25.04.2029 (f)     |     | 8.600  | 2.464 | 1,85 | 5,080 % fällig am 15.12.2025                         | MXN    | 1.900     | 99    | 0,07 | 1,750 % fällig am 01.02.2036 |    | 107 | 54     | 0,04   |                                       |  |  |  |  |
| 6,000 % fällig am 25.10.2033 (f)     |     | 5.200  | 1.499 | 1,12 | Europäische Investitionsbank                         |        |           |       |      | Summe Ukraine                |    | 196 | 0,15   |        |                                       |  |  |  |  |
| Summe Polen                          |     |        |       |      | 2,875 % fällig am 15.11.2029                         | PLN    | 10.823    | 2.746 | 2,06 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     | 12.103 | 9,08  |      | Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung |        |           |       |      | URUGUAY                      |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 0,000 % fällig am                                    |        |           |       |      | STAATSEMISSIONEN             |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 30.06.2027 (b)                                       | MXN    | 25.000    | 1.122 | 0,84 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 4,500 % fällig am 22.01.2026                         | ZAR    | 2.200     | 122   | 0,09 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 6,750 % fällig am 09.02.2029                         |        | 23.800    | 1.328 | 1,00 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 7,050 % fällig am 22.07.2029                         | INR    | 60.000    | 714   | 0,54 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 7,070 % fällig am 26.06.2029                         | MXN    | 1.400     | 73    | 0,05 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 8,250 % fällig am 21.12.2026                         | ZAR    | 36.000    | 2.046 | 1,53 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 8,500 % fällig am 06.04.2026                         | MXN    | 2.300     | 121   | 0,09 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 9,750 % fällig am 21.01.2027                         | BRL    | 750       | 132   | 0,10 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | International Finance Corp.                          |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 10,000 % fällig am 22.01.2030                        | COP    | 2.500.000 | 609   | 0,46 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | Summe Supranational                                  |        | 12.984    | 9,74  |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | THAILAND                                             |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | STAATSEMISSIONEN                                     |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | Thailand Government International Bond               |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 1,585 % fällig am 17.12.2035                         | THB    | 29.396    | 907   | 0,68 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 2,980 % fällig am 17.06.2045                         |        | 275       | 10    | 0,01 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 3,390 % fällig am 17.06.2037                         |        | 30.739    | 1.122 | 0,84 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 3,450 % fällig am 17.06.2043                         |        | 30.916    | 1.149 | 0,86 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 4,000 % fällig am 17.06.2055                         |        | 10.020    | 425   | 0,32 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | Summe Thailand                                       |        | 3.613     | 2,71  |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | TÜRKEI                                               |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | Türkiye İs Bankası A/Ş                               |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 7,750 % fällig am 12.06.2029                         | \$     | 300       | 308   | 0,23 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | STAATSEMISSIONEN                                     |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | Turkey Government International Bond                 |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 27,700 % fällig am 27.09.2034                        | TRY    | 21.200    | 511   | 0,38 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 49,053 % fällig am 20.05.2026                        |        | 1.400     | 35    | 0,03 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 49,053 % fällig am 19.08.2026                        |        | 1.300     | 33    | 0,03 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      | 49,053 % fällig am 17.05.2028                        |        | 55.900    | 1.363 | 1,02 |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |
|                                      |     |        |       |      |                                                      |        |           |       |      |                              |    |     |        |        |                                       |  |  |  |  |

| PENSIONSGESCHÄFTE       |                 |                       |                       |                    |                                                  | Zu erhaltende Erlöse       |                                     |                                                       |                              |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|--------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------------------|------------------------------|
| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                  | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Erlöse<br>aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
| BPS                     | 4,470 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 6.700           | U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 30.06.2029 | \$ (6.844)                 | \$ 6.700                            | \$ 6.701                                              | 5,02                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                                  | \$ (6.844)                 | \$ 6.700                            | \$ 6.701                                              | 5,02                         |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

| FUTURES                                                        |       |                  |                         |                                                 |                              |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025          | 15                      | \$ 29                                           | 0,02                         |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025          | 4                       | (11)                                            | (0,01)                       |
|                                                                |       |                  |                         | \$ 18                                           | 0,01                         |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | \$ 18                                           | 0,01                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

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

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

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

| Referenzeinheit   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Barclays Bank PLC | 1,000 %                        | 20.12.2025            | € 100                          | \$ 0                                            | 0,00                    |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 5,699 %           | 18.06.2030            | INR 51.700      | \$ 0                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000             | 17.09.2030            | 53.210          | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000             | 17.09.2035            | 8.260           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,025             | 18.12.2034            | 49.240          | (15)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 1,992             | 18.06.2030            | SGD 700         | 8                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750             | 19.03.2030            | 100             | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,322             | 20.12.2028            | 1.050           | (31)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day THB-THOR Compounded-OIS     | 2,000             | 17.09.2030            | THB 130.470     | 15                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250             | 18.06.2030            | \$ 9.000        | 45                                              | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250             | 19.03.2034            | 400             | 16                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250             | 18.06.2034            | 200             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250             | 19.03.2035            | 200             | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250             | 19.03.2055            | 1.600           | 24                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250             | 18.06.2055            | 2.075           | 14                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250             | 18.06.2055            | 3.500           | (89)                                            | (0,07)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500             | 20.12.2033            | 25              | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500             | 20.06.2054            | 2.600           | 27                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500             | 18.12.2054            | 2.900           | (145)                                           | (0,11)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500             | 17.09.2055            | 2.800           | 21                                              | 0,02                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750             | 17.09.2030            | 3.220           | 49                                              | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750             | 20.06.2031            | 1.400           | 40                                              | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750             | 20.06.2034            | 3.390           | (153)                                           | (0,11)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750             | 18.12.2034            | 1.600           | (64)                                            | (0,05)                  |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750             | 17.09.2035            | 1.600           | 22                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,086             | 13.01.2055            | 800             | (24)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,795             | 04.01.2027            | BRL 8.500       | (112)                                           | (0,08)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,808             | 02.01.2026            | 18.000          | (160)                                           | (0,11)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,815             | 04.01.2027            | 5.800           | (74)                                            | (0,06)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,832             | 04.01.2027            | 5.200           | (66)                                            | (0,05)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,840             | 04.01.2027            | 6.600           | (85)                                            | (0,06)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,842             | 04.01.2027            | 12.100          | (153)                                           | (0,11)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,076            | 04.01.2027            | 1.100           | (15)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,083            | 02.01.2026            | 110             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,225            | 04.01.2027            | 4.100           | (45)                                            | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,235            | 04.01.2027            | 4.100           | (45)                                            | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,386            | 02.01.2029            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,512            | 04.01.2027            | 60.300          | (740)                                           | (0,55)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,529            | 02.01.2026            | 300             | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,565            | 04.01.2027            | 1.400           | (13)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,602            | 04.01.2027            | 900             | (10)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,671            | 04.01.2027            | 13.400          | 124                                             | 0,09                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,691            | 02.01.2026            | 1.100           | (7)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,751            | 02.01.2026            | 5.800           | (48)                                            | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,768            | 04.01.2027            | 200             | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,872            | 04.01.2027            | 500             | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,880            | 04.01.2027            | 18.700          | 157                                             | 0,12                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,943            | 04.01.2027            | 11.500          | 94                                              | 0,07                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,980            | 04.01.2027            | 9.400           | (75)                                            | (0,06)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,985            | 02.01.2029            | 5.600           | (20)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,064            | 04.01.2027            | 400             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,133            | 04.01.2027            | 10.200          | 76                                              | 0,06                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,169            | 04.01.2027            | 520             | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,510            | 04.01.2027            | 6.800           | 42                                              | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,513            | 04.01.2027            | 7.000           | 45                                              | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,560            | 04.01.2027            | 5.700           | 35                                              | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,575            | 03.01.2028            | 3.600           | 22                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,590            | 03.01.2028            | 3.600           | 21                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,600            | 04.01.2027            | 12.000          | 70                                              | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,603            | 04.01.2027            | 8.400           | 49                                              | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,695            | 03.01.2028            | 29.200          | (159)                                           | (0,12)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,736            | 04.01.2027            | 7.000           | 42                                              | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,928            | 02.01.2029            | 4.800           | (21)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,940            | 03.01.2033            | 14.300          | (17)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 12,243            | 02.01.2029            | 5.400           | 18                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 12,255            | 02.01.2029            | 2.700           | 9                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 12,320            | 02.01.2029            | 10.100          | (30)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 12,760            | 02.01.2029            | 15.100          | 14                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 13,270            | 02.01.2029            | 10.300          | (11)                                            | (0,01)                  |



| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex        | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|---------------------------------------------|--------------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,291 %          | 02.01.2029            | BRL             | 13.700                                          | \$ 21                   | 0,02   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,320            | 02.01.2029            |                 | 1.500                                           | 3                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,405            | 02.01.2029            |                 | 12.600                                          | 19                      | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,425            | 02.01.2029            |                 | 3.900                                           | 6                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,430            | 02.01.2029            |                 | 7.500                                           | 12                      | 0,01   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,500            | 02.01.2029            |                 | 9.700                                           | 17                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,518            | 02.01.2029            |                 | 6.600                                           | (12)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,545            | 02.01.2029            |                 | 6.500                                           | (13)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,589            | 02.01.2029            |                 | 13.000                                          | (29)                    | (0,02) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,680            | 02.01.2029            |                 | 10.600                                          | 27                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,844            | 02.01.2029            |                 | 7.100                                           | (22)                    | (0,02) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,923            | 02.01.2029            |                 | 5.200                                           | (18)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,927            | 04.01.2027            |                 | 45.500                                          | (24)                    | (0,02) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,998            | 02.01.2029            |                 | 20.000                                          | 75                      | 0,06   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,020            | 04.01.2027            |                 | 15.100                                          | 3                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,026            | 02.01.2029            |                 | 3.700                                           | (14)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,087            | 02.01.2029            |                 | 3.200                                           | (14)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,185            | 02.01.2029            |                 | 10.500                                          | 47                      | 0,04   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,213            | 02.01.2029            |                 | 5.600                                           | 26                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,245            | 02.01.2029            |                 | 8.600                                           | (40)                    | (0,03) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,350            | 04.01.2027            |                 | 38.400                                          | (21)                    | (0,02) |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,524            | 02.01.2029            |                 | 9.900                                           | (58)                    | (0,04) |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,570            | 02.01.2029            |                 | 4.600                                           | 27                      | 0,02   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,995            | 04.01.2027            |                 | 10.500                                          | 23                      | 0,02   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 15,036            | 02.01.2029            |                 | 6.600                                           | 54                      | 0,04   |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 15,065            | 02.01.2029            |                 | 3.300                                           | 28                      | 0,02   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,110             | 02.10.2029            | COP             | 4.238.000                                       | (59)                    | (0,04) |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,410             | 09.08.2028            |                 | 1.732.300                                       | 13                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,410             | 30.09.2031            |                 | 2.986.800                                       | 13                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,520             | 13.08.2031            |                 | 1.135.300                                       | 17                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,540             | 09.08.2031            |                 | 1.700.000                                       | 26                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,580             | 09.08.2031            |                 | 1.677.900                                       | 25                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,650             | 12.08.2031            |                 | 996.000                                         | 14                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,705             | 26.03.2031            |                 | 906.800                                         | 9                       | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,715             | 18.09.2030            |                 | 83.500                                          | 1                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,770             | 18.07.2029            |                 | 6.466.900                                       | (46)                    | (0,03) |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,800             | 30.06.2032            |                 | 44.500                                          | 1                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,805             | 22.10.2029            |                 | 6.144.100                                       | (18)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,900             | 28.04.2028            |                 | 1.343.700                                       | 5                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,950             | 18.06.2028            |                 | 6.185.800                                       | (19)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,970             | 28.04.2028            |                 | 2.273.520                                       | 7                       | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,990             | 25.11.2034            |                 | 754.400                                         | 12                      | 0,01   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,150             | 19.03.2027            |                 | 2.249.980                                       | (2)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,150             | 28.04.2028            |                 | 1.913.000                                       | 4                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,152             | 25.04.2029            |                 | 1.674.070                                       | (6)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,200             | 18.06.2030            |                 | 4.030.100                                       | 19                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,215             | 14.11.2028            |                 | 1.082.000                                       | 10                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,250             | 18.06.2030            |                 | 1.473.000                                       | 6                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,350             | 18.06.2030            |                 | 2.837.200                                       | 7                       | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,430             | 15.05.2030            |                 | 1.034.800                                       | 2                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,498             | 16.05.2030            |                 | 3.436.000                                       | 6                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,600             | 11.04.2026            |                 | 3.008.830                                       | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,710             | 17.09.2030            |                 | 4.562.000                                       | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,725             | 10.06.2030            |                 | 509.000                                         | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,755             | 17.09.2030            |                 | 839.600                                         | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,770             | 10.06.2030            |                 | 1.528.000                                       | 1                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,790             | 10.06.2030            |                 | 1.019.000                                       | 1                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,800             | 18.06.2030            |                 | 3.461.000                                       | (4)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,300             | 26.03.2031            |                 | 122.840                                         | (1)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,410             | 26.03.2031            |                 | 123.400                                         | (1)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,500             | 19.10.2033            |                 | 220.600                                         | 1                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,525             | 18.06.2035            |                 | 1.238.000                                       | (5)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,930             | 07.03.2033            |                 | 34.420                                          | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,368             | 18.06.2030            | KRW             | 576.400                                         | (3)                     | 0,00   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,500             | 17.09.2027            |                 | 4.067.400                                       | 11                      | 0,01   |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,500             | 17.09.2030            |                 | 114.300                                         | (1)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month KRW-KORIBOR            | 3,820             | 20.12.2028            |                 | 425.250                                         | (1)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,021             | 07.10.2029            | SEK             | 27.400                                          | (17)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,298             | 07.10.2029            |                 | 27.200                                          | 57                      | 0,04   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,370             | 26.08.2030            | ZAR             | 7.300                                           | 0                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,560             | 23.08.2029            |                 | 19.000                                          | (25)                    | (0,02) |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,560             | 22.09.2030            |                 | 7.120                                           | 3                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,570             | 27.05.2030            |                 | 5.500                                           | 3                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,650             | 20.06.2030            |                 | 14.367                                          | (7)                     | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,685             | 31.01.2030            |                 | 21.900                                          | 22                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,700             | 18.06.2030            |                 | 28.840                                          | (17)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,730             | 12.03.2030            |                 | 11.200                                          | 13                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,775             | 18.03.2030            |                 | 13.000                                          | (15)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,790             | 31.01.2030            |                 | 10.300                                          | 13                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,810             | 27.03.2030            |                 | 10.400                                          | (11)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,810             | 20.06.2030            |                 | 5.590                                           | 6                       | 0,00   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 7,860 %           | 22.11.2025            | ZAR 600         | \$ 0                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 7,860             | 18.06.2030            | 13.000          | 17                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,020             | 28.02.2031            | 12.600          | 18                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,100             | 05.06.2026            | 1.000           | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,130             | 25.01.2029            | 10.200          | 25                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,140             | 16.11.2028            | 1.000           | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,160             | 31.03.2032            | 6.000           | 8                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,175             | 31.03.2032            | 13.600          | 19                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,210             | 21.12.2026            | 700             | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,355             | 31.01.2030            | 5.500           | (7)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,410             | 10.11.2028            | 700             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,440             | 02.11.2028            | 6.300           | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,599             | 05.06.2029            | 13.200          | (38)                                            | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,735             | 31.01.2030            | 13.800          | 23                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,820             | 31.01.2030            | 64.370          | (122)                                           | (0,09)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 10,150            | 18.05.2033            | 300             | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,540             | 01.10.2028            | CLP 243.100     | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,690             | 18.06.2030            | 400.200         | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,715             | 18.06.2030            | 419.200         | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,750             | 10.04.2030            | 1.042.700       | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,775             | 23.02.2026            | 2.136.100       | (9)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,855             | 18.12.2033            | 202.400         | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,890             | 01.10.2034            | 427.400         | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,960             | 19.03.2027            | 554.100         | (5)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,970             | 18.06.2032            | 295.500         | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,000             | 19.07.2029            | 1.159.200       | 20                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,030             | 20.03.2033            | 5.340           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,030             | 23.02.2034            | 504.300         | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,050             | 19.07.2029            | 304.800         | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,070             | 24.06.2031            | 268.600         | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,120             | 18.06.2035            | 158.100         | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,150             | 18.06.2030            | 522.400         | 12                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,165             | 01.08.2029            | 401.210         | (9)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,180             | 18.06.2030            | 394.400         | 10                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,200             | 13.06.2034            | 363.000         | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,230             | 17.11.2033            | 2.480.700       | (9)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,250             | 13.05.2033            | 295.900         | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,260             | 17.11.2028            | 8.100           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,280             | 28.02.2030            | 1.473.300       | (20)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,285             | 19.03.2030            | 220.200         | 7                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,310             | 16.11.2028            | 5.600           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,320             | 16.11.2028            | 736.100         | (9)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,360             | 28.06.2026            | 1.806.000       | 18                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,360             | 26.04.2034            | 83.200          | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,400             | 16.11.2033            | 13.100          | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,400             | 08.07.2034            | 224.000         | 7                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,440             | 28.02.2035            | 276.000         | 9                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,450             | 28.06.2034            | 441.000         | (16)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,500             | 13.11.2028            | 303.700         | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,500             | 19.03.2030            | 125.400         | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,560             | 01.04.2033            | 192.000         | 9                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,631             | 23.08.2028            | 15.700          | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,660             | 01.04.2033            | 250.000         | 13                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,690             | 01.09.2030            | 1.800           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,750             | 13.05.2034            | 302.900         | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,770             | 21.11.2027            | 28.300          | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,780             | 03.10.2028            | 14.200          | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,790             | 06.10.2033            | 15.000          | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,855             | 05.10.2033            | 33.000          | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,870             | 11.10.2033            | 14.200          | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,920             | 02.10.2028            | 18.000          | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,940             | 20.10.2033            | 6.100           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,990             | 20.10.2033            | 60.410          | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,000             | 02.10.2028            | 35.000          | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,070             | 28.02.2028            | 55.800          | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,146             | 30.10.2032            | 97.000          | (8)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,235             | 26.10.2033            | 25.300          | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,130             | 09.04.2030            | CZK 36.800      | 30                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,145             | 09.04.2030            | 13.900          | (9)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,258             | 05.05.2030            | 7.900           | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,290             | 30.04.2030            | 6.500           | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,315             | 06.05.2030            | 3.200           | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,325             | 06.05.2030            | 23.000          | 15                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,363             | 29.05.2030            | 24.600          | (14)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,365             | 28.11.2029            | 20.800          | 21                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,405             | 14.05.2030            | 27.100          | 13                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,480             | 15.07.2029            | 21.400          | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,485             | 16.05.2030            | 8.200           | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,530             | 15.07.2029            | 7.500           | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,550             | 24.01.2030            | 6.900           | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,554             | 11.06.2030            | 32.200          | 2                                               | 0,00                    |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|---------------------------------------------|-------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,580 %           | 25.10.2029            | CZK             | 23.000                                          | \$ 19                   | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,645             | 01.02.2029            |                 | 42.100                                          | 3                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,765             | 09.01.2029            |                 | 14.700                                          | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,250             | 18.04.2029            |                 | 15.300                                          | (1)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,388             | 15.11.2028            |                 | 43.500                                          | 39                      | 0,03   |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250             | 17.09.2055            | €               | 164                                             | 6                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 1,760             | 21.01.2030            | HUF             | 554.700                                         | 24                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 5,855             | 17.07.2029            |                 | 255.700                                         | (15)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,875             | 09.05.2030            |                 | 315.300                                         | (10)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,090             | 21.10.2029            |                 | 1.070.800                                       | 140                     | 0,10   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,210             | 26.06.2030            |                 | 1.028.200                                       | (12)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,250             | 09.04.2030            |                 | 141.100                                         | (3)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,265             | 28.04.2032            |                 | 133.400                                         | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,270             | 16.06.2030            |                 | 290.300                                         | 5                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,299             | 10.06.2029            |                 | 120.400                                         | (3)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,363             | 31.01.2030            |                 | 109.000                                         | 3                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,392             | 11.03.2030            |                 | 265.100                                         | 8                       | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,430             | 04.02.2030            |                 | 237.800                                         | 9                       | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,450             | 06.06.2029            |                 | 97.200                                          | (4)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,511             | 05.02.2030            |                 | 449.100                                         | 21                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,580             | 16.05.2035            |                 | 23.900                                          | 0                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,650             | 13.03.2030            |                 | 115.600                                         | 7                       | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 7,330             | 06.11.2028            |                 | 126.700                                         | 10                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 7,610             | 03.11.2028            |                 | 262.940                                         | (35)                    | (0,03) |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 7,840             | 07.02.2033            |                 | 174.700                                         | 11                      | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 10,570            | 22.08.2027            |                 | 4.800                                           | 2                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 3,962             | 06.05.2030            | PLN             | 6.000                                           | 21                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,015             | 17.04.2030            |                 | 1.400                                           | 4                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,019             | 18.04.2030            |                 | 1.300                                           | 4                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,048             | 18.04.2030            |                 | 700                                             | 2                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,049             | 18.04.2030            |                 | 1.000                                           | 3                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,065             | 18.04.2030            |                 | 600                                             | 1                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,313             | 25.07.2029            |                 | 1.500                                           | (5)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,360             | 25.07.2028            |                 | 2.900                                           | (10)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,388             | 09.08.2029            |                 | 3.000                                           | (19)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,415             | 12.08.2029            |                 | 2.700                                           | (18)                    | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,560             | 06.11.2028            |                 | 9.700                                           | (110)                   | (0,08) |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,560             | 02.09.2029            |                 | 2.500                                           | 25                      | 0,02   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,660             | 19.02.2029            |                 | 1.600                                           | 5                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,710             | 25.05.2027            |                 | 600                                             | (1)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,730             | 16.02.2029            |                 | 700                                             | 3                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,735             | 09.10.2028            |                 | 200                                             | (2)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,740             | 25.10.2033            |                 | 100                                             | (1)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,750             | 02.08.2029            |                 | 1.600                                           | 18                      | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,760             | 25.10.2033            |                 | 1.900                                           | 21                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,794             | 25.10.2029            |                 | 2.300                                           | (29)                    | (0,02) |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,810             | 16.02.2029            |                 | 800                                             | 4                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,850             | 25.10.2033            |                 | 1.500                                           | 19                      | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,855             | 10.02.2030            |                 | 5.000                                           | 26                      | 0,02   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,910             | 25.07.2027            |                 | 170                                             | (2)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,923             | 22.03.2029            |                 | 7.300                                           | 47                      | 0,03   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,930             | 25.07.2029            |                 | 1.200                                           | (11)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,970             | 21.03.2029            |                 | 2.500                                           | 15                      | 0,01   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,970             | 25.10.2033            |                 | 200                                             | 3                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,000             | 25.04.2029            |                 | 1.200                                           | (9)                     | (0,01) |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,010             | 25.07.2029            |                 | 1.100                                           | (12)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,020             | 21.03.2029            |                 | 700                                             | 5                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,055             | 25.10.2033            |                 | 1.800                                           | 33                      | 0,02   |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,155             | 25.10.2034            |                 | 900                                             | 18                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,295             | 25.01.2028            |                 | 15.750                                          | 9                       | 0,01   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 7,570             | 02.03.2028            | MXN             | 38.000                                          | (3)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,582             | 02.04.2030            |                 | 20.300                                          | (4)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,720             | 01.04.2030            |                 | 7.400                                           | 1                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,748             | 02.04.2030            |                 | 4.300                                           | 1                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,750             | 01.04.2030            |                 | 13.800                                          | 2                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,753             | 16.04.2030            |                 | 25.100                                          | 4                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,760             | 01.03.2029            |                 | 16.600                                          | 5                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,775             | 01.04.2030            |                 | 10.400                                          | 2                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 7,775             | 12.06.2030            |                 | 14.200                                          | (3)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,790             | 31.05.2029            |                 | 19.400                                          | 6                       | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,790             | 01.04.2030            |                 | 4.500                                           | 1                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 7,790             | 12.06.2030            |                 | 23.500                                          | (6)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 7,800             | 12.06.2030            |                 | 18.600                                          | (5)                     | 0,00   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,820             | 31.05.2029            |                 | 20.100                                          | 8                       | 0,01   |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 7,825             | 31.05.2029            |                 | 19.200                                          | 7                       | 0,01   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 7,936             | 12.06.2030            |                 | 19.600                                          | (11)                    | (0,01) |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 8,075             | 17.03.2027            |                 | 28.500                                          | 14                      | 0,01   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 8,250             | 01.03.2029            |                 | 9.000                                           | (4)                     | 0,00   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 8,267             | 28.02.2030            |                 | 59.500                                          | (76)                    | (0,06) |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIIE         | 8,270             | 07.03.2035            |                 | 3.400                                           | 2                       | 0,00   |
| Erhalt                                      | 28-Day MXN-TIIE         | 8,280             | 01.03.2029            |                 | 1.200                                           | (1)                     | 0,00   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,285 %           | 06.06.2035            | MXN 8.400       | \$ (6)                                          | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,290             | 27.02.2032            | 5.100           | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,330             | 01.03.2029            | 1.300           | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,360             | 13.03.2030            | 1.900           | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,365             | 28.03.2035            | 3.700           | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,480             | 13.03.2030            | 4.400           | (8)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,485             | 31.05.2029            | 21.700          | (10)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,495             | 31.05.2029            | 38.900          | (63)                                            | (0,05)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,500             | 13.03.2030            | 28.700          | 28                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,515             | 22.02.2035            | 12.000          | (19)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,545             | 23.11.2034            | 4.300           | 8                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,595             | 13.03.2030            | 29.100          | (58)                                            | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,620             | 05.12.2029            | 11.900          | 24                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,640             | 07.03.2035            | 7.200           | (15)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,650             | 31.01.2030            | 3.400           | 7                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,655             | 07.03.2035            | 7.600           | (16)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,665             | 11.12.2029            | 16.400          | (34)                                            | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,740             | 07.03.2035            | 2.000           | (5)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,800             | 12.12.2029            | 25.400          | 50                                              | 0,04                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,820             | 23.11.2034            | 13.600          | (37)                                            | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,855             | 09.02.2035            | 16.600          | (47)                                            | (0,04)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,873             | 23.11.2034            | 6.100           | (18)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 8,950             | 17.12.2029            | 25.700          | (68)                                            | (0,05)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,065             | 01.03.2029            | 27.600          | 70                                              | 0,05                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 9,131             | 11.12.2034            | 8.100           | (31)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,135             | 27.12.2029            | 7.100           | 22                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE        | 9,180             | 08.01.2030            | 8.400           | (27)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,295             | 28.12.2034            | 6.400           | 28                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,295             | 29.12.2034            | 14.400          | 64                                              | 0,05                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,340             | 27.12.2034            | 14.300          | 66                                              | 0,05                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,370             | 21.12.2034            | 26.700          | 126                                             | 0,09                    |
|                                                |                        |                   |                       |                 | \$ (837)                                        | (0,63)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                   |                       |                 | \$ (837)                                        | (0,63)                  |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung             | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK | CZK 24,650         | 11.03.2026         | 887                            | \$ 6   | \$ 7           | 0,01                    |
|            | Put - OTC EUR versus HUF | HUF 399,000        | 27.08.2025         | 641                            | 3      | 4              | 0,00                    |
|            | Put - OTC USD versus COP | COP 3.825,000      | 29.08.2025         | 76                             | 8      | 5              | 0,01                    |
| GLM        | Put - OTC USD versus JPY | ¥ 135,000          | 19.08.2025         | 488                            | 44     | 31             | 0,02                    |
|            | Put - OTC USD versus MXN | MXN 18,500         | 10.07.2025         | 68                             | 13     | 4              | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC USD versus MXN | 19,250             | 19.11.2025         | 1.587                          | 30     | 45             | 0,03                    |
|            | Put - OTC USD versus ZAR | ZAR 17,650         | 08.08.2025         | 1.302                          | 19     | 13             | 0,01                    |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK | CZK 24,750         | 09.12.2025         | 835                            | 5      | 6              | 0,01                    |
|            | Put - OTC EUR versus CZK | 24,700             | 16.12.2025         | 491                            | 3      | 3              | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus HUF | HUF 399,000        | 27.08.2025         | 662                            | 3      | 4              | 0,00                    |
|            | Put - OTC USD versus BRL | BRL 5,660          | 27.08.2025         | 1.519                          | 27     | 52             | 0,03                    |
|            | Put - OTC USD versus COP | COP 3.825,000      | 04.09.2025         | 76                             | 7      | 6              | 0,01                    |
|            |                          |                    |                    |                                | \$ 168 | \$ 180         | 0,13                    |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variable Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|------------------------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|-------------------------|
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR     | Zahlung                              | 3,850 %            | 10.07.2025         | 3.400                          | \$ 6   | \$ 4           | 0,00                    |

**VERKAUFSOPTIONEN****DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|----------|------------|----------------------|
| GLM        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,300     | 15.07.2025     | 201                        | \$ (4)   | \$ 0       | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 45,800         | 15.07.2025     | 201                        | (2)      | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 53,500         | 11.12.2025     | 1.371                      | (45)     | (37)       | (0,03)               |
| JPM        | Put - OTC USD versus MXN  | MXN 18,250     | 19.11.2025     | 1.587                      | (8)      | (10)       | (0,01)               |
|            | Put - OTC USD versus ZAR  | ZAR 17,250     | 08.08.2025     | 2.604                      | (16)     | (9)        | (0,01)               |
| MYI        | Put - OTC USD versus BRL  | BRL 5,400      | 27.08.2025     | 1.519                      | (8)      | (12)       | (0,01)               |
|            | Call - OTC USD versus BRL | 6,050          | 27.08.2025     | 1.519                      | (20)     | (4)        | 0,00                 |
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750     | 11.08.2025     | 149                        | (5)      | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750         | 11.08.2025     | 149                        | (3)      | (1)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 40,575         | 19.08.2025     | 219                        | (8)      | (1)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 52,725         | 19.08.2025     | 219                        | (5)      | (1)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600         | 12.11.2025     | 160                        | (6)      | (1)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900         | 12.11.2025     | 160                        | (4)      | (3)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,635         | 07.01.2026     | 673                        | (23)     | (6)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 07.01.2026     | 673                        | (15)     | (20)       | (0,02)               |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,800         | 08.01.2026     | 1.003                      | (34)     | (10)       | (0,01)               |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 08.01.2026     | 1.003                      | (23)     | (29)       | (0,02)               |
|            |                           |                |                |                            | \$ (229) | \$ (144)   | (0,11)               |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,270 %        | 26.08.2025     | 16.200                     | \$ (4)  | \$ (4)     | 0,00                 |
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 04.07.2025     | 6.700                      | (5)     | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 10.07.2025     | 3.400                      | (2)     | 0          | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,430          | 22.09.2025     | 16.955                     | (5)     | (9)        | (0,01)               |
|            |                                      |                         |                                   |                |                |                            | \$ (16) | \$ (13)    | (0,01)               |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                      | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond | (1,000) %                   | 20.06.2029        | \$ 1.300                   | \$ 29                                 | \$ (21)                                  | \$ 8       | 0,01                 |
|            | Brazil Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2029        | 900                        | 27                                    | (15)                                     | 12         | 0,01                 |
| BPS        | Brazil Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2029        | 100                        | 3                                     | (1)                                      | 2          | 0,00                 |
| BRC        | Brazil Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2029        | 600                        | 19                                    | (11)                                     | 8          | 0,01                 |
|            | Chile Government International Bond  | (1,000)                     | 20.12.2028        | 200                        | (4)                                   | 0                                        | (4)        | (0,01)               |
|            | Chile Government International Bond  | (1,000)                     | 20.12.2029        | 300                        | (6)                                   | 0                                        | (6)        | (0,01)               |
| CBK        | Brazil Government International Bond | (1,000)                     | 20.06.2029        | 1.800                      | 42                                    | (31)                                     | 11         | 0,01                 |
|            |                                      |                             |                   |                            | \$ 110                                | \$ (79)                                  | \$ 31      | 0,02                 |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| BPS        | Mexico Government International Bond      | 1,000 %                     | 20.12.2025        | \$ 300                     | \$ 1                                  | \$ 0                                     | \$ 1       | 0,00                 |
|            | Mexico Government International Bond      | 1,000                       | 20.12.2027        | 300                        | 1                                     | 2                                        | 3          | 0,00                 |
|            | Romania Government International Bond     | 1,000                       | 20.12.2025        | 650                        | 1                                     | 0                                        | 1          | 0,00                 |
| BRC        | Peru Government International Bond        | 1,000                       | 20.12.2029        | 300                        | 2                                     | 1                                        | 3          | 0,01                 |
|            | South Korea Government International Bond | 1,000                       | 20.12.2025        | 300                        | 2                                     | (1)                                      | 1          | 0,00                 |
|            |                                           |                             |                   |                            | \$ 7                                  | \$ 2                                     | \$ 9       | 0,01                 |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

### CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                        | Zahlung                                                                                                          | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag<br>erhaltener<br>Währung | Nennbetrag<br>gelieferter<br>Währung | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |        |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|------------------------------|--------|
| BOA        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung             | 18.09.2030            | \$                                       | 2.192 PHP                            | 126.131                                      | \$ (5)                                             | \$ (25)        | \$ (30)                      | (0,02) |
| DUB        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day KRW-SOFR abzgl. 0,510 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung               | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2028            | KRW                                      | 561.620                              | \$ 412                                       | 0                                                  | 0              | 0                            | 0,00   |
| GLM        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day IDR-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,639 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030            | INR                                      | 149.950                              | 1.733                                        | 24                                                 | 10             | 34                           | 0,02   |
|            | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month KRW-SOFR abzgl. 0,500 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung             | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2028            | KRW                                      | 1.299.530                            | 958                                          | (6)                                                | 0              | (6)                          | 0,00   |
|            | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung             | 17.09.2030            | \$                                       | 119 PHP                              | 6.830                                        | 0                                                  | 0              | 0                            | 0,00   |
|            | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung             | 17.09.2030            |                                          | 13                                   | 730                                          | 0                                                  | 0              | 0                            | 0,00   |
| JPM        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung             | 17.09.2030            |                                          | 13                                   | 730                                          | 0                                                  | 0              | 0                            | 0,00   |
| SCX        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day IDR-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,651 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 18.03.2033            | IDR                                      | 5.889.220                            | \$ 345                                       | 6                                                  | 6              | 12                           | 0,01   |
|            |                                                                                                                               |                                                                                                                  |                       |                                          |                                      |                                              | \$ 19                                              | \$ (9)         | \$ 10                        | 0,01   |

### ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,500 %            | 18.09.2026            | MYR 13.690      | \$ 0                                         | \$ 12                                              | \$ 12          | 0,01                         |
| CBK        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,500              | 17.09.2030            | 2.130           | 7                                            | 0                                                  | 7              | 0,01                         |
| GST        | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,868              | 20.12.2028            | 7.210           | 24                                           | 18                                                 | 42             | 0,03                         |
|            |                                             |                         |                    |                       |                 | \$ 31                                        | \$ 30                                              | \$ 61          | 0,05                         |

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

### TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier                                   | Anzahl der<br>Anteile<br>oder Einheiten | Variabler<br>Zinssatz | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------|----------------------------------------------|-----------------------------------------|-----------------------|-----------------|-----------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| SCX        | Erhalt             | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | 0                                       | 4,940 %               | INR 229.260     | 24.09.2025            | \$ 0                                         | \$ 27                                              | \$ 27          | 0,02                         |

### VOLATILITÄTSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>Volatilität | Referenzeinheit                                              | Volatilität<br>Ausübungskurs | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------------------------|-----------------------|-----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| JPM        | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,600 %                      | 24.11.2025            | \$ 3            | \$ 0                                     | \$ (5)                                          | \$ (5)         | (0,01)                       |
|            | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,725                        | 26.11.2025            | 2               | 0                                        | (2)                                             | (2)            | 0,00                         |
| SCX        | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,450                        | 21.11.2025            | 2               | 0                                        | (3)                                             | (3)            | 0,00                         |
|            |                                   |                                                              |                              |                       |                 | \$ 0                                     | \$ (10)                                         | \$ (10)        | (0,01)                       |

<sup>(1)</sup> Varianz-Swap.

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025               | BRL                    | 1.626                    | \$ 284                           | \$ 0                               | \$ (14)                                              | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | DOP                    | 39.731                   | \$ 665                           | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 998                      | 1.135                            | 0                                  | (37)                                                 | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 5.510.205                | 338                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MYR                    | 1.508                    | 355                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 1.100                    | 303                              | 0                                  | (7)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 69                       | 54                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 151                      | BRL 851                          | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 162                      | KRW 220.894                      | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.433                    | MYR 6.069                        | 10                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 227                      | PLN 823                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 95                       | UYU 3.878                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 26.385                   | \$ 1.489                         | 7                                  | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CZK                    | 15.332                   | 727                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    | 3.174                    | 53                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 77.635                   | € 192                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 54                       | SGD 69                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 756.847                  | \$ 182                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 11.995                   | 628                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 634                      | 177                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 169                      | MXN 3.253                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               |                        | 55                       | PEN 204                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | ¥                      | 180.900                  | \$ 1.257                         | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 1.227                    | 336                              | 0                                  | (10)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | RON                    | 727                      | 167                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 14.507                   | 361                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 582                      | IDR 9.500.792                    | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 27                       | RON 120                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.160                    | THB 70.092                       | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 67                       | TWD 2.166                        | 8                                  | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 34.762                   | \$ 1.088                         | 0                                  | (120)                                                | (0,09)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 36                       | CZK 790                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 22                       | HUF 7.628                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 154                      | INR 13.369                       | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 635                      | TWD 19.073                       | 28                                 | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 161.080                  | \$ 39                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 69                       | PEN 251                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | €                      | 475                      | \$ 511                           | 0                                  | (51)                                                 | (0,04)                  |
|            | 05.2026               | \$                     | 363                      | KWD 111                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 06.2026               |                        | 496                      | 152                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 06.2027               |                        | 139                      | 42                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 05.2029               | KWD                    | 610                      | \$ 2.096                         | 92                                 | 0                                                    | 0,07                    |
|            | 07.2029               |                        | 72                       | 249                              | 11                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 05.2030               |                        | 343                      | 1.180                            | 47                                 | 0                                                    | 0,04                    |
| BRC        | 07.2025               | ILS                    | 56                       | 16                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MYR                    | 1.478                    | 349                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 568                      | 153                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 36.562                   | 899                              | 0                                  | (7)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 3                        | ¥ 444                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 6.084                    | MYR 25.726                       | 32                                 | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.463                    | PLN 5.458                        | 47                                 | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.263                    | TRY 51.617                       | 19                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 60.424                   | \$ 3.352                         | 0                                  | (43)                                                 | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | €                      | 192                      | HUF 77.637                       | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TRY                    | 1.715                    | \$ 41                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 351                      | CZK 7.800                        | 20                                 | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 08.2025               |                        | 760                      | TRY 31.713                       | 9                                  | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 09.2025               |                        | 11                       | COP 45.808                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               |                        | 105                      | TRY 4.895                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BSH        | 07.2025               | PEN                    | 1.528                    | \$ 412                           | 0                                  | (19)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.090                    | PEN 3.923                        | 15                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 1.102                    | \$ 308                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 724                      | PEN 2.651                        | 21                                 | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | 1.231                    | \$ 340                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 11.2025               | \$                     | 136                      | PEN 502                          | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               | PEN                    | 1.603                    | \$ 442                           | 0                                  | (8)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | ¥                      | 94.800                   | 661                              | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 4.456                    | 1.220                            | 0                                  | (36)                                                 | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | PHP                    | 18.672                   | 332                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SEK                    | 240                      | 25                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 86.146                   | 2.617                            | 0                                  | (33)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | TWD                    | 5.332                    | 180                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 9.871                    | BRL 58.632                       | 873                                | 0                                                    | 0,66                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.796                    | IDR 29.254.078                   | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.066                    | KRW 1.461.123                    | 15                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 24                       | PEN 89                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5.056                    | THB 165.744                      | 48                                 | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 82                       | TWD 2.655                        | 9                                  | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CLP                    | 700.998                  | \$ 730                           | 0                                  | (21)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | COP                    | 10.194.890               | 2.445                            | 0                                  | (38)                                                 | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | EGP                    | 1.396                    | 26                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | PEN                    | 7.425                    | 1.989                            | 0                                  | (102)                                                | (0,08)                  |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| DUB        | 08.2025               | \$                     | 1.044                    | INR                              | 90.009                             | \$ 4                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 420                      | PEN                              | 1.556                              | 18                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 169                      | TWD                              | 5.534                              | 23                                                   | 0,02                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 1.640.664                | \$                               | 398                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 1.096                    |                                  | 299                                | (9)                                                  | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 168                      | COP                              | 700.056                            | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 1                        | KZT                              | 662                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 223                      | PEN                              | 825                                | 9                                                    | 0,01                    |
|            | 10.2025               |                        | 12                       | COP                              | 58.464                             | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               | INR                    | 147.777                  | \$                               | 1.681                              | (28)                                                 | (0,02)                  |
|            | 12.2025               | \$                     | 20                       | PEN                              | 75                                 | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 02.2026               | PEN                    | 2.060                    | \$                               | 561                                | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 06.2026               | ARS                    | 101.205                  |                                  | 67                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 557                      |                                  | 646                                | (8)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | ILS                    | 52                       |                                  | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 45.519                   |                                  | 1.387                              | (13)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 135                      | IDR                              | 2.190.375                          | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 179                      | KZT                              | 93.877                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 246                      | MYR                              | 1.043                              | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 6                        | SGD                              | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.389                    | THB                              | 45.519                             | 14                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 646                      | €                                | 556                                | 8                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 534                      | INR                              | 46.066                             | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 103                      | TWD                              | 3.041                              | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 2.863                    | \$                               | 149                                | (2)                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 09.2025               | \$                     | 9                        | KZT                              | 4.944                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 322                      | MXN                              | 6.200                              | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               |                        | 73                       | KZT                              | 38.724                             | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | AUD                    | 95                       | \$                               | 61                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 60.064                   |                                  | 10.863                             | (143)                                                | (0,11)                  |
|            | 07.2025               | CHF                    | 14                       |                                  | 17                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 89.804                   |                                  | 617                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 55                       |                                  | 43                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 62                       | AUD                              | 95                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 601                      | BRL                              | 3.439                              | 29                                                   | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 18                       | CHF                              | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.706                    | ¥                                | 244.784                            | (12)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               |                        | 148                      | MYR                              | 626                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.039                    | PLN                              | 3.830                              | 21                                                   | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 8                        | SGD                              | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | AUD                    | 95                       | \$                               | 62                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CHF                    | 14                       |                                  | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 255                      | INR                              | 22.063                             | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 617                      | ¥                                | 89.474                             | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 43                       | SGD                              | 55                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 54.993                   | \$                               | 2.842                              | (46)                                                 | (0,03)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 10.863                   | BRL                              | 60.983                             | 142                                                  | 0,11                    |
|            | 09.2025               |                        | 0                        | PEN                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 11.2025               | PEN                    | 4.450                    | \$                               | 1.212                              | (37)                                                 | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | BRL                    | 3.160                    |                                  | 567                                | (12)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | DOP                    | 11.729                   |                                  | 198                                | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 21                       |                                  | 17                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 109.534                  |                                  | 3.358                              | (11)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 297                      | BRL                              | 1.713                              | 17                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 426                      | IDR                              | 6.939.193                          | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.311                    | THB                              | 107.823                            | 13                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 65                       | TRY                              | 2.701                              | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 495                      | \$                               | 27                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    | 35.717                   |                                  | 581                                | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | HUF                    | 178.069                  |                                  | 517                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 197                      | HUF                              | 70.311                             | 9                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 17                       | SGD                              | 21                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | DOP                    | 171.734                  | \$                               | 2.751                              | (97)                                                 | (0,05)                  |
|            | 09.2025               | PHP                    | 190.570                  |                                  | 3.264                              | (113)                                                | (0,08)                  |
|            | 10.2025               | EGP                    | 12.475                   |                                  | 220                                | (21)                                                 | (0,02)                  |
|            | 11.2025               | DOP                    | 6.161                    |                                  | 102                                | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               | PEN                    | 4.039                    |                                  | 1.099                              | (35)                                                 | (0,03)                  |
|            | 12.2025               | TRY                    | 7.366                    |                                  | 158                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2026               | ARS                    | 50.351                   |                                  | 33                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 25                       | SEK                              | 240                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SEK                    | 240                      | \$                               | 25                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | BRL                    | 3.353                    |                                  | 561                                | (50)                                                 | (0,04)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 2.888.162                |                                  | 177                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 70                       |                                  | 42                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 45                       |                                  | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 1.926                    |                                  | 47                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 561                      | BRL                              | 3.353                              | 50                                                   | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 63                       | KRW                              | 86.967                             | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.829                    | PHP                              | 102.185                            | (19)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               |                        | 4.061                    | PLN                              | 15.142                             | 128                                                  | 0,10                    |
|            | 07.2025               |                        | 372                      | SGD                              | 478                                | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 780                      | THB                              | 25.351                             | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 67                       | TWD                              | 2.184                              | 8                                                    | 0,01                    |



| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MBC        | 07.2025               | ZAR                    | 17.201                   | \$                               | 963                                | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 172                      | INR                              | 14.911                             | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 35                       | SGD                              | 45                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 70                       | TWD                              | 2.297                              | 10                                                   | 0,01                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 4.889.500                | \$                               | 1.158                              | 0                                                    | (0,02)                  |
|            | 09.2025               | THB                    | 9.559                    |                                  | 281                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 502                      | PEN                              | 1.797                              | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 10.538                   | \$                               | 184                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 05.2026               | \$                     | 37                       | ZMW                              | 1.082                              | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2026               | EGP                    | 9.930                    | \$                               | 161                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | CAD                    | 111                      |                                  | 80                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 26                       |                                  | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 1.205                    |                                  | 932                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 80                       | CAD                              | 111                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.949                    | €                                | 2.545                              | 39                                                   | 0,03                    |
|            | 07.2025               |                        | 771                      | IDR                              | 12.501.471                         | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 75                       | ¥                                | 10.737                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.033                    | PHP                              | 57.687                             | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025               |                        | 1.572                    | PLN                              | 5.887                              | 57                                                   | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 896                      | SGD                              | 1.149                              | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 48                       | THB                              | 1.601                              | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 58                       | TWD                              | 1.905                              | 7                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 80                       | CAD                              | 110                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 29                       | EGP                              | 1.598                              | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 932                      | SGD                              | 1.203                              | 14                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 56                       | TWD                              | 1.819                              | 8                                                    | 0,01                    |
| MYI        | 09.2025               | MXN                    | 2.583                    | \$                               | 134                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 10.529                   |                                  | 184                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | ¥                      | 28.423                   |                                  | 195                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 238                      |                                  | 24                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.034                    | ¥                                | 149.240                            | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 143                      | MYR                              | 607                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | PLN                              | 20                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 2.531                    | \$                               | 140                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 59.126                   |                                  | 170                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 143.182                  |                                  | 996                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 181                      | HUF                              | 63.747                             | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 195                      | ¥                                | 28.319                             | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 24                       | NOK                              | 238                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 745.893                  | \$                               | 179                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 344                      | COP                              | 1.417.895                          | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 265                      | MXN                              | 5.091                              | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 5.975                    | \$                               | 105                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 10.2025               | \$                     | 105                      | EGP                              | 6.011                              | 11                                                   | 0,01                    |
|            | 12.2025               | CZK                    | 3.129                    | €                                | 124                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 1.349                    | \$                               | 372                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 240                      |                                  | 186                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 777                      |                                  | 27                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.981                    | IDR                              | 32.271.974                         | 7                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 188                      | ¥                                | 27.224                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 355                      | MYR                              | 1.508                              | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 509                      | PEN                              | 1.825                              | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.786                    | THB                              | 90.779                             | 6                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               |                        | 403                      | TWD                              | 11.978                             | 10                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 13.861                   | \$                               | 162                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 27.123                   |                                  | 188                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 611                      | INR                              | 52.909                             | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 186                      | SGD                              | 240                                | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 737                      | TWD                              | 22.600                             | 48                                                   | 0,04                    |
|            | 09.2025               | PHP                    | 310.399                  | \$                               | 5.564                              | 70                                                   | 0,05                    |
|            | 05.2026               | \$                     | 38                       | ZMW                              | 1.100                              | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 4.150                    | \$                               | 29                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.112                    | RON                              | 4.878                              | 14                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 7                        | HUF                              | 2.472                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 1                        | INR                              | 89                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 29                       | ¥                                | 4.135                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 129                      | TWD                              | 3.792                              | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | 602                      | \$                               | 163                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               |                        | 1.155                    |                                  | 312                                | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | CLP                    | 529.554                  |                                  | 566                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ILS                    | 8                        |                                  | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 25                       | ¥                                | 3.608                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 26                       | NOK                              | 263                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 842                      | RON                              | 3.700                              | 12                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 68                       | TRY                              | 3.009                              | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 1.534.500                | \$                               | 372                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 7.055                    |                                  | 364                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 182                      | COP                              | 756.028                            | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               |                        | 27                       | TRY                              | 1.282                              | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               | €                      | 124                      | CZK                              | 3.129                              | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 01.2026               | \$                     | 328                      | TRY                              | 15.636                             | 7                                                    | 0,01                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| WST                              | 07.2025               | ¥                      | 47.689                   | \$ 331                           | \$ 1                               | \$ 1                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 42                       | NZD 70                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | NZD                    | 70                       | \$ 42                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 331                      | ¥ 47.514                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 2.311                         | \$ (1.479)                         | \$ 832                                               | 0,63                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 987                                               | 0,74                    |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 138.844                                           | 104,11                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (5.486)                                           | (4,11)                  |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 133.358                                           | 100,00                  |

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

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

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.  
(b) Nullkuponwertpapier.  
(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.  
(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,26 %):

| Emittentenbeschreibung | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Kauf-<br>datum | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|---------|-----------------------|----------------|----------|----------------|-------------------------|
| Asian Development Bank | 5,750 % | 23.01.2030            | 06.01.2025     | \$ 1.082 | \$ 1.277       | 0,96                    |

- (j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 10.952 USD (31. Dezember 2024: 14.831 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.517 USD (31. Dezember 2024: 2.015 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 500 USD (31. Dezember 2024: 1.120 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 128.524                                                      | \$ 3.452                                                     | \$ 131.976 |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 6.700                                                           | 0                                                            | 6.700      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | 168                                                             | 0                                                            | 168        |
| Summen                        | \$ 0                                                                        | \$ 135.392                                                      | \$ 3.452                                                     | \$ 138.844 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 122.692                                                      | \$ 620                                                       | \$ 123.312 |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 3.400                                                           | 0                                                            | 3.400      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (26)                                                                        | (725)                                                           | 0                                                            | (751)      |
| Summen                        | \$ (26)                                                                     | \$ 125.367                                                      | \$ 620                                                       | \$ 125.961 |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS                                | 5,420 %         | 06.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | PLN (18.171)      | \$ (5.047)                                                      | (3,78)                  |
|                                    | 5,450           | 17.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (4.691)           | (1.301)                                                         | (0,98)                  |
| MBC                                | 5,400           | 30.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (7.617)           | (2.118)                                                         | (1,59)                  |
|                                    | 5,400           | 06.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (7.924)           | (2.200)                                                         | (1,65)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (10.666)                                                     | (8,00)                  |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| BOA        | \$ (38)                             | \$ 0                                  | \$ (38)                             | \$ 75                               | \$ 0                                  | \$ 75                               |
| BPS        | 28                                  | 0                                     | 28                                  | 340                                 | (280)                                 | 60                                  |
| BRC        | 74                                  | (40)                                  | 34                                  | (176)                               | 40                                    | (136)                               |
| BSH        | 7                                   | 0                                     | 7                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| CBK        | 745                                 | (550)                                 | 195                                 | (758)                               | 720                                   | (38)                                |
| DUB        | 11                                  | 0                                     | 11                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| FAR        | (45)                                | 0                                     | (45)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| GLM        | (205)                               | 230                                   | 25                                  | 518                                 | (430)                                 | 88                                  |
| GST        | 42                                  | (60)                                  | (18)                                | (52)                                | 50                                    | (2)                                 |
| JPM        | 96                                  | (80)                                  | 16                                  | (35)                                | 50                                    | 15                                  |
| MBC        | 89                                  | 0                                     | 89                                  | 15                                  | 0                                     | 15                                  |
| MYC        | (9)                                 | 0                                     | (9)                                 | 7                                   | 0                                     | 7                                   |
| MYI        | 56                                  | (10)                                  | 46                                  | (11)                                | 0                                     | (11)                                |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 1                                   | 0                                     | 1                                   |
| SCX        | 186                                 | (250)                                 | (64)                                | 5                                   | 0                                     | 5                                   |
| SOG        | 14                                  | 0                                     | 14                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SSB        | (15)                                | 0                                     | (15)                                | 35                                  | 0                                     | 35                                  |
| UAG        | (49)                                | 270                                   | 221                                 | (67)                                | 260                                   | 193                                 |
| WST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 21                                  | 0                                     | 21                                  |

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

**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                           | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere         | 79,69             | 74,39             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 1,84              | 5,09              |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                     | 0,26              | k. A.             |
| Pensionsgeschäfte                                                     | 4,15              | 2,19              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                   | 0,02              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                   | 2,07              | 2,20              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                            | 1,66              | 1,60              |
| Sonstige Aktiva                                                       | 10,31             | 14,53             |
| Summe Aktiva                                                          | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert   | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Bulgarien               | k. A.             | 0,48              |
| Chile                   | 2,61              | 2,75              |
| Kolumbien               | 6,16              | 3,64              |
| Tschechische Republik   | 6,32              | 8,19              |
| Dominikanische Republik | 5,25              | 2,72              |
| Ecuador                 | 0,36              | 0,48              |
| Ägypten                 | 1,69              | k. A.             |
| Frankreich              | 0,17              | k. A.             |
| Deutschland             | 1,49              | 0,21              |
| Ungarn                  | 1,87              | 1,11              |
| Indien                  | 0,08              | 0,50              |
| Indonesien              | 6,68              | 7,61              |
| Irland                  | 1,20              | 0,67              |
| Elfenbeinküste          | 0,75              | 1,16              |
| Kasachstan              | 0,14              | 0,16              |
| Malaysia                | 4,95              | 5,74              |
| Mexiko                  | 10,82             | 9,54              |
| Mongolei                | k. A.             | 0,26              |
| Oman                    | k. A.             | 0,17              |
| Paraguay                | 0,46              | 0,30              |
| Peru                    | 6,21              | 6,66              |
| Philippinen             | 4,55              | 4,64              |
| Polen                   | 9,08              | 9,99              |
| Rumänien                | 2,90              | 2,28              |
| Serbien                 | 0,58              | k. A.             |
| Singapur                | k. A.             | 0,29              |
| Südafrika               | 8,84              | 10,81             |
| Supranational           | 9,74              | 10,19             |
| Thailand                | 2,71              | 3,13              |
| Türkei                  | 1,69              | 3,29              |
| Ukraine                 | 0,15              | 0,31              |
| USA                     | k. A.             | 2,59              |
| Uruguay                 | 0,02              | 0,74              |
| Usbekistan              | 0,40              | 0,45              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 1,10              | 4,43              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 5,02              | 2,91              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,01              | (0,08)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,63)            | (0,50)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,13              | 0,04              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,11)            | (0,23)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | 0,02              | 0,31              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | (0,14)            |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | 0,01              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,05              | 0,02              |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere                                                     | 0,02              | 0,00              |
| Volatilitätsswaps                                                                      | (0,01)            | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | 0,63              | (0,07)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (4,11)            | (7,75)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|----------------------------------------------------------|----------------|----------------|--------------------------|-------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                                 |                |                |                          |       |
| <b>ANGOLA</b>                                            |                |                |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| Angola Government International Bond                     |                |                |                          |       |
| 8,000 % fällig am 26.11.2029                             |                |                |                          |       |
| (k)                                                      | \$ 11.900      | \$ 10.822      | 0,23                     |       |
| 8,250 % fällig am 09.05.2028                             | 11.400         | 10.762         | 0,23                     |       |
| 9,125 % fällig am 26.11.2049                             | 4.700          | 3.650          | 0,08                     |       |
| 9,500 % fällig am 12.11.2025                             | 10.000         | 10.048         | 0,21                     |       |
| Summe Angola                                             |                | 35.282         | 0,75                     |       |
| <b>ARGENTINIEN</b>                                       |                |                |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| Pampa Energia S.A.                                       |                |                |                          |       |
| 7,875 % fällig am 16.12.2034                             | 8.300          | 8.297          | 0,18                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| Argentina Government International Bond                  |                |                |                          |       |
| 0,750 % fällig am 09.07.2030                             | 36.838         | 29.267         | 0,62                     |       |
| (k)                                                      |                |                |                          |       |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029                             | 20.163         | 16.856         | 0,36                     |       |
| 3,500 % fällig am 09.07.2041                             |                |                |                          |       |
| (k)                                                      | 55.355         | 34.459         | 0,74                     |       |
| 4,125 % fällig am 09.07.2035                             |                |                |                          |       |
| (k)                                                      | 34.167         | 22.990         | 0,49                     |       |
| 5,000 % fällig am 09.01.2038                             |                |                |                          |       |
| (k)                                                      | 36.456         | 25.970         | 0,55                     |       |
| Provincia de Buenos Aires                                |                |                |                          |       |
| 6,625 % fällig am 01.09.2037                             | 5.457          | 3.936          | 0,08                     |       |
| Provincia de Cordoba                                     |                |                |                          |       |
| 6,875 % fällig am 10.12.2025                             | 382            | 385            | 0,01                     |       |
| Provincia de la Rioja                                    |                |                |                          |       |
| 8,500 % fällig am 24.02.2028 ^                           | 2.550          | 1.695          | 0,04                     |       |
| 8,500 % fällig am 24.02.2028                             | 3.771          | 2.508          | 0,05                     |       |
|                                                          |                | 138.066        | 2,94                     |       |
| Summe Argentinien                                        |                | 146.363        | 3,12                     |       |
| <b>ASERBAIDSCHAN</b>                                     |                |                |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC             |                |                |                          |       |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026                             | 11.900         | 11.822         | 0,25                     |       |
| Southern Gas Corridor CJSC                               |                |                |                          |       |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026                             | 38.550         | 39.105         | 0,83                     |       |
| Summe Aserbaidshan                                       |                | 50.927         | 1,08                     |       |
| <b>BAHRAIN</b>                                           |                |                |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| Bahrain Government International Bond                    |                |                |                          |       |
| 4,250 % fällig am 25.01.2028                             | 8.900          | 8.566          | 0,18                     |       |
| 5,625 % fällig am 30.09.2031                             | 2.250          | 2.140          | 0,05                     |       |
| 7,500 % fällig am 07.07.2037                             | 10.300         | 10.426         | 0,22                     |       |
| Summe Bahrain                                            |                | 21.132         | 0,45                     |       |
| <b>BENIN</b>                                             |                |                |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| Benin Government International Bond                      |                |                |                          |       |
| 4,875 % fällig am 19.01.2032                             | € 959          | 1.005          | 0,02                     |       |
| 4,950 % fällig am 22.01.2035                             | 1.300          | 1.305          | 0,03                     |       |
| 6,875 % fällig am 19.01.2052                             | 400            | 393            | 0,01                     |       |
| Summe Benin                                              |                | 2.703          | 0,06                     |       |
| <b>BERMUDA</b>                                           |                |                |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| Baldwin Re Ltd.                                          |                |                |                          |       |
| 6,334 % fällig am 07.07.2028                             | \$ 500         | 500            | 0,01                     |       |
| Cape Lookout Re Ltd.                                     |                |                |                          |       |
| 11,194 % fällig am 13.03.2032                            | 800            | 803            | 0,00                     |       |
| Polestar Re Ltd.                                         |                |                |                          |       |
| 14,794 % fällig am 07.01.2028                            | 300            | 309            | 0,01                     |       |
| Torrey Pines Re Ltd.                                     |                |                |                          |       |
| 10,308 % fällig am 07.06.2032                            | 300            | 310            | 0,01                     |       |
| 11,558 % fällig am 07.06.2032                            | 250            | 261            | 0,01                     |       |
| 13,308 % fällig am 05.06.2031                            | 250            | 256            | 0,01                     |       |
| Summe Bermuda                                            |                | 2.439          | 0,05                     |       |
| <b>BRASILIEN</b>                                         |                |                |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| Banco do Brasil S.A.                                     |                |                |                          |       |
| 8,500 % fällig am 29.07.2026                             | MXN 294.000    | 15.613         | 0,33                     |       |
| Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais               |                |                |                          |       |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028                             | \$ 17.277      | 17.215         | 0,37                     |       |
| CSN Inova Ventures                                       |                |                |                          |       |
| 6,750 % fällig am 28.01.2028                             | 15.000         | 14.193         | 0,30                     |       |
| Unigel Luxembourg S.A. (11,000% bar oder 12,000% PIK)    |                |                |                          |       |
| 11,000 % fällig am                                       |                |                |                          |       |
| 31.12.2028 ^ (b)                                         | 3.423          | 957            | 0,02                     |       |
| Unigel Luxembourg S.A. (13,500% bar oder 15,000% PIK)    |                |                |                          |       |
| 13,500 % fällig am                                       |                |                |                          |       |
| 31.12.2027 ^ (b)                                         | 1.576          | 1.268          | 0,03                     |       |
| Vale S.A.                                                |                |                |                          |       |
| 0,000 % (g)                                              | BRL 188.860    | 11.864         | 0,25                     |       |
|                                                          |                | 61.110         | 1,30                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| Brazil Government International Bond                     |                |                |                          |       |
| 6,625 % fällig am 15.03.2035                             | \$ 10.900      | 11.026         | 0,24                     |       |
| Summe Brasilien                                          |                | 72.136         | 1,54                     |       |
| <b>BULGARIEN</b>                                         |                |                |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| Bulgaria Government International Bond                   |                |                |                          |       |
| 3,500 % fällig am 07.05.2034                             | € 9.900        | 11.755         | 0,25                     |       |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038                             | 12.500         | 14.961         | 0,32                     |       |
| 4,250 % fällig am 05.09.2044                             | 6.100          | 7.249          | 0,15                     |       |
| 5,000 % fällig am 05.03.2037                             | \$ 18.200      | 17.811         | 0,38                     |       |
| Summe Bulgarien                                          |                | 51.776         | 1,10                     |       |
| <b>KAMERUN</b>                                           |                |                |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| Republic of Cameroon Government International Bond       |                |                |                          |       |
| 5,950 % fällig am 07.07.2032                             | € 9.680        | 8.909          | 0,19                     |       |
| 9,500 % fällig am 19.11.2025                             | \$ 2.489       | 2.479          | 0,05                     |       |
| 9,500 % fällig am 31.07.2031                             | 9.400          | 8.787          | 0,19                     |       |
| Summe Kamerun                                            |                | 20.175         | 0,43                     |       |
| <b>KANADA</b>                                            |                |                |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| Ivanhoe Mines Ltd.                                       |                |                |                          |       |
| 7,875 % fällig am 23.01.2030                             | 5.900          | 5.894          | 0,13                     |       |
| <b>KAIMANINSELN</b>                                      |                |                |                          |       |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                  |                |                |                          |       |
| Betony CLO Ltd.                                          |                |                |                          |       |
| 5,621 % fällig am 30.04.2031                             | 731            | 733            | 0,01                     |       |
| Dryden CLO Ltd.                                          |                |                |                          |       |
| 5,638 % fällig am 15.01.2031                             | 210            | 210            | 0,00                     |       |
| KKR CLO Ltd.                                             |                |                |                          |       |
| 5,518 % fällig am 15.04.2031                             | 342            | 342            | 0,01                     |       |
| Voya CLO Ltd.                                            |                |                |                          |       |
| 5,481 % fällig am 19.04.2031                             | 389            | 390            | 0,01                     |       |
| Wind River CLO Ltd.                                      |                |                |                          |       |
| 5,581 % fällig am 18.07.2031                             | 36             | 36             | 0,00                     |       |
|                                                          |                | 1.711          | 0,03                     |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| Biocanico Sovereign Certificate Ltd.                     |                |                |                          |       |
| 0,000 % fällig am 05.06.2034                             | 15.296         | 12.175         | 0,26                     |       |
| (d)                                                      |                |                |                          |       |
| Country Garden Holdings Co. Ltd.                         |                |                |                          |       |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 ^                           | 500            | 39             | 0,00                     |       |
| 3,125 % fällig am 22.10.2025 ^                           | 400            | 30             | 0,00                     |       |
| 5,400 % fällig am 27.05.2025 ^                           | 1.300          | 101            | 0,00                     |       |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 ^                           | 900            | 69             | 0,00                     |       |
| FWD Group Holdings Ltd.                                  |                |                |                          |       |
| 7,635 % fällig am 02.07.2031                             | 9.900          | 10.859         | 0,23                     |       |
| Gacil First Investment Co.                               |                |                |                          |       |
| 4,875 % fällig am 14.02.2035                             | 1.000          | 980            | 0,02                     |       |
| 5,000 % fällig am 29.01.2029                             | 400            | 405            | 0,01                     |       |
| 5,125 % fällig am 14.02.2053                             | \$ 16.000      | 13.722         | 0,29                     |       |
| 5,250 % fällig am 29.01.2030                             | 10.800         | 11.035         | 0,24                     |       |
| 5,250 % fällig am 13.10.2032                             | 300            | 306            | 0,01                     |       |
| <b>INTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| Interoceanica Finance Ltd.                               |                |                |                          |       |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 (d)                         | 599            | 586            | 0,01                     |       |
| 0,000 % fällig am 15.05.2030 (d)                         | 4.691          | 3.856          | 0,08                     |       |
| 7,860 % fällig am 15.05.2030                             | 2.722          | 2.825          | 0,06                     |       |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                |                |                |                          |       |
| 8,500 % fällig am 30.06.2022 ^                           | 600            | 27             | 0,00                     |       |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^                           | 4.100          | 184            | 0,01                     |       |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^                           | 3.200          | 144            | 0,00                     |       |
| 11,250 % fällig am 09.04.2022 ^                          | 1.100          | 50             | 0,00                     |       |
| 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^                          | 200            | 9              | 0,00                     |       |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^                          | 3.300          | 149            | 0,00                     |       |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^                          | 2.600          | 117            | 0,00                     |       |
| Lima Metro Line Finance Ltd.                             |                |                |                          |       |
| 4,350 % fällig am 05.04.2036                             |                |                |                          |       |
| (k)                                                      | 476            | 448            | 0,01                     |       |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034                             |                |                |                          |       |
| (k)                                                      | 819            | 831            | 0,02                     |       |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034                             | 795            | 807            | 0,02                     |       |
| Poinsettia Finance Ltd.                                  |                |                |                          |       |
| 6,625 % fällig am 17.06.2031                             | 9.891          | 9.264          | 0,20                     |       |
| Red Dorsal Finance Ltd.                                  |                |                |                          |       |
| 5,875 % fällig am 12.10.2031                             | 3.800          | 3.768          | 0,08                     |       |
| Saudi Electricity Sukuk Programme Co.                    |                |                |                          |       |
| 5,225 % fällig am 18.02.2030                             | 6.500          | 6.618          | 0,14                     |       |
| 5,489 % fällig am 18.02.2035                             | 6.600          | 6.733          | 0,14                     |       |
| SRC Sukuk Ltd.                                           |                |                |                          |       |
| 5,000 % fällig am 27.02.2028                             | 11.600         | 11.703         | 0,25                     |       |
| 5,375 % fällig am 27.02.2035                             | 11.500         | 11.659         | 0,25                     |       |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % bar oder 6,000 % PIK) |                |                |                          |       |
| 5,000 % fällig am 30.09.2026                             |                |                |                          |       |
| ^ (b)                                                    | 542            | 67             | 0,00                     |       |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK) |                |                |                          |       |
| 5,250 % fällig am 30.09.2027                             |                |                |                          |       |
| ^ (b)                                                    | 543            | 68             | 0,00                     |       |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK) |                |                |                          |       |
| 5,500 % fällig am 30.09.2027                             |                |                |                          |       |
| ^ (b)                                                    | 1.089          | 136            | 0,00                     |       |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK) |                |                |                          |       |
| 5,750 % fällig am 30.09.2028                             |                |                |                          |       |
| ^ (b)                                                    | 1.638          | 205            | 0,01                     |       |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) |                |                |                          |       |
| 6,000 % fällig am 30.09.2029                             |                |                |                          |       |
| ^ (b)                                                    | 1.542          | 193            | 0,01                     |       |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK) |                |                |                          |       |
| 6,250 % fällig am 30.09.2030                             |                |                |                          |       |
| ^ (b)                                                    | 773            | 95             | 0,00                     |       |
| TIB Diversified Payment Rights Finance Co.               |                |                |                          |       |
| 7,226 % fällig am 15.11.2034                             | 7.900          | 7.902          | 0,17                     |       |
| VD DPR Finance Co.                                       |                |                |                          |       |
| 6,833 % fällig am 15.03.2035                             | 16.800         | 16.471         | 0,35                     |       |
|                                                          |                | 134.636        | 2,87                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                |                          |       |
| KSA Sukuk Ltd.                                           |                |                |                          |       |
| 5,250 % fällig am 04.06.2034                             | 200            | 204            | 0,00                     |       |
| RAK Capital                                              |                |                |                          |       |
| 5,000 % fällig am 12.03.2035                             | 6.300          | 6.389          | 0,14                     |       |
|                                                          |                | 6.593          | 0,14                     |       |
| Summe Kaimaninseln                                       |                | 142.940        | 3,04                     |       |
| <b>CHILE</b>                                             |                |                |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                |                          |       |
| AES Andes S.A.                                           |                |                |                          |       |
| 6,300 % fällig am 15.03.2029                             | 1.375          | 1.415          | 0,03                     |       |
| 8,150 % fällig am 10.06.2055                             | 11.300         | 11.714         | 0,25                     |       |
| Banco del Estado de Chile                                |                |                |                          |       |
| 7,950 % fällig am                                        |                |                |                          |       |
| 02.05.2029 (g)(i)                                        | 6.200          | 6.459          | 0,14                     |       |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile                        |                |                |                          |       |
| 4,500 % fällig am 01.08.2047                             | 3.200          | 2.503          | 0,05                     |       |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044                             | 4.900          | 4.100          | 0,09                     |       |
| 5,125 % fällig am 02.02.2033                             | 2.800          | 2.729          | 0,06                     |       |
| 5,950 % fällig am 08.01.2034                             | 5.450          | 5.567          | 0,12                     |       |
| 6,300 % fällig am 08.09.2053                             | 6.000          | 5.892          | 0,12                     |       |
| 6,330 % fällig am 13.01.2035                             | 7.000          | 7.282          | 0,15                     |       |
| 6,440 % fällig am 26.01.2036                             | 11.050         | 11.586         | 0,25                     |       |
| 6,780 % fällig am 13.01.2055                             | 2.200          | 2.259          | 0,05                     |       |
| 6,780 % fällig am 13.01.2055                             | 4.500          | 4.620          | 0,10                     |       |
| Embotelladora Andina S.A.                                |                |                |                          |       |
| 3,950 % fällig am 21.01.2050                             | 3.700          | 2.788          | 0,06                     |       |
| Empresa de los Ferrocarriles del Estado                  |                |                |                          |       |
| 3,068 % fällig am 18.08.2050                             | 1.500          | 889            | 0,02                     |       |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 3,830 % fällig am 14.09.2061                                      | \$ 6.600       |                          | 0,09                              | <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK<br/>STAATSEMISSIONEN</b> |                |                          |                                   | <b>GEORGIEN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.                     |                |                          |                                   | Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik       |                |                          |                                   | Georgian Railway JSC                                 |                |                          |                                   |
| 3,650 % fällig am 07.05.2030                                      | 600            | 570                      | 0,01                              | 13,000 % fällig am 05.12.2025 DOP                   | 100.100        | 1.669                    | 0,04                              | 4,000 % fällig am 17.06.2028                         | \$ 300         | 271                      | 0,01                              |
| 3,650 % fällig am 07.05.2030 (k)                                  | 1.400          | 1.331                    | 0,03                              | 13,000 % fällig am 30.01.2026                       | 126.800        | 2.112                    | 0,04                              |                                                      |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 25.01.2047                                      | 200            | 174                      | 0,00                              | Dominican Republic Government International Bond    |                |                          |                                   | <b>GHANA<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   |
| Empresa Nacional del Petroleo                                     |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 23.09.2032                        | \$ 10.400      | 9.629                    | 0,21                              | Ghana Government International Bond                  |                |                          |                                   |
| 3,450 % fällig am 16.09.2031                                      | 2.840          | 2.540                    | 0,05                              | 5,300 % fällig am 21.01.2041                        | 7.700          | 6.658                    | 0,14                              | 8,350 % fällig am 16.02.2027                         | GHS 23.100     | 1.916                    | 0,04                              |
| 4,500 % fällig am 14.09.2047                                      | 3.000          | 2.298                    | 0,05                              | 5,950 % fällig am 25.01.2027                        | 17.200         | 17.391                   | 0,37                              | 9,250 % fällig am 08.02.2033                         | 30.000         | 1.709                    | 0,04                              |
| 5,250 % fällig am 06.11.2029                                      | 5.900          | 5.955                    | 0,13                              | 6,000 % fällig am 19.07.2028                        | 12.400         | 12.617                   | 0,27                              | Ghana Government International Bond                  |                |                          |                                   |
| 5,950 % fällig am 30.07.2034                                      | 2.200          | 2.228                    | 0,05                              | 6,000 % fällig am 22.02.2033                        | 11.200         | 11.081                   | 0,24                              | 0,000 % fällig am 03.07.2026                         |                |                          |                                   |
| 6,150 % fällig am 10.05.2033                                      | 5.400          | 5.556                    | 0,12                              | 6,400 % fällig am 05.06.2049                        | 400            | 376                      | 0,01                              | (d)                                                  | \$ 1.239       | 1.204                    | 0,02                              |
| Engle Energia Chile S.A.                                          |                |                          |                                   | 6,800 % fällig am 01.06.2036                        | 1.950          | 1.966                    | 0,04                              | 0,000 % fällig am 03.01.2030                         |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 17.04.2034                                      | 2.600          | 2.699                    | 0,06                              | 6,950 % fällig am 15.03.2037                        | 9.000          | 9.163                    | 0,20                              | (d)                                                  | 2.654          | 2.225                    | 0,05                              |
| GNL Quintero S.A.                                                 |                |                          |                                   | 7,150 % fällig am 24.02.2055                        | 7.500          | 7.498                    | 0,16                              | 5,000 % fällig am 03.07.2029                         | 1.060          | 996                      | 0,02                              |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029                                      | 4.555          | 4.519                    | 0,09                              | 7,450 % fällig am 30.04.2044                        | 100            | 105                      | 0,00                              | 5,000 % fällig am 03.07.2029                         |                |                          |                                   |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.                           |                |                          |                                   | 10,500 % fällig am 15.03.2037 DOP2.023.450          | 34.425         | 34.425                   | 0,73                              | (k)                                                  | 27.735         | 26.068                   | 0,55                              |
| 5,500 % fällig am 10.09.2034                                      | 17.700         | 17.244                   | 0,37                              | 10,750 % fällig am 01.06.2036                       | 438.650        | 7.584                    | 0,16                              | 5,000 % fällig am 03.07.2035                         | 2.217          | 1.731                    | 0,04                              |
|                                                                   |                | 119.143                  | 2,54                              | 11,250 % fällig am 15.09.2035                       | 11.900         | 212                      | 0,00                              | Summe Ghana                                          |                | 35.849                   | 0,76                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                           |                |                          |                                   | 13,625 % fällig am 03.02.2033                       | 61.800         | 1.215                    | 0,03                              | <b>GUATEMALA<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                |                |                          |                                   |
| Chile Government International Bond                               |                |                          |                                   | 13,625 % fällig am 10.02.2034                       | 286.500        | 5.775                    | 0,12                              | Guatemala Government International Bond              |                |                          |                                   |
| 3,100 % fällig am 07.05.2041                                      | 3.000          | 2.238                    | 0,05                              | Summe Dominikanische Republik                       |                | 129.476                  | 2,76                              | 4,375 % fällig am 05.06.2027                         | 7.300          | 7.191                    | 0,15                              |
| (k)                                                               | 10.700         | 6.520                    | 0,14                              | <b>ECUADOR<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                 |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 03.05.2026                         | 7.900          | 7.840                    | 0,17                              |
| 3,250 % fällig am 21.09.2071                                      |                |                          |                                   | Ecuador Government International Bond               |                |                          |                                   | 4,650 % fällig am 07.10.2041                         | 800            | 638                      | 0,01                              |
| 4,340 % fällig am 07.03.2042                                      | 8.500          | 7.379                    | 0,15                              | 0,000 % fällig am 31.07.2030                        |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 13.02.2028                         | 9.820          | 9.726                    | 0,21                              |
| (k)                                                               |                | 16.137                   | 0,34                              | (d)                                                 | \$ 14.752      | 10.754                   | 0,23                              | 5,375 % fällig am 24.04.2032                         | 1.000          | 979                      | 0,02                              |
| Summe Chile                                                       |                | 135.280                  | 2,88                              | 5,000 % fällig am 31.07.2040                        |                |                          |                                   | 6,050 % fällig am 06.08.2031                         | 7.400          | 7.532                    | 0,16                              |
| <b>CHINA<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | (k)                                                 | 13.243         | 8.370                    | 0,18                              | 6,550 % fällig am 06.02.2037                         | 6.700          | 6.775                    | 0,14                              |
| Yango Justice International Ltd.                                  |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 31.07.2035                        | 24.865         | 18.164                   | 0,39                              | 6,600 % fällig am 13.06.2036                         | 7.700          | 7.829                    | 0,17                              |
| 7,500 % fällig am 15.04.2024 ^                                    | 4.700          | 8                        | 0,00                              | 5,500 % fällig am 31.07.2035                        | 1.519          | 1.110                    | 0,02                              | 8,125 % fällig am 06.10.2034                         | 1.708          | 1.902                    | 0,04                              |
| <b>KOLUMBIEN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                                   | 6,900 % fällig am 31.07.2030                        | 28.926         | 25.166                   | 0,53                              | Summe Guatemala                                      |                | 50.412                   | 1,07                              |
| Banco Davivienda S.A.                                             |                |                          |                                   | Ecuador Social Bond S.A.R.L.                        |                |                          |                                   | <b>HONGKONG<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| 8,125 % fällig am 02.07.2035                                      |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 30.01.2035                        |                |                          |                                   | AIA Group Ltd.                                       |                |                          |                                   |
| (a)(i)                                                            | 7.900          | 7.946                    | 0,17                              | (d)                                                 | 388            | 275                      | 0,01                              | 3,200 % fällig am 16.09.2040                         | 900            | 693                      | 0,01                              |
| Ecopetrol S.A.                                                    |                |                          |                                   | Summe Ecuador                                       |                | 63.839                   | 1,36                              | Fortune Star BVI Ltd.                                |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 29.04.2030                                      | 200            | 198                      | 0,00                              | <b>ÄGYPTEN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                 |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 02.10.2026                         | € 6.800        | 7.743                    | 0,16                              |
| 7,750 % fällig am 01.02.2032                                      | 16.800         | 16.521                   | 0,35                              | Egypt Government International Bond                 |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 18.05.2026                         | \$ 3.200       | 3.145                    | 0,07                              |
| 8,375 % fällig am 19.01.2036                                      | 22.800         | 22.013                   | 0,47                              | 4,750 % fällig am 16.04.2026                        | € 10.600       | 12.540                   | 0,27                              | 5,050 % fällig am 27.01.2027                         | 3.900          | 3.757                    | 0,08                              |
|                                                                   |                | 46.678                   | 0,99                              | 5,250 % fällig am 06.10.2025                        | \$ 700         | 699                      | 0,01                              | 8,500 % fällig am 19.05.2028                         | 7.000          | 7.048                    | 0,15                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                           |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 16.04.2030                        | € 1.670        | 1.815                    | 0,04                              | <b>MTR Corp. Ltd.</b>                                |                |                          |                                   |
| Colombia Government International Bond                            |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 11.04.2031                        | 29.900         | 32.644                   | 0,70                              | 5,250 % fällig am 01.04.2055                         | 20.000         | 19.611                   | 0,42                              |
| 3,000 % fällig am 30.01.2030                                      | 3.750          | 3.251                    | 0,07                              | 7,500 % fällig am 16.02.2061                        | \$ 4.200       | 3.063                    | 0,06                              |                                                      |                | 41.997                   | 0,89                              |
| 3,125 % fällig am 15.04.2031 (k)                                  | 6.207          | 5.112                    | 0,11                              | 7,903 % fällig am 21.02.2048                        | 19.500         | 14.996                   | 0,32                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 22.04.2032                                      | 3.300          | 2.618                    | 0,06                              | 8,150 % fällig am 20.11.2059                        | 2.400          | 1.853                    | 0,04                              | Hong Kong Government International Bond              |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 22.03.2026                                      | € 2.100        | 2.476                    | 0,05                              | 8,500 % fällig am 31.01.2047                        | 10.300         | 8.371                    | 0,18                              | 3,750 % fällig am 07.06.2032                         | € 7.200        | 8.857                    | 0,19                              |
| 3,875 % fällig am 15.02.2061 (k)                                  | \$ 12.300      | 6.510                    | 0,14                              | 8,625 % fällig am 04.02.2030                        | 3.800          | 3.846                    | 0,08                              | Summe Hongkong                                       |                | 50.854                   | 1,08                              |
| 4,125 % fällig am 15.05.2051                                      | 24.600         | 14.064                   | 0,30                              | 8,750 % fällig am 30.09.2051                        | 2.000          | 1.644                    | 0,03                              | <b>UNGARN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.03.2029 (k)                                  | 4.900          | 4.663                    | 0,10                              | 8,875 % fällig am 29.05.2050                        | 700            | 584                      | 0,01                              | MVM Energetika Zrt                                   |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045                                      | 3.400          | 2.302                    | 0,05                              | 9,450 % fällig am 04.02.2033                        |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 09.06.2028                         | \$ 5.500       | 5.797                    | 0,13                              |
| 5,200 % fällig am 15.05.2049                                      | 8.050          | 5.415                    | 0,11                              | (k)                                                 | 3.200          | 3.242                    | 0,07                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044                                      | 4.400          | 3.263                    | 0,07                              | 21,954 % fällig am 04.03.2028 EGP2.191.300          | 43.628         | 43.628                   | 0,93                              | Hungary Government International Bond                |                |                          |                                   |
| 7,375 % fällig am 18.09.2037                                      | 1.400          | 1.340                    | 0,03                              | Egyptian Financial Co. for Sovereign Taskeek        |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 21.09.2051                         | 2.500          | 1.480                    | 0,03                              |
| 7,500 % fällig am 02.02.2034                                      | 6.500          | 6.479                    | 0,14                              | 10,875 % fällig am 28.02.2026                       | \$ 19.600      | 20.134                   | 0,43                              | 4,000 % fällig am 25.07.2029                         | € 13.250       | 15.987                   | 0,34                              |
| 8,000 % fällig am 20.04.2033                                      |                |                          |                                   | Summe Ägypten                                       |                | 149.059                  | 3,17                              | 5,250 % fällig am 16.06.2029                         |                |                          |                                   |
| (k)                                                               | 5.000          | 5.180                    | 0,11                              | <b>EL SALVADOR<br/>STAATSEMISSIONEN</b>             |                |                          |                                   | (k)                                                  | \$ 12.200      | 12.314                   | 0,26                              |
| 8,000 % fällig am 14.11.2035                                      | 6.000          | 6.041                    | 0,13                              | El Salvador Government International Bond           |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 26.09.2030                         | 10.100         | 10.205                   | 0,22                              |
| 8,375 % fällig am 07.11.2054                                      | 7.600          | 7.241                    | 0,15                              | 7,125 % fällig am 20.01.2050                        | 219            | 183                      | 0,00                              | 5,500 % fällig am 16.06.2034                         | 700            | 688                      | 0,01                              |
| 8,500 % fällig am 25.04.2035                                      | 27.200         | 28.288                   | 0,60                              | 8,625 % fällig am 28.02.2029                        | 140            | 146                      | 0,00                              | 5,500 % fällig am 26.03.2036                         | 500            | 483                      | 0,01                              |
| 8,750 % fällig am 14.11.2053                                      | 6.100          | 6.056                    | 0,13                              | 9,250 % fällig am 17.04.2030                        | 250            | 265                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am 26.03.2036                         |                |                          |                                   |
|                                                                   |                | 110.299                  | 2,35                              | 9,500 % fällig am 15.07.2052                        | 1.400          | 1.440                    | 0,03                              | (k)                                                  | 8.800          | 8.500                    | 0,18                              |
| Summe Kolumbien                                                   |                | 156.977                  | 3,34                              | 9,650 % fällig am 21.11.2054                        | 1.000          | 1.033                    | 0,02                              | 6,000 % fällig am 26.09.2035                         | 6.100          | 6.138                    | 0,13                              |
| <b>COSTA RICA<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   | 9,650 % fällig am 21.11.2054                        | 9.500          | 9.809                    | 0,21                              | 6,125 % fällig am 22.05.2028                         |                |                          |                                   |
| Costa Rica Government International Bond                          |                |                          |                                   | Summe El Salvador                                   |                | 12.876                   | 0,27                              | (k)                                                  | 4.300          | 4.444                    | 0,09                              |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043                                      | 2.000          | 1.798                    | 0,04                              | <b>GABUN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 22.09.2032                         |                |                          |                                   |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | Gabon Government International Bond                 |                |                          |                                   | (k)                                                  | 4.300          | 4.496                    | 0,10                              |
| Czechoslovak Group A/S                                            |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 06.02.2031                        | 400            | 319                      | 0,01                              | 6,750 % fällig am 25.09.2052                         |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 10.01.2031                                      | € 1.200        | 1.436                    | 0,03                              | 9,500 % fällig am 18.02.2029                        | 16.100         | 14.750                   | 0,31                              | (k)                                                  | 3.700          | 3.775                    | 0,08                              |
| (a)                                                               |                |                          |                                   | Summe Gabun                                         |                | 15.069                   | 0,32                              | 6,750 % fällig am 23.09.2055                         | 6.400          | 6.455                    | 0,14                              |
| EPH Financing International A/S                                   |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   | 7,625 % fällig am 29.03.2041                         | 4.400          | 4.971                    | 0,11                              |
| 5,875 % fällig am 30.11.2029                                      | 6.000          | 7.535                    | 0,16                              |                                                     |                |                          |                                   | Magyar Export-Import Bank                            |                |                          |                                   |
| 6,651 % fällig am 13.11.2028                                      | 5.400          | 6.884                    | 0,15                              |                                                     |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 16.05.2029                         | € 8.950        | 11.351                   | 0,24                              |
| Summe Tschechische Republik                                       |                | 15.855                   | 0,34                              |                                                     |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 04.12.2027                         | \$ 5.500       | 5.633                    | 0,12                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   | <b>MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt</b>               |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 29.06.2028                         | 13.900         | 14.415                   | 0,31                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |                                                      |                | 111.335                  | 2,37                              |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   | Summe Ungarn                                         |                | 117.132                  | 2,50                              |



| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>INDIEN</b>                              |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | <b>JAMAICA</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>         |                |                          |                                   |
| IIFL Finance Ltd.                          |                |                          |                                   | Iridium Capital PLC                       | € 20.700       | \$ 26.364                | 0,55                              | TransJamaican Highway Ltd.                      |                |                          |                                   |
| 8,750 % fällig am 24.07.2028               | \$ 300         | \$ 302                   | 0,01                              | Lion RE DAC                               | 250            | 294                      | 0,01                              | 5,750 % fällig am 10.10.2036                    | \$ 3.132       | \$ 2.912                 | 0,06                              |
| 8,750 % fällig am 24.07.2028               | 6.000          | 6.041                    | 0,13                              | 6,409 % fällig am 16.07.2025              |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.         |                |                          |                                   | Quercus Re DAC                            | 250            | 301                      | 0,01                              |                                                 |                |                          |                                   |
| 7,110 % fällig am 11.03.2032               | 7.500          | 7.528                    | 0,16                              | 10,176 % fällig am 06.01.2031             |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| Reliance Industries Ltd.                   |                |                          |                                   | Windmill Re DAC                           | 250            | 296                      | 0,01                              |                                                 |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 12.01.2032               | 2.400          | 2.133                    | 0,04                              | 7,599 % fällig am 05.07.2028              |                | 35.759                   | 0,76                              |                                                 |                |                          |                                   |
| Summe Indien                               |                | 16.004                   | 0,34                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| <b>INDONESIEN</b>                          |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   | <b>JORDANIEN</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                         |                |                          |                                   |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT                | 10.900         | 10.969                   | 0,23                              | Republic of Panama                        | 22.400         | 26.484                   | 0,57                              | Jordan Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 4,900 % fällig am 24.03.2028               |                |                          |                                   | 4,103 % fällig am 05.03.2027              |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 07.07.2025                    | 2.200          | 2.197                    | 0,05                              |
| Freeport Indonesia PT                      | 8.975          | 8.814                    | 0,19                              |                                           |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 31.01.2027                    | 2.400          | 2.389                    | 0,05                              |
| 6,200 % fällig am 14.04.2052 (k)           |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 29.01.2026                    | 5.350          | 5.343                    | 0,11                              |
| Indonesia Asahan Aluminium PT              | 7.800          | 7.944                    | 0,17                              |                                           |                |                          |                                   | Summe Jordanien                                 |                | 9.929                    | 0,21                              |
| 5,450 % fällig am 15.05.2030               | 1.800          | 1.682                    | 0,04                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,800 % fällig am 15.05.2050               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| LLPL Capital Pte. Ltd.                     | 1.600          | 1.633                    | 0,04                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| Pelabuhan Indonesia Persero PT             | 3.693          | 3.430                    | 0,07                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| Pertamina Hulu Energi PT                   | 10.200         | 10.310                   | 0,22                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 21.05.2030               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| Pertamina Persero PT                       | 11.000         | 10.862                   | 0,23                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 03.05.2042               | 8.200          | 8.419                    | 0,18                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,450 % fällig am 30.05.2044               | 2.900          | 2.978                    | 0,06                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| Listrik Negara                             | 23.800         | 16.778                   | 0,36                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 30.06.2050               | 5.800          | 4.414                    | 0,09                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 05.02.2050               | 2.300          | 2.053                    | 0,04                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 24.10.2042               | 12.300         | 10.665                   | 0,23                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 15.05.2047               | 5.800          | 5.655                    | 0,12                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,150 % fällig am 21.05.2048               | 10.500         | 10.381                   | 0,22                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 25.01.2049               |                | 116.987                  | 2,49                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | <b>ISRAEL</b>                             |                |                          |                                   | <b>KENIA</b>                                    |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>       |                |                          |                                   |
| Indonesia Government International Bond    | € 10.100       | 12.099                   | 0,26                              | Bank Hapoalim B.M.                        | 3.400          | 3.258                    | 0,07                              | Republik Kenia                                  | 6.200          | 6.185                    | 0,13                              |
| 3,875 % fällig am 15.01.2033               | 12.700         | 15.103                   | 0,32                              | 3,255 % fällig am 21.01.2032 (i)          |                |                          |                                   | 9,849 % fällig am 05.04.2028                    |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 15.01.2037               | \$ 200         | 194                      | 0,00                              | ICL Group Ltd.                            | 11.000         | 11.122                   | 0,23                              |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,350 % fällig am 11.02.2049               | 800            | 793                      | 0,02                              | 6,375 % fällig am 31.05.2038              |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,650 % fällig am 11.01.2053               | 100            | 112                      | 0,00                              | Israel Electric Corp. Ltd.                | 4.800          | 4.674                    | 0,10                              |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 17.02.2037               | 2.300          | 2.575                    | 0,05                              | 4,250 % fällig am 14.08.2028              |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044               | 1.000          | 1.217                    | 0,03                              | Leviathan Bond Ltd.                       | 5.600          | 5.577                    | 0,12                              |                                                 |                |                          |                                   |
| 7,750 % fällig am 17.01.2038               |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 30.06.2027              |                | 24.631                   | 0,52                              |                                                 |                |                          |                                   |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia         | 6.600          | 4.931                    | 0,11                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 3,800 % fällig am 23.06.2050               | 900            | 886                      | 0,02                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| 5,650 % fällig am 25.11.2054               |                | 37.910                   | 0,81                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| Summe Indonesien                           |                | 154.897                  | 3,30                              |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| <b>INTERNATIONAL</b>                       |                |                          |                                   | <b>ITALIEN</b>                            |                |                          |                                   | <b>LETTLAND</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>  |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                         |                |                          |                                   |
| Project Mercury                            | € 11.700       | 14.184                   | 0,30                              | Cassa Depositi e Prestiti SpA             | 3.000          | 3.140                    | 0,07                              | Republic of Kenya Government International Bond | 4.500          | 4.426                    | 0,09                              |
| 0,400 % - 6,668 % fällig am                |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 28.02.2028                    | 1.900          | 1.781                    | 0,04                              |
| 11.08.2030                                 |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 22.05.2032                    | 19.100         | 18.040                   | 0,38                              |
| Republik Senegal                           | 9.400          | 9.675                    | 0,21                              |                                           |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 05.03.2036                    | 14.100         | 14.335                   | 0,31                              |
| TBD % fällig am 22.12.2028                 |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 16.02.2031                    |                | 38.582                   | 0,82                              |
| Summe International                        |                | 23.859                   | 0,51                              |                                           |                |                          |                                   | Summe Kenia                                     |                | 44.767                   | 0,95                              |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| <b>IRAK</b>                                |                |                          |                                   | <b>ELFENBEINKÜSTE</b>                     |                |                          |                                   | <b>LIBANON</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                         |                |                          |                                   |
| Iraq Government International Bond         | \$ 2.138       | 2.119                    | 0,04                              | Republik Elfenbeinküste                   | € 25.000       | 29.238                   | 0,62                              | Lebanon Government International Bond           | 5.000          | 940                      | 0,02                              |
| 5,800 % fällig am 15.01.2028               |                |                          |                                   | TBD % fällig am 06.03.2026                | 7.150          | 8.326                    | 0,18                              | 5,800 % fällig am 14.04.2020 ^                  | 6.000          | 1.127                    | 0,03                              |
|                                            |                |                          |                                   | TBD % fällig am 18.03.2026                |                | 37.564                   | 0,80                              | 6,100 % fällig am 04.10.2022 ^                  | 2.700          | 508                      | 0,01                              |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 09.03.2020 ^                  | 15.700         | 2.967                    | 0,06                              |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 6,400 % fällig am 26.05.2023 ^                  | 8.300          | 1.562                    | 0,03                              |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 12.04.2021 ^                  | 11.500         | 2.196                    | 0,05                              |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 17.05.2034 ^                  |                | 9.300                    | 0,20                              |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | Summe Libanon                                   |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |
| <b>IRLAND</b>                              |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | <b>LUXEMBURG</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | <b>STAMMAKTIONEN</b>                            |                |                          |                                   |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC    | 6.600          | 396                      | 0,01                              | Ivory Coast Government International Bond | 8.119          | 8.556                    | 0,18                              | DrillCo Holding Lux S.A. (j)                    | 364.034        | 7.463                    | 0,16                              |
| 5,950 % fällig am 15.04.2030 ^ (i)         |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 30.01.2032              | 3.594          | 4.041                    | 0,09                              | Foresea Holding S.A. 'A'                        | 143.033        | 2.932                    | 0,06                              |
| CIMA Finance DAC                           | 8.815          | 8.108                    | 0,17                              | 5,250 % fällig am 22.03.2030              | 3.070          | 3.414                    | 0,07                              |                                                 |                | 10.395                   | 0,22                              |
| 2,950 % fällig am 05.09.2029               |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 17.10.2031              | 1.300          | 1.195                    | 0,03                              |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 22.03.2048              | 7.300          | 7.305                    | 0,16                              |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 17.10.2040              | \$ 4.000       | 3.955                    | 0,08                              |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 7,625 % fällig am 30.01.2033              | 7.900          | 7.635                    | 0,16                              |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | 8,075 % fällig am 01.04.2036              |                | 36.101                   | 0,77                              |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   | Summe Elfenbeinküste                      |                | 73.665                   | 1,57                              |                                                 |                |                          |                                   |
|                                            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |                                                 |                |                          |                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES | BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                              |                |                          |                          |       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |                |                          |                          |       |
| Chile Electricity Lux MPC SARL                |                |                          |                          |       | 6,625 % fällig am 15.06.2035                                         | \$ 7.429       | \$ 7.441                 | 0,16                     | 0,13  | Nigeria                                      |                |                          |                          |       |
| 5,580 % fällig am 20.10.2035                  |                |                          |                          |       | 6,625 % fällig am 15.06.2038                                         | 200            | 156                      | 0,00                     | 0,00  | BOI Finance BV                               |                |                          |                          |       |
| 5,672 % fällig am 20.10.2035                  |                |                          |                          |       | 6,700 % fällig am 16.02.2032                                         | 17.458         | 16.235                   | 0,35                     | 0,35  | 7,500 % fällig am 16.02.2027                 | € 15.300       | \$18.332                 | 0,39                     | 0,39  |
| 6,010 % fällig am 20.01.2033                  |                |                          |                          |       | 6,750 % fällig am 21.09.2047                                         | 17.580         | 12.744                   | 0,27                     | 0,27  | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>    |                |                          |                          |       |
| FORESEA Holding S.A.                          |                |                          |                          |       | 6,840 % fällig am 23.01.2030                                         | 278            | 269                      | 0,01                     | 0,01  | Bank of Industry Ltd.                        |                |                          |                          |       |
| 7,500 % fällig am 15.06.2030                  |                |                          |                          |       | 6,950 % fällig am 28.01.2060                                         | 28.147         | 20.244                   | 0,43                     | 0,43  | 3,695 % fällig am 23.08.2027                 | 10.900         | 12.710                   | 0,27                     | 0,27  |
| Greensaif Pipelines Bidco SARL                |                |                          |                          |       | 7,690 % fällig am 23.01.2050                                         | 60.436         | 47.576                   | 1,01                     | 1,01  | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                          |       |
| 5,853 % fällig am 23.02.2036                  |                |                          |                          |       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                              |                |                          |                          |       | Nigeria Government International Bond        |                |                          |                          |       |
| 6,103 % fällig am 23.08.2042                  |                |                          |                          |       | Mexico Government International Bond                                 |                |                          |                          |       | 6,125 % fällig am 28.09.2028                 | \$ 18.230      | 17.463                   | 0,37                     | 0,37  |
| 6,129 % fällig am 23.02.2038                  |                |                          |                          |       | 3,000 % fällig am 03.12.2026 (f) MXN                                 | 618.726        | 32.077                   | 0,68                     | 0,68  | 6,500 % fällig am 28.11.2027                 | 3.744          | 3.722                    | 0,08                     | 0,08  |
| 6,510 % fällig am 23.02.2042                  |                |                          |                          |       | 3,750 % fällig am 19.04.2071                                         | \$ 15.100      | 8.595                    | 0,18                     | 0,18  | 7,375 % fällig am 28.09.2033                 | 3.500          | 3.134                    | 0,07                     | 0,07  |
| 6,510 % fällig am 23.02.2042 (k)              |                |                          |                          |       | 3,771 % fällig am 24.05.2061                                         | 8.600          | 5.101                    | 0,11                     | 0,11  | 7,625 % fällig am 21.11.2025                 | 7.400          | 7.464                    | 0,16                     | 0,16  |
| Guara Norte SARL                              |                |                          |                          |       | 4,875 % fällig am 19.05.2033                                         | 33.750         | 31.917                   | 0,68                     | 0,68  | 7,625 % fällig am 28.11.2047                 | 8.946          | 7.124                    | 0,15                     | 0,15  |
| 5,198 % fällig am 15.06.2034                  |                |                          |                          |       | 5,000 % fällig am 27.04.2051                                         | 6.800          | 5.290                    | 0,11                     | 0,11  | 8,250 % fällig am 28.09.2051                 | 2.700          | 2.245                    | 0,05                     | 0,05  |
| Petrorio Luxembourg Holding SARL              |                |                          |                          |       | 5,750 % fällig am 12.10.2110                                         | 49.850         | 39.456                   | 0,84                     | 0,84  |                                              |                |                          |                          |       |
| 6,125 % fällig am 09.06.2026                  |                |                          |                          |       | 5,850 % fällig am 02.07.2032 (a)                                     | 6.800          | 6.890                    | 0,15                     | 0,15  |                                              |                |                          |                          |       |
| Raizen Fuels Finance S.A.                     |                |                          |                          |       | 6,000 % fällig am 07.05.2036                                         | 5.400          | 5.343                    | 0,12                     | 0,12  | Summe Nigeria                                |                |                          |                          |       |
| 6,250 % fällig am 08.07.2032 (a)              |                |                          |                          |       | 6,050 % fällig am 11.01.2040                                         | 1.500          | 1.435                    | 0,03                     | 0,03  |                                              |                |                          |                          |       |
| 6,450 % fällig am 05.03.2034                  |                |                          |                          |       | 6,338 % fällig am 04.05.2053                                         | 900            | 828                      | 0,02                     | 0,02  | <b>OMAN</b>                                  |                |                          |                          |       |
| 6,950 % fällig am 05.03.2054                  |                |                          |                          |       | 6,350 % fällig am 09.02.2035                                         | 9.600          | 9.846                    | 0,21                     | 0,21  | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                          |       |
| Saavi Energia SARL                            |                |                          |                          |       | 6,400 % fällig am 07.05.2054                                         | 10.800         | 9.969                    | 0,21                     | 0,21  | Oman Government International Bond           |                |                          |                          |       |
| 8,875 % fällig am 10.02.2035                  |                |                          |                          |       | 6,625 % fällig am 29.01.2038 (a)                                     | 6.800          | 6.912                    | 0,15                     | 0,15  | 5,625 % fällig am 17.01.2028                 | 12.290         | 12.575                   | 0,27                     | 0,27  |
| Virtuof Finance SARL                          |                |                          |                          |       | 6,875 % fällig am 13.05.2037                                         | 32.500         | 33.976                   | 0,72                     | 0,72  | 6,000 % fällig am 01.08.2029                 | 11.500         | 12.073                   | 0,26                     | 0,26  |
| 7,930 % fällig am 12.01.2034                  | € 10.300       | 12.106                   | 0,26                     | 0,26  | 7,375 % fällig am 13.05.2055                                         | 13.900         | 14.383                   | 0,31                     | 0,31  | 6,250 % fällig am 25.01.2031                 | 7.000          | 7.443                    | 0,16                     | 0,16  |
|                                               |                | 106.439                  | 2,27                     | 2,27  |                                                                      |                | 212.018                  | 4,52                     | 4,52  | 6,500 % fällig am 08.03.2047                 | 3.473          | 3.525                    | 0,07                     | 0,07  |
| Summe Luxemburg                               |                | 116.834                  | 2,49                     | 2,49  | Summe Mexiko                                                         |                | 398.846                  | 8,50                     | 8,50  | 6,750 % fällig am 28.10.2027                 | 14.800         | 15.506                   | 0,33                     | 0,33  |
| <b>MAZEDONIEN</b>                             |                |                          |                          |       | <b>MONGOLEI</b>                                                      |                |                          |                          |       | 6,750 % fällig am 17.01.2048                 | 4.300          | 4.449                    | 0,09                     | 0,09  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                          |       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                              |                |                          |                          |       | 7,000 % fällig am 25.01.2051                 | 3.050          | 3.248                    | 0,07                     | 0,07  |
| North Macedonia Government International Bond |                |                          |                          |       | City of Ulaanbaatar Mongolia                                         |                |                          |                          |       | Summe Oman                                   |                |                          |                          |       |
| 6,960 % fällig am 13.03.2027                  | 7.100          | 8.745                    | 0,19                     | 0,19  | 7,750 % fällig am 21.08.2027                                         | 17.500         | 17.578                   | 0,37                     | 0,37  |                                              |                |                          |                          |       |
| <b>MALAYSIA</b>                               |                |                          |                          |       | <b>MAROKKO</b>                                                       |                |                          |                          |       | <b>PAKISTAN</b>                              |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                              |                |                          |                          |       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                          |       |
| Axiata SPV2 Bhd.                              |                |                          |                          |       | OCP S.A.                                                             |                |                          |                          |       | Pakistan Government International Bond       |                |                          |                          |       |
| 2,163 % fällig am 19.08.2030                  | \$ 1.900       | 1.696                    | 0,04                     | 0,04  | 3,750 % fällig am 23.06.2031                                         | 8.650          | 7.767                    | 0,17                     | 0,17  | 6,000 % fällig am 08.04.2026                 | 14.827         | 14.617                   | 0,31                     | 0,31  |
| Khazanah Capital Ltd.                         |                |                          |                          |       | 5,125 % fällig am 23.06.2051                                         | 14.700         | 11.179                   | 0,24                     | 0,24  | 8,250 % fällig am 30.09.2025 (k)             | 38.127         | 38.097                   | 0,81                     | 0,81  |
| 4,876 % fällig am 01.06.2033                  | 4.900          | 4.914                    | 0,10                     | 0,10  | 6,700 % fällig am 01.03.2036                                         | 6.200          | 6.242                    | 0,13                     | 0,13  | Pakistan Water & Power Development Authority |                |                          |                          |       |
| Petronas Capital Ltd.                         |                |                          |                          |       | Summe Marokko                                                        |                | 25.188                   | 0,54                     | 0,54  | 7,500 % fällig am 04.06.2031                 | 7.520          | 6.057                    | 0,13                     | 0,13  |
| 4,500 % fällig am 18.03.2045                  | 400            | 345                      | 0,01                     | 0,01  | <b>NAMIBIA</b>                                                       |                |                          |                          |       | Summe Pakistan                               |                |                          |                          |       |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050                  | 8.600          | 7.293                    | 0,15                     | 0,15  | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                              |                |                          |                          |       |                                              |                |                          |                          |       |
| Summe Malaysia                                |                | 14.248                   | 0,30                     | 0,30  | Namibia Government International Bond                                |                |                          |                          |       | <b>PANAMA</b>                                |                |                          |                          |       |
| <b>AKTIEN</b>                                 |                |                          |                          |       | 5,250 % fällig am 29.10.2025                                         | 15.682         | 15.569                   | 0,33                     | 0,33  | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |                |                          |                          |       |
| <b>MEXIKO</b>                                 |                |                          |                          |       | <b>AKTIEN</b>                                                        |                |                          |                          |       | Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.     |                |                          |                          |       |
| <b>STAMMAKTIEN</b>                            |                |                          |                          |       | <b>NIEDERLANDE</b>                                                   |                |                          |                          |       | 5,125 % fällig am 11.08.2061                 | 6.700          | 4.724                    | 0,10                     | 0,10  |
| Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. (c)        | 39.443         | 0                        | 0,00                     | 0,00  | <b>STAMMAKTIEN</b>                                                   |                |                          |                          |       | Banco General S.A.                           |                |                          |                          |       |
|                                               |                |                          |                          |       | Stichting Administratiekan Holding (c)                               | 13.638         | 0                        | 0,00                     | 0,00  | 5,250 % fällig am 07.05.2031 (g)(i)          | 7.400          | 6.679                    | 0,14                     | 0,14  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                          |       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                              |                |                          |                          |       | Banco Nacional de Panamá                     |                |                          |                          |       |
| Banco Mercantil del Norte S.A.                |                |                          |                          |       | Prosus NV                                                            |                |                          |                          |       | 2,500 % fällig am 11.08.2030                 | 1.300          | 1.090                    | 0,02                     | 0,02  |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (g)(i)           | \$ 4.100       | 3.807                    | 0,08                     | 0,08  | 2,031 % fällig am 03.08.2032                                         | € 1.200        | 1.259                    | 0,03                     | 0,03  | Empresa de Transmision Electrica S.A.        |                |                          |                          |       |
| 8,375 % fällig am 20.05.2031 (g)(i)           | 7.200          | 7.302                    | 0,16                     | 0,16  | 3,257 % fällig am 19.01.2027                                         | \$ 2.400       | 2.351                    | 0,05                     | 0,05  | 5,125 % fällig am 02.05.2049                 | 6.800          | 4.910                    | 0,11                     | 0,11  |
| 8,750 % fällig am 20.05.2035 (g)(i)           | 7.200          | 7.280                    | 0,16                     | 0,16  | 3,832 % fällig am 08.02.2051                                         | 1.900          | 1.223                    | 0,03                     | 0,03  |                                              |                |                          |                          |       |
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC       |                |                          |                          |       | 4,027 % fällig am 03.08.2050                                         | 1.600          | 1.071                    | 0,02                     | 0,02  |                                              |                |                          |                          |       |
| 5,875 % fällig am 07.05.2030                  | 9.900          | 10.055                   | 0,21                     | 0,21  | Unigel Netherlands Holding Corp. BV (15,000 % bar oder 15,000 % PIK) |                |                          |                          |       |                                              |                |                          |                          |       |
| BBVA Bancomer S.A.                            |                |                          |                          |       | 15,000 % fällig am 31.12.2044 ^ (b)                                  | 3.022          | 98                       | 0,00                     | 0,00  |                                              |                |                          |                          |       |
| 7,625 % fällig am 11.02.2035 (i)              | 11.900         | 12.248                   | 0,26                     | 0,26  | Yinson Bergenia Production BV                                        |                |                          |                          |       |                                              |                |                          |                          |       |
| 8,450 % fällig am 29.06.2038 (i)(k)           | 2.400          | 2.540                    | 0,05                     | 0,05  | 8,498 % fällig am 31.01.2045 (a)                                     | 10.400         | 10.539                   | 0,22                     | 0,22  |                                              |                |                          |                          |       |
| Corp. GEO S.A.B. de C.V.                      |                |                          |                          |       | Yinson Boronia Production BV                                         |                |                          |                          |       |                                              |                |                          |                          |       |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^                | 13.920         | 0                        | 0,00                     | 0,00  | 8,947 % fällig am 31.07.2042                                         | 7.236          | 7.710                    | 0,16                     | 0,16  |                                              |                |                          |                          |       |
| 9,250 % fällig am 30.06.2020 ^                | 1.000          | 0                        | 0,00                     | 0,00  | 8,947 % fällig am 31.07.2042                                         | 297            | 317                      | 0,01                     | 0,01  |                                              |                |                          |                          |       |
| Industrias Penoles S.A.B. de C.V.             |                |                          |                          |       |                                                                      |                | 24.568                   | 0,52                     | 0,52  |                                              |                |                          |                          |       |
| 4,750 % fällig am 06.08.2050                  | 3.700          | 2.829                    | 0,06                     | 0,06  | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                            |                |                          |                          |       |                                              |                |                          |                          |       |
| Minera Mexico S.A. de C.V.                    |                |                          |                          |       | Veon Amsterdam                                                       |                |                          |                          |       |                                              |                |                          |                          |       |
| 5,625 % fällig am 12.02.2032                  | 3.300          | 3.360                    | 0,07                     | 0,07  | 8,531 % - 10,750 % fällig am 25.03.2027                              | 16.300         | 16.306                   | 0,35                     | 0,35  |                                              |                |                          |                          |       |
| Petroleos Mexicanos                           |                |                          |                          |       | Summe Niederlande                                                    |                | 40.874                   | 0,87                     | 0,87  |                                              |                |                          |                          |       |
| 3,625 % fällig am 24.11.2025                  | € 1.400        | 1.634                    | 0,04                     | 0,04  |                                                                      |                |                          |                          |       | <b>PARAGUAY</b>                              |                |                          |                          |       |
| 4,875 % fällig am 21.02.2028                  | 1.300          | 1.493                    | 0,03                     | 0,03  |                                                                      |                |                          |                          |       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                          |       |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048                  | \$ 27.367      | 19.073                   | 0,41                     | 0,41  |                                                                      |                |                          |                          |       | Paraguay Government International Bond       |                |                          |                          |       |
| 6,375 % fällig am 23.01.2045                  | 13.250         | 9.394                    | 0,20                     | 0,20  |                                                                      |                |                          |                          |       | 2,739 % fällig am 29.01.2033                 | 1.900          | 1.623                    | 0,03                     | 0,03  |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041                  | 3.100          | 2.305                    | 0,05                     | 0,05  |                                                                      |                |                          |                          |       |                                              |                |                          |                          |       |

|                                              |  | PARI | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                                            | PARI | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |  | PARI                                          | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |  |  |
|----------------------------------------------|--|------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------|------|--------------------------|-----------------------------------|--|-----------------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|--|--|
| BESCHREIBUNG                                 |  |      |                          |                                   | BESCHREIBUNG                               |      |                          |                                   |  | BESCHREIBUNG                                  |                          |                                   |  |  |
| 3,849 % fällig am 28.06.2033                 |  |      |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                           |      |                          |                                   |  | SENEGAL                                       |                          |                                   |  |  |
| 4,700 % fällig am 27.03.2027                 |  |      |                          |                                   | Bank Gospodarstwa Krajowego                |      |                          |                                   |  | STAATSEMISSIONEN                              |                          |                                   |  |  |
| 5,400 % fällig am 30.03.2050                 |  |      |                          |                                   | 6,250 % fällig am 09.07.2054               |      |                          |                                   |  | Senegal Government International Bond         |                          |                                   |  |  |
| 5,850 % fällig am 21.08.2033                 |  |      |                          |                                   | Poland Government International Bond       |      |                          |                                   |  | 4,750 % fällig am 13.03.2028                  |                          |                                   |  |  |
| 6,000 % fällig am 09.02.2036                 |  |      |                          |                                   | 4,125 % fällig am 11.01.2044               |      |                          |                                   |  | 5,375 % fällig am 08.06.2037                  |                          |                                   |  |  |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044                 |  |      |                          |                                   | (k)                                        |      |                          |                                   |  | Summe Senegal                                 |                          |                                   |  |  |
| 6,650 % fällig am 04.03.2055                 |  |      |                          |                                   | 4,875 % fällig am 12.02.2030               |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
| 7,900 % fällig am 09.02.2031                 |  |      |                          |                                   | 4,875 % fällig am 04.10.2033               |      |                          |                                   |  | SERBIEN                                       |                          |                                   |  |  |
| 8,500 % fällig am 04.03.2035                 |  |      |                          |                                   | 5,375 % fällig am 12.02.2035 (k)           |      |                          |                                   |  | STAATSEMISSIONEN                              |                          |                                   |  |  |
| Summe Paraguay                               |  |      |                          |                                   | 5,500 % fällig am 04.04.2053 (k)           |      |                          |                                   |  | Serbia Government International Bond          |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   | 5,500 % fällig am 18.03.2054 (k)           |      |                          |                                   |  | 1,500 % fällig am 26.06.2029                  |                          |                                   |  |  |
| PERU                                         |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 2,125 % fällig am 01.12.2030                  |                          |                                   |  |  |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 6,000 % fällig am 12.06.2034                  |                          |                                   |  |  |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |  |      |                          |                                   | Summe Polen                                |      |                          |                                   |  | 6,250 % fällig am 26.05.2028                  |                          |                                   |  |  |
| 9,700 % fällig am 05.03.2045                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 6,500 % fällig am 26.09.2033                  |                          |                                   |  |  |
| 10,100 % fällig am 15.12.2043                |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 6,500 % fällig am 26.09.2033 (k)              |                          |                                   |  |  |
| InRetail Consumer                            |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Summe Serbien                                 |                          |                                   |  |  |
| 3,250 % fällig am 22.03.2028                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
| Kallpa Generacion S.A.                       |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | SINGAPUR                                      |                          |                                   |  |  |
| 5,875 % fällig am 30.01.2032                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL              |                          |                                   |  |  |
| 5,875 % fällig am 30.01.2032 (k)             |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Cathaylife Singapore Pte Ltd.                 |                          |                                   |  |  |
| Niagara Energy SAC                           |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 5,950 % fällig am 05.07.2034                  |                          |                                   |  |  |
| 5,746 % fällig am 03.10.2034                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Flex Ltd.                                     |                          |                                   |  |  |
| Petroleos del Peru S.A.                      |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 4,875 % fällig am 15.06.2029                  |                          |                                   |  |  |
| 4,750 % fällig am 19.06.2032                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Yinson Production Financial Services Pte Ltd. |                          |                                   |  |  |
| 5,625 % fällig am 19.06.2047                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 9,625 % fällig am 03.05.2029                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Summe Singapur                                |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
| STAATSEMISSIONEN                             |  |      |                          |                                   | Summe Katar                                |      |                          |                                   |  | SLOWENIEN                                     |                          |                                   |  |  |
| Corp. Financiera de Desarrollo S.A.          |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | STAATSEMISSIONEN                              |                          |                                   |  |  |
| 2,400 % fällig am 28.09.2027                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Slovenia Government International Bond        |                          |                                   |  |  |
| Fondo MIVIVIENDA S.A.                        |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 5,000 % fällig am 19.09.2033                  |                          |                                   |  |  |
| 4,625 % fällig am 12.04.2027                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
| Peru Government International Bond           |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | SÜDAFRIKA                                     |                          |                                   |  |  |
| 3,230 % fällig am 28.07.2121                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL              |                          |                                   |  |  |
| 3,600 % fällig am 15.01.2072                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Eskom Holdings SOC Ltd.                       |                          |                                   |  |  |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 4,314 % fällig am 23.07.2027                  |                          |                                   |  |  |
| 5,500 % fällig am 30.03.2036                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 6,350 % fällig am 10.08.2028                  |                          |                                   |  |  |
| 5,875 % fällig am 08.08.2054                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 8,450 % fällig am 10.08.2028                  |                          |                                   |  |  |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Sasol Financing USA LLC                       |                          |                                   |  |  |
| 6,200 % fällig am 30.06.2055                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 8,750 % fällig am 03.05.2029                  |                          |                                   |  |  |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG            |                          |                                   |  |  |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Transnet SOC Ltd.                             |                          |                                   |  |  |
| 8,750 % fällig am 21.11.2033                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 11,558 % fällig am 02.03.2028                 |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | ZAR                                           |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
| Summe Peru                                   |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | STAATSEMISSIONEN                              |                          |                                   |  |  |
| PHILIPPINEN                                  |  |      |                          |                                   | RUSSLAND                                   |      |                          |                                   |  | South Africa Government International Bond    |                          |                                   |  |  |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |  |      |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                           |      |                          |                                   |  | 4,300 % fällig am 12.10.2028                  |                          |                                   |  |  |
| Bank of the Philippine Islands               |  |      |                          |                                   | Russia Government International Bond       |      |                          |                                   |  | 4,850 % fällig am 30.09.2029                  |                          |                                   |  |  |
| 5,000 % fällig am 07.04.2030 (k)             |  |      |                          |                                   | 7,500 % fällig am 31.03.2030               |      |                          |                                   |  | 5,000 % fällig am 12.10.2046                  |                          |                                   |  |  |
| 5,625 % fällig am 07.04.2035                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 5,375 % fällig am 24.07.2044                  |                          |                                   |  |  |
| San Miguel Global Power Holdings Corp.       |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 5,750 % fällig am 30.09.2049                  |                          |                                   |  |  |
| 8,125 % fällig am 02.12.2029 (g)             |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 7,100 % fällig am 19.11.2036                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 7,300 % fällig am 20.04.2052                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | (k)                                           |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 7,950 % fällig am 19.11.2054                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 8,500 % fällig am 31.01.2037                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 8,875 % fällig am 28.02.2035                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 62.606                                        |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 1,33                                          |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Summe Südafrika                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 106.728                                       |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 2,27                                          |                          |                                   |  |  |
| STAATSEMISSIONEN                             |  |      |                          |                                   | SÜDKOREA                                   |      |                          |                                   |  | Mirae Asset Securities Co. Ltd.               |                          |                                   |  |  |
| Philippines Government International Bond    |  |      |                          |                                   | Saudi Arabia Government International Bond |      |                          |                                   |  | 6,000 % fällig am 26.01.2029                  |                          |                                   |  |  |
| 2,650 % fällig am 10.12.2045                 |  |      |                          |                                   | 3,250 % fällig am 22.10.2030               |      |                          |                                   |  | \$                                            |                          |                                   |  |  |
| 2,950 % fällig am 05.05.2045                 |  |      |                          |                                   | 3,450 % fällig am 02.02.2061               |      |                          |                                   |  | 800                                           |                          |                                   |  |  |
| 3,700 % fällig am 01.03.2041                 |  |      |                          |                                   | 3,750 % fällig am 21.01.2055               |      |                          |                                   |  | 831                                           |                          |                                   |  |  |
| 6,375 % fällig am 23.10.2034                 |  |      |                          |                                   | 4,500 % fällig am 26.10.2046               |      |                          |                                   |  | 0,02                                          |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   | 4,625 % fällig am 04.10.2047               |      |                          |                                   |  | SK Hynix, Inc.                                |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   | 5,375 % fällig am 13.01.2031               |      |                          |                                   |  | 6,500 % fällig am 17.01.2033                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   | 5,625 % fällig am 13.01.2035               |      |                          |                                   |  | 12.100                                        |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   | 5,625 % fällig am 13.01.2035 (k)           |      |                          |                                   |  | 13.084                                        |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   | 5,750 % fällig am 16.01.2054 (k)           |      |                          |                                   |  | 0,28                                          |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | Summe Südkorea                                |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 13.915                                        |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 0,30                                          |                          |                                   |  |  |
| POLEN                                        |  |      |                          |                                   | SRI LANKA                                  |      |                          |                                   |  | STAATSEMISSIONEN                              |                          |                                   |  |  |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |  |      |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                           |      |                          |                                   |  | Sri Lanka Government International Bond       |                          |                                   |  |  |
| mBank S.A.                                   |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 3,100 % fällig am 15.01.2030                  |                          |                                   |  |  |
| 4,778 % fällig am 25.09.2035                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 3,350 % fällig am 15.03.2033                  |                          |                                   |  |  |
| ORLEN S.A.                                   |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | (k)                                           |                          |                                   |  |  |
| 6,000 % fällig am 30.01.2035                 |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  | 3,600 % fällig am 15.02.2038                  |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |
|                                              |  |      |                          |                                   |                                            |      |                          |                                   |  |                                               |                          |                                   |  |  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,000 % fällig am 15.04.2028                             | \$ 5.803       | \$ 5.462                 | 0,12                              | 46,872 % fällig                                    |                |                          |                                   | GROSSBRITANNIEN                                   |                |                          |                                   |
| Summe Sri Lanka                                          |                | 21.179                   | 0,45                              | am 16.06.2027 TRY                                  | 452.400        | \$ 11.303                | 0,24                              | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |                |                          |                                   |
| <b>SUPRANATIONAL</b>                                     |                |                          |                                   | 49,053 % fällig                                    |                | 48.000                   | 1,212                             | Antofagasta PLC                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | am 20.05.2026                                      |                |                          | 0,02                              | 2,375 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| Africa Finance Corp.                                     |                |                          |                                   | am 19.08.2026                                      | 51.800         | 1.307                    | 0,03                              | 14.10.2030 (k)                                    | \$ 2.200       | \$ 1.948                 | 0,04                              |
| 2,870 % fällig am 13.08.2031                             | 600            | 513                      | 0,01                              | 49,053 % fällig                                    |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 02.05.2034                      | 5.400          | 5.666                    | 0,12                              |
| 2,900 % fällig am 21.07.2031                             | 600            | 514                      | 0,01                              | am 17.05.2028                                      | 689.800        | 16.814                   | 0,36                              | Azule Energy Finance PLC                          |                |                          |                                   |
| Summe Supranational                                      |                | 1.027                    | 0,02                              | Türkiye İhracat Kredi Bankası A/S                  |                |                          |                                   | 8,125 % fällig am 23.01.2030                      | 5.400          | 5.354                    | 0,11                              |
| <b>TAJIKISTAN</b>                                        |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am                                  |                |                          |                                   | NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC       |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                          |                                   | 03.07.2028                                         | \$ 4.100       | 4.108                    | 0,09                              | 7,125 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| Republic of Tajikistan Government International Bond     |                |                          |                                   |                                                    |                | 95.309                   | 2,03                              | 19.07.2026                                        | € 3.131        | 3.160                    | 0,07                              |
| 7,125 % fällig am 14.09.2027                             | 333            | 330                      | 0,01                              | Summe Türkei                                       |                | 136.068                  | 2,90                              | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC    |                |                          |                                   |
| <b>TANSANIA</b>                                          |                |                          |                                   | <b>UGANDA</b>                                      |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   | 05.04.2032 (d)                                    | \$ 53.571      | 38.123                   | 0,81                              |
| Ministry of Finance of Tanzania                          |                |                          |                                   | Republic of Uganda Government International Bond   |                |                          |                                   | Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC     |                |                          |                                   |
| TBD % fällig am 26.04.2028                               | € 6.709        | 7.887                    | 0,17                              | 14,375 % fällig am                                 |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 09.07.2026                      | 15.330         | 12.724                   | 0,27                              |
| TBD % fällig am 20.06.2030                               | \$ 8.000       | 7.968                    | 0,17                              | 03.02.2033                                         | UGX 19.144.000 | 4.809                    | 0,10                              | Vedanta Resources Finance PLC                     |                |                          |                                   |
| Summe Tansania                                           |                | 15.855                   | 0,34                              | 15,000 % fällig am                                 | 18.06.2043     | 3.783.800                | 909                               | 9,475 % fällig am 24.07.2030                      | 2.800          | 2.778                    | 0,06                              |
| <b>THAILAND</b>                                          |                |                          |                                   | 15,800 % fällig am                                 |                |                          |                                   | 9,850 % fällig am 24.04.2033                      | 2.900          | 2.911                    | 0,06                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | 23.06.2039                                         | 694.000        | 178                      | 0,01                              | 10,875 % fällig am 17.09.2029                     | 2.000          | 2.076                    | 0,05                              |
| Bangkok Bank PCL                                         |                |                          |                                   | Summe Uganda                                       |                | 5.896                    | 0,13                              |                                                   |                | 74.740                   | 1,59                              |
| 3,733 % fällig am 25.09.2034                             |                |                          |                                   | <b>UKRAINE</b>                                     |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 800            | 745                      | 0,01                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   | Canada Square Funding PLC                         |                |                          |                                   |
| PTTEP Treasury Center Co. Ltd.                           |                |                          |                                   | Ukraine Government International Bond              |                |                          |                                   | 5,161 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| 3,903 % fällig am 06.12.2059                             | 550            | 397                      | 0,01                              | 0,000 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 17.01.2059                                        | £ 2.137        | 2.934                    | 0,06                              |
| Summe Thailand                                           |                | 1.142                    | 0,02                              | 01.02.2030                                         | \$ 2.478       | 1.198                    | 0,03                              | Rochester Financing PLC                           |                |                          |                                   |
| <b>TRINIDAD UND TOBAGO</b>                               |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 01.02.2034                       | 7.769          | 3.014                    | 0,06                              | 4,939 % fällig am 18.12.2044                      | 1.750          | 2.397                    | 0,05                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 01.02.2035                       | 1.689          | 802                      | 0,02                              | Tower Bridge Funding PLC                          |                |                          |                                   |
| National Gas Co. of Trinidad & Tobago Ltd.               |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 01.08.2041                       | 15.630         | 11.293                   | 0,24                              | 4,959 % fällig am 20.12.2063                      | 707            | 969                      | 0,02                              |
| 6,050 % fällig am 15.01.2036                             | 5.070          | 4.601                    | 0,10                              | 1,750 % fällig am                                  |                |                          |                                   | Warwick Finance Residential Mortgages PLC         |                |                          |                                   |
| Trinidad Generation Unlimited                            |                |                          |                                   | 01.02.2029 (k)                                     | 9.300          | 5.766                    | 0,12                              | 0,000 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| 7,750 % fällig am 16.06.2033                             | 3.800          | 3.939                    | 0,08                              | 1,750 % fällig am 01.02.2034                       | 17.593         | 9.148                    | 0,20                              | 21.12.2049 (d)                                    | 0              | 667                      | 0,02                              |
| Summe Trinidad und Tobago                                |                | 8.540                    | 0,18                              | 1,750 % fällig am 01.02.2035                       | 9.388          | 4.816                    | 0,10                              | 5,189 % fällig am 21.12.2049                      | 1.750          | 2.407                    | 0,05                              |
| <b>TUNESIEN</b>                                          |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 01.02.2036                       | 6.737          | 3.368                    | 0,07                              | 5,889 % fällig am 21.12.2049                      | 735            | 1.014                    | 0,02                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                          |                                   | Summe Ukraine                                      |                | 39.405                   | 0,84                              | 6,389 % fällig am 21.12.2049                      | 367            | 502                      | 0,01                              |
| Banque Centrale de Tunisie Government International Bond |                |                          |                                   | <b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>                |                |                          |                                   | 6,889 % fällig am 21.12.2049                      | 210            | 286                      | 0,01                              |
| 3,280 % fällig am 09.08.2027                             | ¥ 200.000      | 1.272                    | 0,03                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | 7,389 % fällig am 21.12.2049                      | 210            | 284                      | 0,01                              |
| <b>TÜRKEI</b>                                            |                |                          |                                   | Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC                   |                |                          |                                   |                                                   |                | 11.460                   | 0,25                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 02.11.2047                       | 5.200          | 4.656                    | 0,10                              | Summe Großbritannien                              |                | 86.200                   | 1,84                              |
| Coca-Cola İçecek A/S                                     |                |                          |                                   | Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC           |                |                          |                                   | <b>USA</b>                                        |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 20.01.2029                             | \$ 700         | 681                      | 0,02                              | 5,250 % fällig am 02.10.2054                       | 9.400          | 8.731                    | 0,18                              | <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   |
| Ford Otomotiv Sanayi A/S                                 |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 08.05.2034                       | 4.400          | 4.578                    | 0,10                              | Aames Mortgage Investment Trust                   |                |                          |                                   |
| 7,125 % fällig am 25.04.2029                             | 200            | 201                      | 0,00                              | Abu Dhabi National Energy Co. PJSC                 |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği A/S              |                |                          |                                   | 4,696 % fällig am 24.04.2033                       | 5.100          | 5.048                    | 0,11                              | 25.04.2036                                        | \$ 2.498       | 2.317                    | 0,05                              |
| 8,250 % fällig am 15.11.2028                             | 500            | 520                      | 0,01                              | Adnoc Murban Rsc Ltd.                              |                |                          |                                   | Argent Mortgage Loan Trust                        |                |                          |                                   |
| Türkcell İletişim Hizmetleri A/S                         |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 11.09.2054                       | 21.000         | 19.179                   | 0,41                              | 4,914 % fällig am 25.05.2035                      | 361            | 324                      | 0,01                              |
| 7,450 % fällig am 24.01.2030                             | 7.200          | 7.341                    | 0,16                              | DP World Ltd.                                      |                |                          |                                   | Argent Securities Trust                           |                |                          |                                   |
| Türk Airlines Pass-Through Trust                         |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 30.09.2049                       | 1.600          | 1.318                    | 0,03                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                      | 802            | 721                      | 0,02                              |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028                             | 2.478          | 2.400                    | 0,05                              | 5,625 % fällig am 25.09.2048                       | 2.475          | 2.312                    | 0,05                              | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. |                |                          |                                   |
| Ulker Bisküvi Sanayi A/S                                 |                |                          |                                   | 6,850 % fällig am 02.07.2037                       | 4.680          | 5.109                    | 0,11                              | 4,914 % fällig am 25.02.2037                      | 810            | 787                      | 0,02                              |
| 7,875 % fällig am 08.07.2031                             | 1.100          | 1.128                    | 0,02                              | Kuwait Projects Co. SPC Ltd.                       |                |                          |                                   | 5,559 % fällig am 25.11.2035                      | 2.519          | 2.495                    | 0,05                              |
|                                                          |                | 12.271                   | 0,26                              | 4,500 % fällig am 23.02.2027                       | 3.800          | 3.613                    | 0,08                              | GSAA Home Equity Trust                            |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                |                |                          |                                   | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.                 |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.05.2047                      | 630            | 365                      | 0,01                              |
| SOCAR Turkey Enerji A/S                                  |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 21.05.2030                       | 5.300          | 5.363                    | 0,11                              | 4,914 % fällig am 25.11.2036                      | 246            | 78                       | 0,00                              |
| TBD % fällig am 11.08.2026                               | € 18.884       | 22.126                   | 0,47                              | 4,875 % fällig am 25.07.2033                       | 13.600         | 13.485                   | 0,29                              | 6,502 % fällig am 25.11.2036                      | 812            | 302                      | 0,01                              |
| Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.                          |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 21.05.2035                       | 6.000          | 6.111                    | 0,13                              | Home Equity Asset Trust                           |                |                          |                                   |
| 5,001 % fällig am 15.12.2028                             | 5.400          | 6.362                    | 0,14                              | MDGH GMTN RSC Ltd.                                 |                |                          |                                   | 5,784 % fällig am 25.02.2033                      | 155            | 151                      | 0,00                              |
|                                                          |                | 28.488                   | 0,61                              | 3,950 % fällig am 21.05.2050                       | 1.600          | 1.231                    | 0,02                              | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                          |                                   | 5,084 % fällig am 22.05.2053                       | 2.500          | 2.286                    | 0,05                              | 4,704 % fällig am 25.08.2036                      | 99             | 94                       | 0,00                              |
| Hazine Mustesarlığı Varlik Kiralama A/S                  |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 01.05.2034                       | 5.600          | 5.961                    | 0,13                              | Lehman XS Trust                                   |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 01.09.2030                             |                |                          |                                   |                                                    |                | 88.981                   | 1,90                              | 4,984 % fällig am 25.01.2036                      | 1.726          | 1.542                    | 0,03                              |
| (a)                                                      | \$ 11.200      | 11.197                   | 0,24                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>          |                |                          |                                   | MASTR Asset-Backed Securities Trust               |                |                          |                                   |
| Turkey Government International Bond                     |                |                          |                                   | NMC Healthcare LLC                                 |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.11.2036                      | 984            | 582                      | 0,01                              |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047                             | 47.600         | 35.790                   | 0,76                              | TBD % fällig am                                    |                |                          |                                   | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust            |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 26.06.2031                             | 4.500          | 4.291                    | 0,09                              | 25.03.2027                                         | AED 10.507     | 2.865                    | 0,06                              | 4,634 % fällig am 25.02.2037                      | 1.303          | 567                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 14.01.2041                             | 11.235         | 9.287                    | 0,20                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   | 5,199 % fällig am 25.01.2035                      | 185            | 186                      | 0,00                              |
|                                                          |                |                          |                                   | Emirate of Abu Dhabi Government International Bond |                |                          |                                   | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.02.2037                      | 169            | 33                       | 0,00                              |
|                                                          |                |                          |                                   | 30.09.2049                                         | \$ 3.600       | 2.459                    | 0,05                              | Option One Mortgage Loan Trust                    |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.05.2037                      | 495            | 298                      | 0,01                              |
|                                                          |                |                          |                                   | 16.04.2050                                         | 13.600         | 10.606                   | 0,23                              | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed          |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am                                  |                |                          |                                   | Pass-Through Certificates                         |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 30.04.2054                                         | 9.250          | 9.231                    | 0,20                              | 5,214 % fällig am 25.09.2035                      | 3.900          | 3.561                    | 0,08                              |
|                                                          |                |                          |                                   | Emirate of Dubai Government International Bond     |                |                          |                                   | Renaissance Home Equity Loan Trust                |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 3,900 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 5,797 % fällig am 25.08.2036                      | 780            | 278                      | 0,01                              |
|                                                          |                |                          |                                   | 09.09.2050                                         | 1.700          | 1.205                    | 0,02                              | Saxon Asset Securities Trust                      |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | Finance Department Government of Sharjah           |                |                          |                                   | 4,744 % fällig am 25.09.2037                      | 185            | 178                      | 0,00                              |
|                                                          |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am                                  |                |                          |                                   | Soundview Home Loan Trust                         |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 28.07.2050                                         | 8.500          | 5.445                    | 0,12                              | 4,604 % fällig am 25.08.2037                      | 515            | 451                      | 0,01                              |
|                                                          |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.11.2036                      | 58             | 55                       | 0,00                              |
|                                                          |                |                          |                                   | 13.02.2032                                         | € 8.200        | 9.642                    | 0,20                              |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am                                  |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | 23.11.2032                                         | \$ 11.600      | 12.133                   | 0,26                              |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   |                                                    |                | 50.721                   | 1,08                              |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                          |                |                          |                                   | Summe Vereinigte Arabische Emirate                 |                | 142.567                  | 3,04                              |                                                   |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,959 % fällig am 25.03.2036 | \$ 125         | \$ 124                   | 0,00                              |
| 5,334 % fällig am 25.10.2037 | 1.146          | 880                      | 0,02                              |
|                              |                | 16.804                   | 0,36                              |

#### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                     |       |        |      |
|-------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>Cantor Fitzgerald LP</b>         |       |        |      |
| 7,200 % fällig am 12.12.2028        | 8.850 | 9.398  | 0,20 |
| <b>Rio Oil Finance Trust</b>        |       |        |      |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028        | 4.114 | 4.292  | 0,09 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027        | 3.219 | 3.333  | 0,07 |
| <b>Rutas 2 &amp; 7 Finance Ltd.</b> |       |        |      |
| 0,000 % fällig am 30.09.2036 (d)    | 4.293 | 3.115  | 0,07 |
|                                     |       | 20.138 | 0,43 |

#### KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                                   |           |        |      |
|-----------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>Finance Ministry Angola</b>    |           |        |      |
| TBD % fällig am 11.12.2025        | 12.300    | 12.306 | 0,26 |
| <b>Stepstone Group Midco GmbH</b> |           |        |      |
| 6,673 % fällig am 26.04.2032      | € 16.500  | 19.030 | 0,40 |
| <b>Ziraat Bank</b>                |           |        |      |
| TBD % fällig am 15.06.2034        | \$ 12.100 | 12.031 | 0,26 |
|                                   |           | 43.367 | 0,92 |

#### NON-AGENCY-MBS

|                                                                |       |       |      |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.</b> |       |       |      |
| 4,407 % fällig am 15.11.2061                                   | 3.700 | 3.690 | 0,08 |
| <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                          |       |       |      |
| 5,056 % fällig am 25.02.2036                                   | 4     | 3     | 0,00 |
| <b>BCAP LLC Trust</b>                                          |       |       |      |
| 4,155 % fällig am 26.05.2037                                   | 2.975 | 2.660 | 0,06 |
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>             |       |       |      |
| 4,250 % fällig am 25.05.2047                                   | 71    | 64    | 0,00 |
| 5,166 % fällig am 25.01.2035                                   | 3     | 3     | 0,00 |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                                |       |       |      |
| 5,467 % fällig am 25.05.2035                                   | 35    | 34    | 0,00 |
| <b>Benchmark Mortgage Trust</b>                                |       |       |      |
| 3,666 % fällig am 15.01.2051                                   | 1.700 | 1.664 | 0,04 |
| 4,261 % fällig am 10.10.2051                                   | 4.800 | 4.738 | 0,10 |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                     |       |       |      |
| 4,783 % fällig am 25.09.2037                                   | 132   | 122   | 0,00 |
| <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                     |       |       |      |
| 5,084 % fällig am 25.10.2036                                   | 858   | 663   | 0,01 |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                      |       |       |      |
| 4,784 % fällig am 25.05.2036                                   | 978   | 376   | 0,01 |
| 5,072 % fällig am 20.12.2035                                   | 484   | 457   | 0,01 |
| <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>       |       |       |      |
| 4,048 % fällig am 20.05.2036                                   | 69    | 65    | 0,00 |
| 4,607 % fällig am 25.11.2037                                   | 357   | 341   | 0,01 |
| <b>Countrywide Home Loan Repreforming REMIC Trust</b>          |       |       |      |
| 4,859 % fällig am 25.11.2034                                   | 122   | 116   | 0,00 |
| <b>Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust</b>           |       |       |      |
| 5,094 % fällig am 25.08.2037                                   | 591   | 479   | 0,01 |
| <b>GSMPS Mortgage Loan Trust</b>                               |       |       |      |
| 4,784 % fällig am 25.01.2036                                   | 118   | 95    | 0,00 |
| <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                                 |       |       |      |
| 4,729 % fällig am 25.01.2036                                   | 18    | 17    | 0,00 |
| <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                          |       |       |      |
| 6,399 % fällig am 19.10.2035                                   | 92    | 43    | 0,00 |
| <b>HomeBanc Mortgage Trust</b>                                 |       |       |      |
| 4,954 % fällig am 25.01.2036                                   | 132   | 128   | 0,00 |
| <b>Impac CMB Trust</b>                                         |       |       |      |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                                   | 57    | 55    | 0,00 |
| <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                             |       |       |      |
| 3,500 % fällig am 25.11.2037                                   | 159   | 131   | 0,00 |
| 4,794 % fällig am 25.02.2037                                   | 1.138 | 1.067 | 0,02 |
| 5,074 % fällig am 25.07.2045                                   | 284   | 226   | 0,01 |
| <b>JPMorgan Resecuritization Trust</b>                         |       |       |      |
| 2,500 % fällig am 25.03.2056                                   | 96    | 94    | 0,00 |
| <b>Lehman XS Trust</b>                                         |       |       |      |
| 4,814 % fällig am 25.09.2046                                   | 1.696 | 1.512 | 0,03 |
| <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>                  |       |       |      |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036                                   | 275   | 230   | 0,01 |
| <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>          |       |       |      |
| 4,914 % fällig am 25.09.2037                                   | 20    | 18    | 0,00 |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>             |       |       |      |
| 4,734 % fällig am 25.02.2037                                   | 604   | 578   | 0,01 |

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>  |                |                          |                                   |
| 4,979 % fällig am 25.10.2037 \$                      | 414            | \$ 369                   | 0,01                              |
| <b>TBW Mortgage-Backed Trust</b>                     |                |                          |                                   |
| 6,540 % fällig am 25.01.2037                         | 1.212          | 258                      | 0,01                              |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                |                          |                                   |
| 4,257 % fällig am 25.02.2037                         | 136            | 123                      | 0,00                              |
| 4,585 % fällig am 25.03.2036                         | 805            | 730                      | 0,02                              |
| 4,804 % fällig am 25.05.2034                         | 109            | 102                      | 0,00                              |
| 5,469 % fällig am 25.01.2046                         | 77             | 69                       | 0,00                              |
| <b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>  |                |                          |                                   |
| 7,414 % fällig am 25.10.2036                         | 220            | 211                      | 0,01                              |
|                                                      |                | 21.531                   | 0,46                              |

#### US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

|                                              |        |        |      |
|----------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>Fannie Mae</b>                            |        |        |      |
| 6,748 % fällig am 01.03.2036                 | 12     | 12     | 0,00 |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>      |        |        |      |
| 5,500 % fällig am 01.02.2038                 | 1      | 1      | 0,00 |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b> |        |        |      |
| 4,000 % fällig am 01.08.2055                 | 13.050 | 12.133 | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055                 | 13.150 | 12.574 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055                 | 16.600 | 16.260 | 0,35 |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055                 | 16.100 | 16.086 | 0,34 |
|                                              |        | 57.066 | 1,22 |

#### US-SCHATZOBIGATIONEN

|                              |        |         |      |
|------------------------------|--------|---------|------|
| <b>U.S. Treasury Bonds</b>   |        |         |      |
| 1,750 % fällig am 15.08.2041 | 12.300 | 8.170   | 0,17 |
| 2,375 % fällig am 15.02.2042 | 14.200 | 10.335  | 0,22 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042 | 60.500 | 50.071  | 1,07 |
| 3,375 % fällig am 15.08.2042 | 14.700 | 12.343  | 0,26 |
| <b>U.S. Treasury Notes</b>   |        |         |      |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 | 7.900  | 7.516   | 0,16 |
| 2,625 % fällig am 31.07.2029 | 30.000 | 28.741  | 0,61 |
| 3,125 % fällig am 31.08.2029 | 36.800 | 35.920  | 0,77 |
| 3,500 % fällig am 15.02.2033 | 200    | 193     | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 28.02.2030 | 33.100 | 33.430  | 0,71 |
| 4,250 % fällig am 15.01.2028 | 300    | 304     | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 30.04.2029 | 450    | 464     | 0,01 |
|                              |        | 187.487 | 3,99 |

#### AKTIEN

##### OPTIONSSCHEINE

|                                                                          |   |         |      |
|--------------------------------------------------------------------------|---|---------|------|
| <b>Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (j)</b> | 5 | 0       | 0,00 |
| <b>Summe USA</b>                                                         |   | 346.393 | 7,38 |

#### URUGUAY

##### STAATSEMISSIONEN

|                                              |       |       |      |
|----------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>Uruguay Government International Bond</b> |       |       |      |
| 5,250 % fällig am 10.09.2060 \$              | 3.950 | 3.592 | 0,08 |

#### USBKISTAN

##### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                                   |       |       |      |
|---------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>Ipoteka-Bank ATIB</b>                          |       |       |      |
| 5,500 % fällig am 19.11.2025                      | 2.038 | 2.033 | 0,04 |
| <b>Uzbek Industrial and Construction Bank ATB</b> |       |       |      |
| 8,950 % fällig am 24.07.2029                      | 6.500 | 6.852 | 0,15 |
|                                                   |       | 8.885 | 0,19 |

##### STAATSEMISSIONEN

|                                                  |                |        |      |
|--------------------------------------------------|----------------|--------|------|
| <b>National Bank of Uzbekistan</b>               |                |        |      |
| 4,850 % fällig am 21.10.2025                     | 7.048          | 7.020  | 0,15 |
| 8,500 % fällig am 05.07.2029                     | 10.600         | 11.143 | 0,24 |
| 19,875 % fällig am 05.07.2027                    | UZS 62.500.000 | 5.050  | 0,11 |
| <b>Republic of Uzbekistan International Bond</b> |                |        |      |
| 5,375 % fällig am 29.05.2027 €                   | 8.100          | 9.750  | 0,21 |
| <b>Uzbekistan Government International Bond</b>  |                |        |      |
| 3,700 % fällig am 25.11.2030 \$                  | 200            | 179    | 0,00 |
| 3,900 % fällig am 19.10.2031                     | 9.400          | 8.301  | 0,17 |
| <b>Uzbekneftegaz JSC</b>                         |                |        |      |
| 4,750 % fällig am 16.11.2028                     | 6.600          | 6.060  | 0,13 |
| 8,750 % fällig am 07.05.2030                     | 10.000         | 10.308 | 0,22 |
|                                                  |                | 57.811 | 1,23 |
| <b>Summe Usbekistan</b>                          |                | 66.696 | 1,42 |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>VENEZUELA</b>                        |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| <b>Petroleos de Venezuela S.A.</b>      |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^          | \$ 73.690      | \$ 9.290                 | 0,20                              |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^          | 19.365         | 2.441                    | 0,05                              |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^          | 3.500          | 447                      | 0,01                              |
| 8,500 % fällig am 27.10.2020 ^          | 10.351         | 9.600                    | 0,20                              |
|                                         |                | 21.778                   | 0,46                              |

#### STAATSEMISSIONEN

|                                                |        |        |      |
|------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>Venezuela Government International Bond</b> |        |        |      |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^                 | 19.650 | 3.470  | 0,07 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^                 | 25.063 | 4.075  | 0,09 |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^                 | 20.130 | 2.997  | 0,06 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^                 | 19.575 | 3.220  | 0,07 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^                 | 13.378 | 2.156  | 0,05 |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^                 | 13.810 | 2.814  | 0,06 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^                 | 15.748 | 2.792  | 0,06 |
| 11,950 % fällig am 05.08.2031 ^                | 2.150  | 400    | 0,01 |
|                                                |        | 21.924 | 0,47 |
| <b>Summe Venezuela</b>                         |        | 43.702 | 0,93 |

#### JUNGFERNINSELN (BRITISCH)

##### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| <b>Gerdau Trade, Inc.</b>    |       |       |      |
| 5,750 % fällig am 09.06.2035 | 7.100 | 7.114 | 0,15 |

#### SAMBIA

##### STAATSEMISSIONEN

|                                             |     |     |      |
|---------------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>Zambia Government International Bond</b> |     |     |      |
| 0,500 % fällig am 31.12.2053                | 268 | 185 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 30.06.2033                | 239 | 220 | 0,01 |
| <b>Summe Sambia</b>                         |     | 405 | 0,01 |

#### KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

##### KURZFRISTIGE SCHULDITITEL

|                                          |           |       |      |
|------------------------------------------|-----------|-------|------|
| <b>Standard Chartered Bank</b>           |           |       |      |
| 22,238 % fällig am 01.12.2025 (d)(e) PKR | 1.458.300 | 4.508 | 0,09 |
| 22,242 % fällig am 03.11.2025 (d)(e)     | 1.316.100 | 4.101 | 0,09 |
|                                          |           | 8.609 | 0,18 |

#### EGYPT TREASURY BILLS

|                                          |         |        |      |
|------------------------------------------|---------|--------|------|
| 26,851 % fällig am 21.10.2025 (d)(e) EGP | 545.675 | 10.133 | 0,22 |
| 27,349 % fällig am 15.07.2025 (d)(e)     | 324.225 | 6.473  | 0,14 |
| 27,497 % fällig am 15.07.2025 (d)(e)     | 135.000 | 2.695  | 0,06 |
| 27,497 % fällig am 29.07.2025 (d)(e)     | 250.000 | 4.943  | 0,10 |
| 27,499 % fällig am 26.08.2025 (d)(e)     | 425.650 | 8.235  | 0,18 |
| 27,499 % fällig am 09.09.2025 (d)(e)     | 300.000 | 5.742  | 0,12 |
| 27,500 % fällig am 02.09.2025 (d)(e)     | 150.000 | 2.890  | 0,06 |
| 27,501 % fällig am 26.08.2025 (d)(e)     | 650.600 | 12.587 | 0,27 |
|                                          |         | 53.698 | 1,15 |

#### NIGERIA TREASURY BILLS

|                                          |            |        |      |
|------------------------------------------|------------|--------|------|
| 22,542 % fällig am 25.11.2025 (d)(e) NGN | 598.039    | 353    | 0,01 |
| 22,930 % fällig am 02.12.2025 (d)(e)     | 4.011.425  | 2.360  | 0,05 |
| 23,286 % fällig am 04.11.2025 (d)(e)     | 1.070.000  | 641    | 0,01 |
| 26,125 % fällig am 23.09.2025 (d)(e)     | 6.207.161  | 3.822  | 0,08 |
| 26,257 % fällig am 30.09.2025 (d)(e)     | 10.373.278 | 6.358  | 0,14 |
| 26,488 % fällig am 19.08.2025 (d)(e)     | 17.368.079 | 10.949 | 0,23 |
| 26,510 % fällig am 11.11.2025 (d)(e)     | 4.414.652  | 2.621  | 0,06 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 26,683 % fällig am<br>19.08.2025 (d)(e) NGN   | 820.241        | \$ 517                   | 0,01                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                                                           |                |                          |                                   |
| 26,691 % fällig am<br>11.11.2025 (d)(e)       | 2.816.841      | 1.672                    | 0,04                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                         |                |                          |                                   |
| 30,612 % fällig am<br>29.06.2026 (d)(e)       | 24.149.124     | 12.679                   | 0,27                              | <b>PIMCO Funds: Global</b>                                                       |                |                          |                                   |
| 30,864 % fällig am<br>26.06.2026 (d)(e)       | 12.978.546     | 6.824                    | 0,14                              | Investors Series plc -<br>PIMCO Emerging<br>Markets<br>Opportunities<br>Fund (h) | 2.357.350      | \$ 31.942                | 0,68                              |
| 31,337 % fällig am<br>07.10.2025 (d)(e)       | 252.900        | 154                      | 0,00                              | <b>PIMCO Select Funds plc -</b>                                                  |                |                          |                                   |
| 31,577 % fällig am<br>07.10.2025 (d)(e)       | 19.041.000     | 11.605                   | 0,25                              | PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating<br>NAV Fund (h)                           | 19.356.564     | 193.019                  | 4,11                              |
| 33,126 % fällig am<br>12.06.2026 (d)(e)       | 4.325.702      | 2.291                    | 0,05                              | <b>PIMCO Specialty Funds</b>                                                     |                |                          |                                   |
| 33,156 % fällig am<br>11.06.2026 (d)(e)       | 4.329.652      | 2.295                    | 0,05                              | Ireland p.l.c. - PIMCO<br>China Bond Fund (h)                                    | 384.360        | 5.631                    | 0,12                              |
|                                               |                | 65.141                   | 1,39                              | <b>Summe Investmentfonds</b>                                                     |                | <b>\$ 230.592</b>        | <b>4,91</b>                       |
| <b>U.S. TREASURY BILLS</b>                    |                |                          |                                   |                                                                                  |                |                          |                                   |
| 4,334 % fällig am<br>02.09.2025 (d)(e)<br>(l) | \$ 1.000       | 992                      | 0,02                              |                                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Summe kurzfristige Instrumente</b>         |                | <b>128.440</b>           | <b>2,74</b>                       |                                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>         |                | <b>\$ 4.721.203</b>      | <b>100,57</b>                     |                                                                                  |                |                          |                                   |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                          | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Euro-Bobl September Futures                                           | Long  | 09.2025          | 653                     | \$ (410)                                        | (0,01)                  |
| Euro-BTP September Futures                                            | Long  | 09.2025          | 53                      | 16                                              | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                                           | Long  | 09.2025          | 372                     | (438)                                           | (0,01)                  |
| Euro-OAT September Futures                                            | Short | 09.2025          | 580                     | 518                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                           | Long  | 09.2025          | 275                     | 226                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                           | Long  | 09.2025          | 1.607                   | 1.840                                           | 0,04                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                          | Long  | 09.2025          | 9.934                   | 17.985                                          | 0,38                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                         | Short | 09.2025          | 116                     | (293)                                           | (0,01)                  |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures                  | Short | 09.2025          | 47                      | (49)                                            | 0,00                    |
|                                                                       |       |                  |                         | <b>\$ 19.395</b>                                | <b>0,41</b>             |
| <b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b> |       |                  |                         | <b>\$ 19.395</b>                                | <b>0,41</b>             |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

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

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.EM-43 5-Year Index | 1,000 %                        | 20.06.2030            | \$ 23.000                      | \$ 326                                          | 0,01                    |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt    | variabler<br>Zinssatz         | variabler Zinssatzindex | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------|-------------------------------|-------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 1,000 %           | 15.06.2029            | \$ 11.100       | \$ (461)                                        | (0,01)                  |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 1,500             | 21.06.2027            | 13.700          | (1.414)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 1,500             | 15.12.2028            | 400             | (31)                                            | 0,00                    |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 1,750             | 15.12.2031            | 5.700           | (763)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 2,250             | 21.12.2046            | 1.200           | 617                                             | 0,01                    |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 2,500             | 15.06.2046            | 600             | 317                                             | 0,01                    |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,000             | 19.03.2030            | 60.200          | 1.823                                           | 0,04                    |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,250             | 18.06.2030            | 146.300         | 2.025                                           | 0,04                    |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,250             | 19.03.2035            | 18.900          | (637)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,250             | 19.03.2055            | 34.300          | 49                                              | 0,00                    |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,250             | 18.06.2055            | 41.700          | (769)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,500             | 20.12.2030            | 40.500          | 1.983                                           | 0,04                    |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,500             | 20.12.2030            | 152.400         | (3.950)                                         | (0,08)                  |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,500             | 20.12.2033            | 12.640          | 518                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,620             | 30.11.2029            | 237.368         | (2.203)                                         | (0,05)                  |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,730             | 03.08.2033            | 3.300           | 17                                              | 0,00                    |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,735             | 07.08.2033            | 3.700           | 21                                              | 0,00                    |
| Zahlung               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS |                         | 3,750             | 20.12.2028            | 2.100           | 93                                              | 0,00                    |

| Zahlung/<br>Erhalt                             | variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750 %           | 20.06.2029            | \$ 13.800       | \$ 588                                          | 0,01                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2029            | 26.000          | (527)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 18.12.2029            | 1.060           | 13                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 18.12.2029            | 15.525          | (213)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2034            | 43.900          | (852)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 18.12.2034            | 5.900           | (136)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2036            | 3.300           | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2039            | 3.600           | (158)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2039            | 7.800           | 90                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 18.12.2039            | 11.500          | 267                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,830             | 12.10.2053            | 2.300           | (37)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870             | 17.10.2053            | 1.900           | (18)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880             | 16.10.2053            | 2.300           | (17)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030             | 04.10.2033            | 300             | 9                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150             | 12.10.2033            | 4.500           | 184                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,155             | 02.10.2033            | 6.200           | 254                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,165             | 27.09.2033            | 7.200           | 301                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,170             | 03.10.2033            | 8.900           | 376                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,175             | 10.10.2033            | 5.300           | 225                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,220             | 20.10.2033            | 4.000           | 184                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,230             | 23.10.2033            | 2.200           | 103                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250             | 20.03.2034            | 12.500          | 179                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250             | 20.03.2034            | 45.900          | (473)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,255             | 23.10.2033            | 2.400           | 118                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,393             | 25.10.2033            | 400             | 24                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,450             | 31.10.2033            | 3.800           | 246                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Year BRL-CDI                | 9,842             | 04.01.2027            | BRL 454.300     | (5.740)                                         | (0,13)                  |
| Erhalt                                         |                       | 1-Year BRL-CDI                | 11,253            | 04.01.2027            | 303.800         | 2.182                                           | 0,05                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Year BRL-CDI                | 11,550            | 04.01.2027            | 21.000          | (126)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Year BRL-CDI                | 11,570            | 04.01.2027            | 270.400         | (1.597)                                         | (0,03)                  |
| Erhalt                                         |                       | 1-Year BRL-CDI                | 13,055            | 04.01.2027            | 102.700         | (28)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Year BRL-CDI                | 13,615            | 02.01.2029            | 117.500         | 265                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 1-Year BRL-CDI                | 13,685            | 02.01.2029            | 117.500         | 304                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         |                       | 1-Year BRL-CDI                | 14,410            | 04.01.2027            | 454.300         | (599)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month CLP-CHILIBOR          | 4,855             | 18.12.2033            | CLP 10.615.700  | (96)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         |                       | 6-Month CLP-CHILIBOR          | 5,511             | 13.11.2033            | 11.556.400      | (477)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,075             | 03.10.2029            | CZK 754.000     | (251)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         |                       | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,325             | 09.05.2030            | 1.148.000       | 759                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                         |                       | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,363             | 29.05.2030            | 1.601.300       | 175                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,489             | 30.10.2029            | 707.100         | 637                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,530             | 15.07.2029            | 1.215.700       | 836                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month CZK-PRIBOR            | 4,250             | 18.04.2029            | 353.200         | (23)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 17.09.2030            | € 117.500       | (1.031)                                         | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 17.09.2035            | 51.680          | 523                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 20.03.2044            | 2.500           | 101                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 17.09.2055            | 54.400          | 2.001                                           | 0,04                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,818             | 26.06.2029            | 35.200          | (37)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 3,300             | 03.10.2033            | 5.100           | 489                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 3,370             | 09.10.2028            | 1.800           | 128                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 3,450             | 20.10.2028            | 8.200           | 610                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month HUF-BBR               | 5,935             | 08.05.2030            | HUF 20.486.000  | (485)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         |                       | 6-Month PLN-WIBOR             | 4,075             | 11.04.2030            | PLN 126.100     | 315                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 6-Month PLN-WIBOR             | 4,855             | 10.02.2030            | 126.100         | 602                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         |                       | 28-Day MXN-TIIE               | 8,873             | 23.11.2034            | MXN 1.331.200   | (3.893)                                         | (0,08)                  |
| Zahlung                                        |                       | 28-Day MXN-TIIE               | 9,080             | 23.11.2034            | 193.900         | 710                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        |                       | 28-Day MXN-TIIE               | 9,265             | 23.11.2034            | 505.300         | 2.185                                           | 0,05                    |
| Zahlung                                        |                       | 28-Day MXN-TIIE               | 9,335             | 23.11.2034            | 206.400         | 944                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                        |                       | 28-Day MXN-TIIE               | 9,375             | 23.11.2034            | 389.700         | 1.323                                           | 0,03                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                       |                               |                   |                       |                 | \$ (1.328)                                      | (0,03)                  |
|                                                |                       |                               |                   |                       |                 | \$ (1.002)                                      | (0,02)                  |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                    | 0,700 %            | 15.10.2025         | 620.500                        | \$ 1.163 | \$ 592         | 0,01                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten     | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|------------|----------------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %            | 15.10.2025         | 992.600                        | \$ (1.175) | \$ (573)       | (0,01)                  |

#### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|------------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 46,850         | 14.08.2025         | 10.856                         | \$ (212)   | \$ (85)        | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,500             | 12.01.2026         | 18.211                         | (728)      | (560)          | (0,01)                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750             | 03.02.2026         | 41.551                         | (1.496)    | (1.486)        | (0,03)                  |
| GLM        | Call - OTC USD versus TRY | 42,960             | 04.09.2025         | 11.084                         | (368)      | (236)          | (0,01)                  |
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | 39,750             | 11.08.2025         | 9.297                          | (291)      | (7)            | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750             | 11.08.2025         | 9.297                          | (204)      | (48)           | 0,00                    |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600             | 12.11.2025         | 9.970                          | (379)      | (54)           | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900             | 12.11.2025         | 9.970                          | (278)      | (185)          | (0,01)                  |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,750             | 09.12.2025         | 13.254                         | (476)      | (170)          | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 57,750             | 09.12.2025         | 13.254                         | (332)      | (278)          | (0,01)                  |
|            |                           |                    |                    |                                | \$ (4.764) | \$ (3.109)     | (0,07)                  |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu<br>bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Oman Government International Bond         | (1,000) %                         | 20.12.2027            | \$ 2.300                       | \$ 75                                        | \$ (101)                                        | \$ (26)        | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond       | (1,000)                           | 20.12.2029            | 2.000                          | 69                                           | (11)                                            | 58             | 0,00                    |
| BPS        | Hungary Government International Bond      | (1,000)                           | 20.12.2029            | 9.000                          | 71                                           | (5)                                             | 66             | 0,00                    |
|            | Oman Government International Bond         | (1,000)                           | 20.12.2027            | 1.100                          | 36                                           | (49)                                            | (13)           | 0,00                    |
| BRC        | Oman Government International Bond         | (1,000)                           | 20.12.2027            | 2.400                          | 64                                           | (91)                                            | (27)           | 0,00                    |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                           | 20.06.2034            | 32.700                         | (355)                                        | 396                                             | 41             | 0,00                    |
| GST        | Panama Government International Bond       | (1,000)                           | 20.12.2029            | 4.050                          | 123                                          | (5)                                             | 118            | 0,01                    |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                           | 20.06.2034            | 13.900                         | (159)                                        | 176                                             | 17             | 0,00                    |
| MYC        | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                           | 20.06.2034            | 25.800                         | (291)                                        | 323                                             | 32             | 0,00                    |
|            |                                            |                                   |                       |                                | \$ (367)                                     | \$ 633                                          | \$ 266         | 0,01                    |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                                  | Zu<br>erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond             | 1,000 %                           | 20.06.2035            | \$ 2.500                       | \$ (289)                                     | \$ 15                                           | \$ (274)       | (0,01)                  |
|            | Chile Government International Bond              | 1,000                             | 20.12.2026            | 700                            | 4                                            | 4                                               | 8              | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond              | 1,000                             | 20.12.2027            | 5.000                          | (18)                                         | 104                                             | 86             | 0,00                    |
|            | Indonesia Government International Bond          | 1,000                             | 20.06.2030            | 2.100                          | 7                                            | 15                                              | 22             | 0,00                    |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                             | 20.12.2028            | 1.300                          | (289)                                        | 165                                             | (124)          | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                             | 20.06.2026            | 2.900                          | 26                                           | (6)                                             | 20             | 0,00                    |
|            | South Africa Government International Bond       | 1,000                             | 20.12.2025            | 9.600                          | (526)                                        | 558                                             | 32             | 0,00                    |
|            |                                                  |                                   |                       |                                | (1.126)                                      |                                                 |                |                         |
| BPS        | Turkey Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2028            | 14.000                         |                                              | 510                                             | (616)          | (0,01)                  |
|            | Brazil Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2027            | 2.500                          | (171)                                        | 183                                             | 12             | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond              | 1,000                             | 20.12.2026            | 6.800                          | 39                                           | 39                                              | 78             | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond              | 1,000                             | 20.06.2027            | 10.000                         | (182)                                        | 330                                             | 148            | 0,00                    |
|            | Indonesia Government International Bond          | 1,000                             | 20.06.2030            | 2.000                          | 5                                            | 16                                              | 21             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2025            | 10.095                         | 49                                           | (12)                                            | 37             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                             | 20.06.2026            | 23.300                         | 129                                          | 12                                              | 141            | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2026            | 4.900                          | 6                                            | 31                                              | 37             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2027            | 9.300                          | 19                                           | 68                                              | 87             | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                             | 20.06.2026            | 32.100                         | 116                                          | 103                                             | 219            | 0,01                    |
|            | Philippines Government International Bond        | 1,000                             | 20.06.2030            | 9.100                          | 98                                           | 54                                              | 152            | 0,00                    |
|            | Romania Government International Bond            | 1,000                             | 20.12.2025            | 21.150                         | 35                                           | (4)                                             | 31             | 0,00                    |
|            | Serbia Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2027            | 1.800                          | (160)                                        | 162                                             | 2              | 0,00                    |
| BRC        | Benin Government International Bond              | 1,000                             | 20.06.2026            | 4.200                          | (143)                                        | 111                                             | (32)           | 0,00                    |
|            | Cote d'Ivoire                                    | 1,000                             | 20.06.2026            | 1.600                          | (50)                                         | 32                                              | (18)           | 0,00                    |
|            | Indonesia Government International Bond          | 1,000                             | 20.06.2030            | 7.000                          | 18                                           | 54                                              | 72             | 0,00                    |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                             | 20.12.2029            | 3.300                          | (534)                                        | 74                                              | (460)          | (0,01)                  |
|            | Romania Government International Bond            | 1,000                             | 20.12.2029            | 3.600                          | (157)                                        | 48                                              | (109)          | 0,00                    |
|            | Saudi Arabia Government International Bond       | 1,000                             | 20.06.2030            | 65.500                         | 924                                          | 35                                              | 959            | 0,02                    |
| CBK        | Benin Government International Bond              | 1,000                             | 20.06.2026            | 625                            | (23)                                         | 18                                              | (5)            | 0,00                    |
|            | Brazil Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2026            | 5.000                          | (237)                                        | 267                                             | 30             | 0,00                    |
|            | Brazil Government International Bond             | 1,000                             | 20.06.2035            | 2.500                          | (291)                                        | 17                                              | (274)          | (0,01)                  |
|            | Cote d'Ivoire                                    | 1,000                             | 20.06.2026            | 3.375                          | (111)                                        | 74                                              | (37)           | 0,00                    |
|            | Cote d'Ivoire                                    | 1,000                             | 20.06.2030            | 2.625                          | (331)                                        | 17                                              | (314)          | (0,01)                  |
|            | Dominican Republic Government International Bond | 1,000                             | 20.06.2030            | 7.000                          | (450)                                        | 202                                             | (248)          | (0,01)                  |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                             | 20.12.2026            | 6.000                          | 11                                           | 35                                              | 46             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                             | 20.06.2028            | 7.100                          | (8)                                          | 75                                              | 67             | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond             | 1,000                             | 20.06.2030            | 300                            | (13)                                         | 1                                               | (12)           | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                             | 20.06.2026            | 2.200                          | 19                                           | (4)                                             | 15             | 0,00                    |



| Kontrahent | Referenzeinheit                                  | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| DUB        | Peru Government International Bond               | 1,000 %                        | 20.06.2030            | \$ 32.900                      | \$ (197)                                     | \$ 479                                          | \$ 282         | 0,01                    |
|            | Turkey Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 10.000                         | (825)                                        | 30                                              | (795)          | (0,02)                  |
|            | Eskom Holdings SOC Ltd.                          | 4,650                          | 30.06.2029            | 16.000                         | 0                                            | 949                                             | 949            | 0,02                    |
|            | Indonesia Government International Bond          | 1,000                          | 20.06.2030            | 7.400                          | 0                                            | 77                                              | 77             | 0,00                    |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                          | 20.12.2029            | 600                            | (99)                                         | 15                                              | (84)           | 0,00                    |
| GLM        | Turkey Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 20.000                         | (1.651)                                      | 60                                              | (1.591)        | (0,03)                  |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                          | 20.12.2028            | 1.250                          | (270)                                        | 151                                             | (119)          | 0,00                    |
|            | Brazil Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2026            | 600                            | (32)                                         | 35                                              | 3              | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond              | 1,000                          | 20.12.2026            | 3.600                          | 33                                           | 8                                               | 41             | 0,00                    |
|            | Indonesia Government International Bond          | 1,000                          | 20.06.2030            | 64.800                         | 152                                          | 518                                             | 670            | 0,02                    |
| GST        | Israel Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2025            | 19.300                         | 21                                           | 37                                              | 58             | 0,00                    |
|            | Israel Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2026            | 3.850                          | 0                                            | 20                                              | 20             | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2025            | 10.000                         | 22                                           | (3)                                             | 19             | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 800                            | (34)                                         | 3                                               | (31)           | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                          | 20.06.2026            | 29.100                         | 118                                          | 81                                              | 199            | 0,01                    |
|            | Petroleos Mexicanos                              | 3,750                          | 24.12.2025            | 12.605                         | 0                                            | 20                                              | 20             | 0,00                    |
|            | Petroleos Mexicanos                              | 4,850                          | 07.05.2026            | 34.464                         | 0                                            | 423                                             | 423            | 0,01                    |
|            | Poland Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2029            | 22.200                         | 291                                          | 35                                              | 326            | 0,01                    |
|            | Qatar Government International Bond              | 1,000                          | 20.12.2029            | 55.500                         | 1.544                                        | 55                                              | 1.599          | 0,03                    |
|            | Saudi Arabia Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2030            | 68.000                         | 1.007                                        | (10)                                            | 997            | 0,02                    |
| JPM        | Turkiye Government International Bond            | 1,000                          | 20.06.2030            | 4.400                          | (434)                                        | 84                                              | (350)          | (0,01)                  |
|            | Chile Government International Bond              | 1,000                          | 20.12.2026            | 7.700                          | 41                                           | 47                                              | 88             | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond              | 1,000                          | 20.06.2027            | 10.000                         | (178)                                        | 326                                             | 148            | 0,00                    |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                          | 20.12.2025            | 8.700                          | (442)                                        | 337                                             | (105)          | 0,00                    |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                          | 20.12.2028            | 5.000                          | (1.157)                                      | 679                                             | (478)          | (0,01)                  |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                          | 20.06.2026            | 1.500                          | 13                                           | (3)                                             | 10             | 0,00                    |
|            | Turkey Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2029            | 6.700                          | (462)                                        | 10                                              | (452)          | (0,01)                  |
|            | Turkey Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 67.000                         | (6.433)                                      | 1.105                                           | (5.328)        | (0,11)                  |
|            | Brazil Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2027            | 8.200                          | (508)                                        | 564                                             | 56             | 0,00                    |
|            | Cote d'Ivoire                                    | 1,000                          | 20.06.2030            | 1.400                          | (175)                                        | 8                                               | (167)          | 0,00                    |
| MYC        | Dominican Republic Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2030            | 17.500                         | (1.170)                                      | 551                                             | (619)          | (0,01)                  |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2027            | 200                            | (1)                                          | 3                                               | 2              | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2028            | 3.000                          | (10)                                         | 38                                              | 28             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2029            | 600                            | (6)                                          | 7                                               | 1              | 0,00                    |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                          | 20.12.2028            | 5.000                          | (1.137)                                      | 659                                             | (478)          | (0,01)                  |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                          | 20.12.2029            | 5.000                          | (900)                                        | 203                                             | (697)          | (0,01)                  |
|            | Nigeria Government International Bond            | 1,000                          | 20.06.2030            | 500                            | (132)                                        | 52                                              | (80)           | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 500                            | (22)                                         | 3                                               | (19)           | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                          | 20.06.2026            | 37.300                         | 105                                          | 149                                             | 254            | 0,01                    |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                          | 20.12.2026            | 3.000                          | (10)                                         | 38                                              | 28             | 0,00                    |
| MYI        | Qatar Government International Bond              | 1,000                          | 20.12.2026            | 5.300                          | 77                                           | (11)                                            | 66             | 0,00                    |
|            | Turkey Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2028            | 20.200                         | (1.826)                                      | 938                                             | (888)          | (0,02)                  |
|            | Peru Government International Bond               | 1,000                          | 20.06.2026            | 2.700                          | 23                                           | (5)                                             | 18             | 0,00                    |
|            |                                                  |                                |                       |                                | \$ (18.268)                                  | \$ 12.168                                       | \$ (6.100)     | (0,13)                  |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD                    | 991                      | \$ 644                           | \$ 0                               | \$ (6)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 4.870                    | 676                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 1.032                    | 1.208                            | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 140                      | 84                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 88                       | € 78                             | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 08.2025               | CNH                    | 34.754                   | \$ 4.860                         | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 644                      | AUD 991                          | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | €                      | 1.211                    | € 1.032                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | €                      | 84                       | NZD 140                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | DOP                    | 213.867                  | \$ 3.576                         | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 430.872                  | 489.922                          | 0                                  | (15.858)                                             | (0,34)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 73.072.049               | 4.479                            | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 37.756                   | 10.392                           | 0                                  | (245)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 20                       | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.755                    | KRW 2.392.841                    | 14                                 | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 7.260                    | \$ 1.015                         | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TRY                    | 46.781                   | 1.091                            | 0                                  | (41)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 456                      | 14                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| BPS        | 08.2025               | \$                     | 4.984                    | CNH                              | 35.632                             | \$ 10                                                | 0,00                    |        |
|            | 08.2025               |                        | 16                       | SGD                              | 20                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 10.2025               |                        | 548                      | PEN                              | 2.026                              | 21                                                   | 0,00                    |        |
|            | 02.2026               | TRY                    | 271.187                  | \$                               | 5.671                              | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025               | RON                    | 45                       |                                  | 10                                 | (14)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 07.2025               | THB                    | 414                      |                                  | 13                                 | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025               | TRY                    | 59.530                   |                                  | 1.465                              | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025               | TWD                    | 92.280                   |                                  | 2.840                              | (11)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 07.2025               |                        |                          |                                  |                                    | (337)                                                | (0,01)                  |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.818                    | €                                | 2.467                              | 78                                                   | 0,00                    |        |
|            | 07.2025               |                        | 1.195                    | IDR                              | 19.495.514                         | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025               |                        | 840                      | THB                              | 27.795                             | 6                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025               | CNH                    | 26.460                   | \$                               | 3.704                              | 16                                                   | 0,00                    |        |
|            | 08.2025               | CZK                    | 2.279                    |                                  | 102                                | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025               | INR                    | 15.653                   |                                  | 180                                | (3)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025               | TRY                    | 69.972                   |                                  | 1.681                              | (6)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025               | TWD                    | 76.610                   |                                  | 2.350                              | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 5.041                    | CNH                              | 35.958                             | (17)                                                 | (0,01)                  |        |
|            | 08.2025               |                        | 223                      | TWD                              | 7.300                              | (312)                                                | 0,00                    |        |
|            | 05.2026               |                        | 3.950                    | KWD                              | 1.204                              | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 06.2026               |                        | 3.256                    |                                  | 994                                | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | BRC                   | 06.2027                |                          | 1.393                            |                                    | 423                                                  | (15)                    | 0,00   |
| 05.2029    |                       | KWD                    | 5.486                    | \$                               | 18.859                             | (6)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2029    |                       |                        | 1.333                    |                                  | 4.584                              | (12)                                                 | 0,02                    |        |
| 05.2030    |                       |                        | 3.875                    |                                  | 13.345                             | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | €                      | 24.199                   |                                  | 27.554                             | 199                                                  | 0,01                    |        |
| 07.2025    |                       | ILS                    | 2.773                    |                                  | 796                                | 0                                                    | (0,02)                  |        |
| 07.2025    |                       | KRW                    | 48.591                   |                                  | 35                                 | (852)                                                | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | NOK                    | 825                      |                                  | 81                                 | (27)                                                 | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | TRY                    | 301.247                  |                                  | 7.461                              | (1)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | \$                     | 1.946                    | €                                | 1.722                              | (1)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       |                        | 9.829                    | £                                | 7.224                              | (61)                                                 | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       |                        | 395                      | ILS                              | 1.333                              | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       |                        | 35                       | ¥                                | 4.976                              | 75                                                   | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       |                        | 64                       | KRW                              | 88.089                             | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       |                        | 254                      | PLN                              | 952                                | 1                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       |                        | 2.331                    | TRY                              | 95.341                             | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | ZAR                    | 587.670                  | \$                               | 32.511                             | 9                                                    | (0,01)                  |        |
| 08.2025    |                       | CZK                    | 22.493                   |                                  | 1.011                              | 0                                                    | (505)                   | 0,00   |
| 08.2025    |                       | £                      | 7.224                    |                                  | 9.830                              | (58)                                                 | (58)                    | 0,00   |
| 08.2025    |                       | TRY                    | 196.983                  |                                  | 4.726                              | (70)                                                 | (70)                    | 0,00   |
| 08.2025    |                       | \$                     | 931                      | CZK                              | 19.929                             | (51)                                                 | (51)                    | 0,00   |
| BSH        |                       | 08.2025                |                          | 16                               | TRY                                | 666                                                  | 17                      | 0,00   |
|            | 12.2025               | TRY                    | 115.897                  | \$                               | 2.410                              | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 02.2026               | \$                     | 5.671                    | TRY                              | 271.471                            | (130)                                                | (130)                   | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 3.171                    | PEN                              | 11.465                             | 0                                                    | 19                      | 0,00   |
|            | 09.2025               | PEN                    | 43.760                   | \$                               | 11.992                             | 60                                                   | 60                      | 0,00   |
|            | 09.2025               | \$                     | 70                       | PEN                              | 252                                | 0                                                    | (314)                   | (0,01) |
|            | 11.2025               |                        | 1.304                    |                                  | 4.821                              | 1                                                    | 1                       | 0,00   |
|            | 12.2025               | PEN                    | 11.508                   | \$                               | 3.171                              | 49                                                   | 49                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | €                      | 16.806                   |                                  | 19.460                             | 0                                                    | (58)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | KRW                    | 4.224.940                |                                  | 3.084                              | (58)                                                 | (267)                   | (0,01) |
| CBK        | 07.2025               | PEN                    | 32.746                   |                                  | 8.996                              | 0                                                    | (40)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | THB                    | 21.680                   |                                  | 652                                | 0                                                    | (228)                   | 0,00   |
|            | 07.2025               | TWD                    | 159.631                  |                                  | 4.907                              | 0                                                    | (16)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 398                      | IDR                              | 6.475.043                          | 0                                                    | (589)                   | (0,01) |
|            | 07.2025               |                        | 2.064                    | KRW                              | 2.837.441                          | 1                                                    | 1                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 336                      | THB                              | 11.218                             | 34                                                   | 34                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 12.214                   | TWD                              | 362.995                            | 9                                                    | 9                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | CNH                    | 1.551                    | \$                               | 216                                | 0                                                    | 282                     | 0,01   |
|            | 08.2025               | COP                    | 13.695.712               |                                  | 3.284                              | (2)                                                  | (2)                     | 0,00   |
|            | 08.2025               | INR                    | 98.181                   |                                  | 1.139                              | (51)                                                 | (51)                    | 0,00   |
| DUB        | 08.2025               | TWD                    | 178.247                  |                                  | 5.470                              | (4)                                                  | (3)                     | 0,00   |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.440                    | CNH                              | 10.419                             | 0                                                    | (726)                   | (0,02) |
|            | 08.2025               |                        | 33                       | EGP                              | 1.843                              | 20                                                   | 20                      | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 443                      | INR                              | 38.153                             | 3                                                    | 3                       | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 105                      | PEN                              | 379                                | 0                                                    | 1                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | PEN                    | 72                       | \$                               | 20                                 | 0                                                    | 1                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | \$                     | 462                      | KZT                              | 238.201                            | (1)                                                  | (1)                     | 0,00   |
|            | 12.2025               | PEN                    | 9.456                    | \$                               | 2.554                              | (13)                                                 | (13)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | ILS                    | 1.346                    |                                  | 388                                | 0                                                    | (99)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | KES                    | 19.932                   |                                  | 151                                | (11)                                                 | (11)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 541.710                  | €                                | 466.951                            | (3)                                                  | (3)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 5.690                    | KZT                              | 2.981.386                          | 6.420                                                | 6.420                   | 0,14   |
|            | 07.2025               |                        | 312                      | TWD                              | 9.259                              | 0                                                    | 8                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | €                      | 465.927                  | \$                               | 541.710                            | 7                                                    | 7                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | INR                    | 53.935                   |                                  | 625                                | 0                                                    | (6.412)                 | (0,14) |
|            | 09.2025               | MXN                    | 0                        |                                  | 0                                  | 1                                                    | (2)                     | 0,00   |
|            | 09.2025               | \$                     | 218                      | KZT                              | 114.828                            | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 10.2025               | EGP                    | 280.150                  | \$                               | 4.918                              | (2)                                                  | (2)                     | 0,00   |
|            | 11.2025               | PKR                    | 480.838                  |                                  | 1.624                              | (512)                                                | (512)                   | (0,01) |
|            | 12.2025               | UGX                    | 5.848.156                |                                  | 1.564                              | (34)                                                 | (34)                    | 0,00   |
| 12.2025    | \$                    | 979                    | KZT                      | 521.447                          | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |        |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    | (24)                                                 | 0,00                    |        |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| FAR        | 07.2025               | BRL                    | 7.146                    | \$ 1.250                         | \$ 0                               | \$ (59)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CHF                    | 835                      | 1.014                            | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 2.478                    | 345                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 1.567.911                | 10.772                           | 0                                  | (83)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 2.301                    | 624                              | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 30                       | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 640                      | AUD 991                          | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.297                    | BRL 7.164                        | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.041                    | CHF 834                          | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 19.138                   | ¥ 2.745.466                      | 0                                  | (131)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 10.566                   | PEN 37.762                       | 73                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CHF                    | 830                      | \$ 1.041                         | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 27.928                   | 3.903                            | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 25.831                   | 299                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 10.772                   | ¥ 1.562.145                      | 83                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 13                       | SGD 16                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | BRL                    | 7.274                    | \$ 1.297                         | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 907.594                  | 46.611                           | 0                                  | (1.043)                                              | (0,02)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 0                        | PEN 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               | PEN                    | 37.952                   | \$ 10.566                        | 0                                  | (76)                                                 | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025               | DOP                    | 625.512                  | 10.559                           | 132                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MYR                    | 8.412                    | 1.987                            | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 6                        | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 15.569                   | 479                              | 0                                  | (57)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 22                       | € 19                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 94                       | IDR 1.535.902                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 35                       | TWD 1.138                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 6.379                    | \$ 355                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    | 223.148                  | 3.467                            | 0                                  | (226)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 1.205.603                | 3.328                            | 0                                  | (203)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 5                        | SGD 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 154                      | TWD 5.049                        | 22                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | AED                    | 5.818                    | \$ 1.584                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | DOP                    | 848.690                  | 13.665                           | 126                                | (402)                                                | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 187                      | KZT 97.754                       | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 11.2025               | DOP                    | 91.202                   | \$ 1.509                         | 37                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 4.694                    | 650                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 351.825                  | 257                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PHP                    | 31.041                   | 556                              | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 4.151                    | 1.123                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 13                       | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 93.406                   | 2.872                            | 0                                  | (343)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 83                       | NZD 140                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.724                    | PLN 10.232                       | 107                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 113                      | SGD 146                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.517                    | TWD 45.055                       | 34                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 166.629                  | \$ 9.324                         | 0                                  | (38)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 32.789                   | 4.581                            | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 17.458                   | 201                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 92.552                   | 2.840                            | 0                                  | (377)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 5.024                    | CNH 35.908                       | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 08.2025               |                        | 10                       | SGD 13                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 585.294                  | \$ 10.295                        | 0                                  | (1.021)                                              | (0,02)                  |
|            | 11.2025               | PKR                    | 940.392                  | 3.177                            | 0                                  | (65)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2026               | EGP                    | 179.082                  | 2.902                            | 0                                  | (197)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CAD                    | 2.899                    | 2.110                            | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 2.250                    | 312                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 3.687                    | 4.232                            | 0                                  | (96)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PHP                    | 17.524                   | 314                              | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 353                      | 273                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 10.883                   | 329                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 44.907                   | 1.378                            | 0                                  | (168)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.109                    | CAD 2.900                        | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 7.046                    | € 6.098                          | 112                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.007                    | HKD 7.877                        | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 79                       | IDR 1.289.677                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 838                      | ¥ 120.430                        | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.954                    | PLN 7.315                        | 70                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 273                      | SGD 350                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 504                      | THB 16.808                       | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CAD                    | 2.895                    | \$ 2.109                         | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 10.944                   | 1.523                            | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 74.302                   | 2.296                            | 0                                  | (287)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 400                      | EGP 22.046                       | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 273                      | SGD 352                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 167.791                  | \$ 2.935                         | 0                                  | (315)                                                | (0,01)                  |
| MYI        | 07.2025               | €                      | 403                      | 463                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 17                       | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 499.520                  | 3.425                            | 0                                  | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 12                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 52                       | 41                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 65                       | € 55                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025               | \$                     | 762                      | £ 555                            | \$ 0                               | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 429                      | ¥ 62.019                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 774                      | NOK 7.807                        | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 28.465                   | \$ 3.976                         | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 7.806                    |                                  | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 3.425                    | ¥ 497.683                        | 33                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 220.772                  | \$ 3.880                         | 0                                  | (367)                                                | (0,01)                  |
|            | 10.2025               | \$                     | 3.255                    | EGP 185.866                      | 336                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 10.2026               |                        | 5.881                    | AZN 10.522                       | 33                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2027               |                        | 11.763                   | 21.644                           | 0                                  | (70)                                                 | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025               | €                      | 8                        | \$ 9                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.304                    | CNH 16.690                       | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | ILS                    | 20                       | \$ 6                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 620                      |                                  | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KES                    | 549.516                  |                                  | 0                                  | (84)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 70                       |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 36                       | € 31                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 438                      | IDR 7.143.004                    | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 13.614                   | TWD 402.875                      | 256                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 49.042                   | \$ 6.865                         | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 18.097                   |                                  | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 25.090                   |                                  | 0                                  | (103)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 7.275                    | CNH 52.626                       | 100                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 4                        | ¥ 617                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 55                       | SGD 70                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               |                        | 3.140                    | NGN 5.495.761                    | 307                                | 0                                                    | 0,01                    |
| SOG        | 12.2025               | UGX                    | 5.848.174                | \$ 1.564                         | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 72.463                   |                                  | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | RON                    | 1.852                    |                                  | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 109                      | € 95                             | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 81                       | NOK 813                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 56.903                   | \$ 157                           | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 104                      |                                  | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 813                      |                                  | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 502                      | ¥ 72.197                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | £                      | 7.224                    | \$ 9.781                         | 0                                  | (118)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 10.089                   | € 8.700                          | 124                                | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 11.2025               | PEN                    | 11.355                   | \$ 3.078                         | 0                                  | (111)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ILS                    | 204                      |                                  | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 7.795                    |                                  | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | RON                    | 1.404                    |                                  | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 1.766                    |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 280                      | ¥ 40.467                         | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 1.488                    | TRY 65.674                       | 106                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 544                      | MXN 10.538                       | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               |                        | 1.695                    | TRY 79.881                       | 94                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 12.2025               |                        | 2.410                    | 115.897                          | 130                                | 0                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025               | €                      | 9.059                    | \$ 10.608                        | 0                                  | (26)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 832.623                  |                                  | 17                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 10.221                   | € 8.697                          | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 5.782                    | ¥ 829.559                        | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 11.407                        | \$ (34.515)                        | \$ (23.108)                                          | (0,49)                  |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD 1.712              | \$ 1.112                 | \$ 0                             | \$ (10)                            | \$ (10)                                              | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 1.113               | AUD 1.712                | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025               | AUD 43                 | \$ 28                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 29                  | AUD 44                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | 999                    | 1.551                    | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | AUD 89                 | \$ 58                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | \$ 45                  | AUD 70                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               | AUD 1.702              | \$ 1.113                 | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 1.098               | AUD 1.701                | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 1.113                  | 1.702                    | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | AUD 1.519              | \$ 996                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 996                 | AUD 1.519                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | AUD 23                 | \$ 15                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 3                   | AUD 4                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025               | 1.108                  | 1.718                    | 18                               | 0                                  | 18                                                   | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 66                            | \$ (13)                            | \$ 53                                                | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CHF 6.118              | \$ 7.660                 | \$ 0                             | \$ (26)                            | \$ (26)                                              | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 7.660               | CHF 6.092                | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025               | CHF 7                  | \$ 8                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | \$ 166                 | CHF 135                  | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               | CHF 6.070              | \$ 7.582                 | 0                                | (43)                               | (43)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$ 7.244               | CHF 5.966                | 250                              | 0                                  | 250                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025               | 7.582                  | 6.045                    | 44                               | 0                                  | 44                                                   | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | 9                      | 7                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | 7.239                  | 5.949                    | 234                              | 0                                  | 234                                                  | 0,01                    |
| RBC        | 07.2025               | 6.774                  | 5.556                    | 205                              | 0                                  | 205                                                  | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 763                           | \$ (69)                            | \$ 694                                               | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 459.341              | \$ 537.833               | \$ 0                             | \$ (1.364)                         | \$ (1.364)                                           | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | \$ 539.012             | € 459.341                | 1.362                            | 0                                  | 1.362                                                | 0,03                    |
| BOA        | 07.2025               | 555.942                | 488.934                  | 17.993                           | 0                                  | 17.993                                               | 0,38                    |
| BPS        | 07.2025               | 721                    | 630                      | 18                               | 0                                  | 18                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | 571.330                | 502.996                  | 19.112                           | 0                                  | 19.112                                               | 0,41                    |
| CBK        | 07.2025               | € 11.567               | \$ 13.211                | 0                                | (367)                              | (367)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$ 19.243              | € 16.624                 | 272                              | 0                                  | 272                                                  | 0,01                    |
| DUB        | 07.2025               | € 511.262              | \$ 593.115               | 0                                | (7.030)                            | (7.030)                                              | (0,15)                  |
|            | 08.2025               | \$ 593.115             | € 510.141                | 7.021                            | 0                                  | 7.021                                                | 0,15                    |
| MBC        | 07.2025               | € 809                  | \$ 928                   | 0                                | (21)                               | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 27.596              | € 23.888                 | 444                              | 0                                  | 444                                                  | 0,01                    |
| WST        | 07.2025               | € 506.995              | \$ 594.527               | 0                                | (608)                              | (608)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$ 516.830             | € 457.485                | 20.188                           | 0                                  | 20.188                                               | 0,43                    |
|            | 08.2025               | 595.825                | 506.995                  | 609                              | 0                                  | 609                                                  | 0,01                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 67.019                        | \$ (9.390)                         | \$ 57.629                                            | 1,23                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £ 22.246               | \$ 30.526                | \$ 41                            | \$ 0                               | \$ 41                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 30.530              | £ 22.246                 | 0                                | (41)                               | (41)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | £ 25.363               | \$ 34.504                | 0                                | (252)                              | (252)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$ 31.659              | £ 23.447                 | 472                              | 0                                  | 472                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025               | 33.980                 | 24.971                   | 244                              | 0                                  | 244                                                  | 0,01                    |
| CBK        | 07.2025               | £ 892                  | \$ 1.213                 | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 731                 | £ 545                    | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | 32.842                 | 24.378                   | 565                              | 0                                  | 565                                                  | 0,01                    |
| MBC        | 07.2025               | £ 64                   | \$ 87                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 1.084               | £ 800                    | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | £ 24.794               | \$ 33.997                | 21                               | 0                                  | 21                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 32.751              | £ 24.188                 | 395                              | 0                                  | 395                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025               | 34.002                 | 24.794                   | 0                                | (21)                               | (21)                                                 | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 1.767                         | \$ (323)                           | \$ 1.444                                             | 0,03                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025               | NOK 1.849              | \$ 183                   | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 31                  | NOK 310                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | NOK 275                | \$ 27                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 93                  | NOK 943                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | NOK 349                | \$ 34                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 11.760              | NOK 119.773              | 76                               | (1)                                | 75                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 226                    | 2.302                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | 55                     | 558                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | NOK 110.381            | \$ 10.943                | 35                               | 0                                  | 35                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 11.870              | NOK 120.677              | 56                               | (1)                                | 55                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 10.943                 | 110.360                  | 0                                | (35)                               | (35)                                                 | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025               | NOK 291                | \$ 29                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 84                  | NOK 837                  | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | 198                    | 2.003                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025               | NOK 122.397            | \$ 12.191                | 96                               | 0                                  | 96                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 12.191              | NOK 122.373              | 0                                | (96)                               | (96)                                                 | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | 10.617                 | 107.821                  | 37                               | 0                                  | 37                                                   | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 302                           | \$ (135)                           | \$ 167                                               | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025               | \$ 9                   | SEK 90                   | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | 212                    | 2.034                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | SEK 44                 | \$ 5                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 5                   | SEK 52                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | SEK 32.743             | \$ 3.455                 | 19                               | 0                                  | 19                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 170                 | SEK 1.618                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 3.426                  | 32.402                   | 0                                | (19)                               | (19)                                                 | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               | 3.237                  | 31.001                   | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                    |
| IND        | 07.2025               | SEK 32.260             | \$ 3.410                 | 25                               | 0                                  | 25                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 3.410               | SEK 32.191               | 0                                | (25)                               | (25)                                                 | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | 2.843                  | 27.320                   | 24                               | 0                                  | 24                                                   | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025               | SEK 104                | \$ 11                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 51                  | SEK 495                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | 25                     | 239                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | 3.237                  | 31.100                   | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 113                           | \$ (44)                            | \$ 69                                                | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA                              | 07.2025               | SGD 5.171              | \$ 4.038                 | \$ 0                             | \$ (22)                            | \$ (22)                                              | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$ 4.038               | SGD 5.159                | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,00                    |
| BRC                              | 07.2025               | 44                     | 56                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| CBK                              | 07.2025               | SGD 42                 | \$ 33                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 311                 | SGD 398                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| DUB                              | 07.2025               | 4.877                  | 6.283                    | 56                               | 0                                  | 56                                                   | 0,00                    |
| FAR                              | 07.2025               | SGD 11.269             | \$ 8.836                 | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 9.899               | SGD 12.736               | 100                              | 0                                  | 100                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | 8.836                  | 11.242                   | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
| GLM                              | 07.2025               | SGD 4.938              | \$ 3.874                 | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$ 3.874               | SGD 4.926                | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
| JPM                              | 07.2025               | SGD 5.236              | \$ 4.089                 | 0                                | (22)                               | (22)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 10.908              | SGD 14.011               | 93                               | 0                                  | 93                                                   | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | 4.089                  | 5.224                    | 23                               | 0                                  | 23                                                   | 0,00                    |
| MBC                              | 07.2025               | SGD 13.046             | \$ 10.089                | 0                                | (154)                              | (154)                                                | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 8.051               | SGD 10.328               | 58                               | 0                                  | 58                                                   | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | 9.975                  | 12.869                   | 155                              | 0                                  | 155                                                  | 0,01                    |
| MYI                              | 07.2025               | 22                     | 28                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX                              | 07.2025               | SGD 2.194              | \$ 1.701                 | 0                                | (22)                               | (22)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$ 1.701               | SGD 2.189                | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,00                    |
| SSB                              | 07.2025               | 261                    | 333                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025               | 10                     | 12                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 549                           | \$ (235)                           | \$ 314                                               | 0,01                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 28.338                                            | 0,60                    |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 4.998.526                                         | 106,47                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (303.932)                                         | (6,47)                  |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 4.694.594                                         | 100,00                  |

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

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Nullkuponwertpapier.
- (e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (h) Mit dem Fonds verbunden.
- (i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## (j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,68 %):

| Emittentenbeschreibung                                        | Kauf-<br>datum | Kosten          | Markt-<br>wert  | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------------------------|----------------|-----------------|-----------------|-------------------------|
| Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 | 10.06.2022     | \$ 0            | \$ 0            | 0,00                    |
| DrillCo Holding Lux S.A.                                      | 08.06.2023     | 7.281           | 7.463           | 0,16                    |
|                                                               |                | <b>\$ 7.281</b> | <b>\$ 7.463</b> | <b>0,16</b>             |

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 323.965 USD (31. Dezember 2024: 456.318 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 1.790 USD) als Sicherheiten verpfändet.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 490 USD (31. Dezember 2024: 7.314 USD) und Barmittel in Höhe von 18.598 USD (31. Dezember 2024: 16.172 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 2.683 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.119 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 49.674 USD (31. Dezember 2024: 47.098 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 4.499.072                                                    | \$ 222.131                                                   | \$ 4.721.203        |
| Investmentfonds               | 230.592                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 230.592             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (314)                                                                       | 47.045                                                          | 0                                                            | 46.731              |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 230.278</b>                                                           | <b>\$ 4.546.117</b>                                             | <b>\$ 222.131</b>                                            | <b>\$ 4.998.526</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 4.314.986                                                    | \$ 168.405                                                   | \$ 4.483.391        |
| Investmentfonds               | 58.227                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 58.227              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (399)                                                                       | (15.496)                                                        | 1.118                                                        | (14.777)            |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 57.828</b>                                                            | <b>\$ 4.299.490</b>                                             | <b>\$ 169.523</b>                                            | <b>\$ 4.526.841</b> |

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

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

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

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC        | 1,750 %         | 16.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (14.516)        | \$ (17.052)                                                     | (0,36)                  |
|            | 2,750           | 30.01.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (3.153)        | (3.190)                                                         | (0,07)                  |
|            | 3,500           | 24.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (3.093)           | (3.095)                                                         | (0,07)                  |
|            | 3,750           | 23.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (3.220)           | (3.223)                                                         | (0,07)                  |
|            | 4,150           | 28.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.408)           | (2.425)                                                         | (0,05)                  |
|            | 4,150           | 09.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (5.960)           | (5.997)                                                         | (0,13)                  |
|            | 4,150           | 10.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (14.025)          | (14.059)                                                        | (0,30)                  |
|            | 4,200           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.067)           | (1.091)                                                         | (0,02)                  |
|            | 4,200           | 10.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (11.468)          | (11.578)                                                        | (0,25)                  |
|            | 4,350           | 14.01.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (541)             | (552)                                                           | (0,01)                  |
|            | 2,050           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (4.829)         | (5.675)                                                         | (0,12)                  |
|            | 4,000           | 24.01.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (1.789)        | (1.820)                                                         | (0,04)                  |
|            | 3,000           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (271)             | (271)                                                           | (0,01)                  |
| GSC        | 4,100           | 24.06.2025            | 01.08.2025            | (1.910)           | (1.911)                                                         | (0,04)                  |
|            | 4,200           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (1.341)           | (1.341)                                                         | (0,03)                  |
|            | 4,200           | 24.06.2025            | 01.08.2025            | (3.355)           | (3.357)                                                         | (0,07)                  |
|            | 4,250           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (893)             | (894)                                                           | (0,02)                  |
|            | 4,280           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (5.244)           | (5.249)                                                         | (0,11)                  |
|            | 4,280           | 24.06.2025            | 01.08.2025            | (1.819)           | (1.821)                                                         | (0,04)                  |
|            | 4,290           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (4.581)           | (4.585)                                                         | (0,10)                  |
|            | 4,300           | 26.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.924)           | (1.947)                                                         | (0,04)                  |
|            | 4,350           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (7.696)           | (7.704)                                                         | (0,16)                  |
|            | 1,900           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (159)           | (187)                                                           | 0,00                    |
| MYI        | 2,000           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (187)             | (220)                                                           | 0,00                    |
|            | 2,070           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (8.559)           | (10.059)                                                        | (0,21)                  |
|            | 2,080           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (941)             | (1.105)                                                         | (0,02)                  |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften |        | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|--------|-------------------------|
|                                    |                 |                       |                       |                   |                                                                 |        |                         |
| NOM                                | 3,250 %         | 23.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (3.436)        | \$ (3.449)                                                      | (0,07) |                         |
|                                    | 4,100           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (267)             | (273)                                                           | (0,01) |                         |
|                                    | 4,200           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.439)           | (1.471)                                                         | (0,03) |                         |
|                                    | 4,300           | 25.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (10.081)          | (10.161)                                                        | (0,22) |                         |
|                                    | 4,100           | 26.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (15.666)          | (15.675)                                                        | (0,33) |                         |
|                                    | 4,200           | 21.02.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (802)             | (802)                                                           | (0,02) |                         |
|                                    | 4,200           | 10.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (4.878)           | (4.887)                                                         | (0,10) |                         |
|                                    | 4,300           | 26.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (3.548)           | (3.550)                                                         | (0,08) |                         |
| SCX                                | 4,320           | 26.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.332)           | (1.333)                                                         | (0,03) |                         |
|                                    | 4,550           | 29.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (5.376)           | (5.419)                                                         | (0,12) |                         |
|                                    | 4,600           | 29.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (32.034)          | (32.292)                                                        | (0,69) |                         |
|                                    | 1,650           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (8.231)         | (9.671)                                                         | (0,21) |                         |
|                                    | 2,100           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (12.798)          | (15.041)                                                        | (0,32) |                         |
|                                    | 3,500           | 11.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (2.618)        | (2.639)                                                         | (0,06) |                         |
|                                    | 3,750           | 11.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.523)           | (2.544)                                                         | (0,05) |                         |
|                                    | 4,000           | 07.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.788)           | (1.805)                                                         | (0,04) |                         |
|                                    | 4,150           | 16.01.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.211)           | (2.253)                                                         | (0,05) |                         |
|                                    | 4,150           | 07.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.650)           | (1.666)                                                         | (0,04) |                         |
|                                    | 4,150           | 11.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.925)           | (1.943)                                                         | (0,04) |                         |
|                                    | 4,250           | 25.02.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (4.684)           | (4.753)                                                         | (0,10) |                         |
|                                    | 4,250           | 17.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (718)             | (720)                                                           | (0,01) |                         |
|                                    | 4,450           | 05.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.455)           | (2.463)                                                         | (0,05) |                         |
|                                    | 4,490           | 11.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.860)           | (2.888)                                                         | (0,06) |                         |
|                                    | 4,500           | 09.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (19.408)          | (19.609)                                                        | (0,42) |                         |
|                                    | 4,500           | 11.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (6.169)           | (6.232)                                                         | (0,13) |                         |
|                                    | 4,500           | 25.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (7.816)           | (7.881)                                                         | (0,17) |                         |
|                                    | 4,520           | 25.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (13.485)          | (13.599)                                                        | (0,29) |                         |
|                                    | 4,520           | 25.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (16.556)          | (16.695)                                                        | (0,36) |                         |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (302.122)                                                    | (6,44) |                         |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (14)                             | \$ 0                                  | \$ (14)                             | \$ 347                              | \$ (300)                              | \$ 47                               |
| BOA        | (1.075)                             | 1.356                                 | 281                                 | (1.437)                             | 1.209                                 | (228)                               |
| BPS        | 2.003                               | (2.010)                               | (7)                                 | 5.713                               | (4.400)                               | 1.313                               |
| BRC        | 18.562                              | (17.300)                              | 1.262                               | 5.716                               | (5.110)                               | 606                                 |
| BSH        | (262)                               | 0                                     | (262)                               | 31                                  | 0                                     | 31                                  |
| CBK        | (3.009)                             | 3.113                                 | 104                                 | 725                                 | (977)                                 | (252)                               |
| DUB        | (1.180)                             | 1.170                                 | (10)                                | (8.851)                             | 7.740                                 | (1.111)                             |
| FAR        | (903)                               | 900                                   | (3)                                 | (54)                                | 0                                     | (54)                                |
| GLM        | (940)                               | 1.220                                 | 280                                 | (3.378)                             | 3.986                                 | 608                                 |
| GST        | 4.148                               | (3.920)                               | 228                                 | 2.316                               | (2.330)                               | (14)                                |
| JPM        | (7.391)                             | 8.020                                 | 629                                 | 859                                 | (1.090)                               | (231)                               |
| MBC        | 61                                  | 78                                    | 139                                 | (1.939)                             | 1.413                                 | (526)                               |
| MYC        | (2.481)                             | 2.710                                 | 229                                 | (381)                               | 360                                   | (21)                                |
| MYI        | 6                                   | 0                                     | 6                                   | (15)                                | (100)                                 | (115)                               |
| RBC        | 205                                 | 0                                     | 205                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| RYL        | 34                                  | 0                                     | 34                                  | 66                                  | 0                                     | 66                                  |
| SCX        | 456                                 | (560)                                 | (104)                               | (8.630)                             | 7.508                                 | (1.122)                             |
| SOG        | (13)                                | 0                                     | (13)                                | 55                                  | 0                                     | 55                                  |
| SSB        | 290                                 | (310)                                 | (20)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (207)                               | 120                                   | (87)                                |
| UAG        | (350)                               | 521                                   | 171                                 | (925)                               | 1.150                                 | 225                                 |
| WST        | 20.191                              | (19.260)                              | 931                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 75,11             | 83,66             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 12,59             | 7,45              |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,20              | 0,27              |
| Investmentfonds                                                        | 4,29              | 1,19              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,38              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,48              | 0,42              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,71              | 0,59              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 5,24              | 6,42              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert   | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Angola                  | 0,75              | 0,64              |
| Argentinien             | 3,12              | 3,61              |
| Aserbaidshjan           | 1,08              | 0,97              |
| Bahrain                 | 0,45              | 0,31              |
| Benin                   | 0,06              | 0,15              |
| Bermuda                 | 0,05              | 0,03              |
| Brasilien               | 1,54              | 1,68              |
| Bulgarien               | 1,10              | 0,63              |
| Kamerun                 | 0,43              | 0,51              |
| Kanada                  | 0,13              | k. A.             |
| Kaimaninseln            | 3,04              | 3,56              |
| Chile                   | 2,88              | 3,27              |
| China                   | 0,00              | 0,00              |
| Kolumbien               | 3,34              | 2,58              |
| Costa Rica              | 0,04              | 0,20              |
| Tschechische Republik   | 0,34              | 0,32              |
| Dominikanische Republik | 2,76              | 3,31              |
| Ecuador                 | 1,36              | 1,34              |
| Ägypten                 | 3,17              | 1,73              |
| El Salvador             | 0,27              | 0,83              |
| Gabun                   | 0,32              | 0,08              |
| Georgien                | 0,01              | 0,01              |
| Ghana                   | 0,76              | 0,69              |
| Guatemala               | 1,07              | 1,21              |
| Honduras                | k. A.             | 0,24              |
| Hongkong                | 1,08              | 0,87              |
| Ungarn                  | 2,50              | 2,52              |
| Indien                  | 0,34              | 0,50              |
| Indonesien              | 3,30              | 2,85              |
| International           | 0,51              | 0,52              |
| Irak                    | 0,04              | 0,06              |
| Irland                  | 1,79              | 1,63              |
| Insel Man               | 0,00              | 0,01              |
| Israel                  | 1,28              | 2,45              |
| Italien                 | 0,07              | 0,07              |
| Elfenbeinküste          | 1,57              | 1,44              |
| Jamaika                 | 0,06              | 0,08              |
| Jordanien               | 0,21              | 0,41              |
| Kasachstan              | 0,92              | 0,81              |
| Kenia                   | 0,95              | 0,75              |
| Lettland                | 0,23              | 0,24              |
| Libanon                 | 0,20              | 0,10              |
| Luxemburg               | 2,49              | 2,09              |
| Mazedonien              | 0,19              | 0,20              |
| Malaysia                | 0,30              | 0,35              |
| Mexiko                  | 8,50              | 9,21              |
| Mongolei                | 0,37              | 0,46              |
| Marokko                 | 0,54              | 0,52              |
| Multinational           | k. A.             | 0,24              |
| Namibia                 | 0,33              | k. A.             |
| Niederlande             | 0,87              | 0,37              |
| Nigeria                 | 1,54              | 1,04              |
| Oman                    | 1,25              | 1,45              |
| Pakistan                | 1,25              | 1,26              |
| Panama                  | 1,57              | 1,80              |
| Paraguay                | 0,80              | 0,69              |
| Peru                    | 2,22              | 2,38              |
| Philippinen             | 1,03              | 0,60              |
| Polen                   | 1,31              | 0,86              |
| Katar                   | 1,42              | 1,42              |
| Rumänien                | 1,70              | 1,62              |
| Russland                | 0,00              | 0,00              |
| Rwanda                  | 0,07              | k. A.             |
| Saudi-Arabien           | 2,26              | 2,16              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Senegal                                                                                | 0,78              | 0,50              |
| Serbien                                                                                | 1,02              | 1,26              |
| Singapur                                                                               | 0,31              | 0,36              |
| Slowenien                                                                              | 0,25              | 0,30              |
| Südafrika                                                                              | 2,27              | 2,62              |
| Südkorea                                                                               | 0,30              | 0,54              |
| Sri Lanka                                                                              | 0,45              | 0,98              |
| Supranational                                                                          | 0,02              | 0,02              |
| Tajikistan                                                                             | 0,01              | k. A.             |
| Tansania                                                                               | 0,34              | 0,38              |
| Thailand                                                                               | 0,02              | 0,03              |
| Trinidad und Tobago                                                                    | 0,18              | 0,25              |
| Tunesien                                                                               | 0,03              | 0,50              |
| Türkei                                                                                 | 2,90              | 5,35              |
| Uganda                                                                                 | 0,13              | k. A.             |
| Ukraine                                                                                | 0,84              | 0,88              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 3,04              | 3,16              |
| Großbritannien                                                                         | 1,84              | 1,75              |
| USA                                                                                    | 7,38              | 9,48              |
| Uruguay                                                                                | 0,08              | 0,03              |
| Usbekistan                                                                             | 1,42              | 1,34              |
| Venezuela                                                                              | 0,93              | 0,88              |
| Jungfernseln (Britisch)                                                                | 0,15              | k. A.             |
| Sambia                                                                                 | 0,01              | 0,01              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 2,74              | 4,72              |
| Investmentfonds                                                                        | 4,91              | 1,39              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,41              | (0,23)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                                  | 0,01              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,03)            | 0,12              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,01              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | (0,01)            | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,07)            | (0,13)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | 0,01              | (0,03)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | (0,13)            | 0,11              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,49)            | 0,46              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,28              | (0,65)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (6,47)            | (8,31)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>ARGENTINIEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| Argentina Government International Bond                 |                |                          |                                   |
| 0,750 % fällig am 09.07.2030                            |                |                          |                                   |
| (i)                                                     | \$ 9.031       | \$ 7.175                 | 0,24                              |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029                            | 8.293          | 6.933                    | 0,23                              |
| 3,500 % fällig am 09.07.2041                            | 86.829         | 54.051                   | 1,80                              |
| 4,125 % fällig am 09.07.2035                            |                |                          |                                   |
| (i)                                                     | 4.979          | 3.349                    | 0,11                              |
| 5,000 % fällig am 09.01.2038                            |                |                          |                                   |
| (i)                                                     | 11.313         | 8.059                    | 0,27                              |
| Provincia de Buenos Aires                               |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 01.09.2037                            | 2.352          | 1.697                    | 0,06                              |
| Provincia de la Rioja                                   |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 24.02.2028                            | 425            | 283                      | 0,01                              |
| ^                                                       |                |                          |                                   |
| Provincia de Neuquen                                    |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 27.04.2030                            | 246            | 237                      | 0,01                              |
| Summe Argentinien                                       |                | 81.784                   | 2,73                              |
| <b>ÖSTERREICH</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| LD Celulose International GmbH                          |                |                          |                                   |
| 7,950 % fällig am 26.01.2032                            |                |                          |                                   |
| (i)                                                     | 10.000         | 10.531                   | 0,35                              |
| <b>BAHRAIN</b>                                          |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| Bahrain Government International Bond                   |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 25.01.2028                            | 13.900         | 13.378                   | 0,45                              |
| 5,250 % fällig am 25.01.2033                            | 3.000          | 2.744                    | 0,09                              |
| 5,625 % fällig am 30.09.2031                            | 9.200          | 8.751                    | 0,29                              |
| 6,000 % fällig am 19.09.2044                            | 1.300          | 1.077                    | 0,04                              |
| 7,500 % fällig am 07.07.2037                            | 6.600          | 6.681                    | 0,22                              |
| Summe Bahrain                                           |                | 32.631                   | 1,09                              |
| <b>BENIN</b>                                            |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| Benin Government International Bond                     |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 19.01.2032                            | € 523          | 548                      | 0,02                              |
| 4,950 % fällig am 22.01.2035                            | 16.200         | 16.256                   | 0,54                              |
| 6,875 % fällig am 19.01.2052                            | 1.200          | 1.180                    | 0,04                              |
| Summe Benin                                             |                | 17.984                   | 0,60                              |
| <b>BERMUDA</b>                                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| Star Energy Geothermal Darajat                          |                |                          |                                   |
| 4,850 % fällig am 14.10.2038                            | \$ 3.800       | 3.616                    | 0,12                              |
| <b>BRASILIEN</b>                                        |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| Banco do Brasil S.A.                                    |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 18.03.2031                            | 1.200          | 1.217                    | 0,04                              |
| Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais              |                |                          |                                   |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028                            | 6.783          | 6.759                    | 0,23                              |
| Caixa Economica Federal                                 |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 13.05.2030                            |                |                          |                                   |
| (i)                                                     | 6.300          | 6.299                    | 0,21                              |
| CSN Inova Ventures                                      |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 28.01.2028                            |                |                          |                                   |
| (i)                                                     | 6.100          | 5.772                    | 0,19                              |
| 6,750 % fällig am 28.01.2028                            | 2.200          | 2.082                    | 0,07                              |
| Rede D'or Finance SARL                                  |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 22.01.2030                            | 263            | 250                      | 0,01                              |
| St Marys Cement, Inc. Canada                            |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 02.04.2034                            |                |                          |                                   |
| (i)                                                     | 10.500         | 10.632                   | 0,36                              |
| Suzano Austria GmbH                                     |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 15.01.2032                            | 3.000          | 2.647                    | 0,09                              |
| Unigel Luxembourg S.A. (11,000 % bar oder 12,000 % PIK) |                |                          |                                   |
| 11,000 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 31.12.2028 ^ (b)                                        | 2.590          | 724                      | 0,02                              |
| Unigel Luxembourg S.A. (13,500 % bar oder 15,000 % PIK) |                |                          |                                   |
| 13,500 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
| 31.12.2027 ^ (b)                                        | 1.217          | 979                      | 0,03                              |
| Summe Brasilien                                         |                | 37.361                   | 1,25                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| Brazil Government International Bond                    |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 14.01.2050                            | 2.075          | 1.468                    | 0,05                              |

| BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 6,250 % fällig am 18.03.2031                             | \$ 29.000      | \$ 30.040                | 1,00                              |
| 7,125 % fällig am 13.05.2054                             | 7.500          | 7.201                    | 0,24                              |
|                                                          |                | 38.709                   | 1,29                              |
| Summe Brasilien                                          |                | 76.070                   | 2,54                              |
| <b>BULGARIEN</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                          |                                   |
| Bulgaria Government International Bond                   |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 07.05.2034                             | € 6.000        | 7.124                    | 0,24                              |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038                             | 6.000          | 7.182                    | 0,24                              |
| Summe Bulgarien                                          |                | 14.306                   | 0,48                              |
| <b>KAIMANINSELN</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                  |                |                          |                                   |
| Betony CLO Ltd.                                          |                |                          |                                   |
| 5,621 % fällig am 30.04.2031                             | \$ 366         | 366                      | 0,01                              |
| KKR CLO Ltd.                                             |                |                          |                                   |
| 5,518 % fällig am 15.04.2031                             | 342            | 342                      | 0,01                              |
| Voya CLO Ltd.                                            |                |                          |                                   |
| 5,481 % fällig am 19.04.2031                             | 389            | 390                      | 0,02                              |
|                                                          |                | 1.098                    | 0,04                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   |
| Adib Sukuk Co. Ltd.                                      |                |                          |                                   |
| 5,695 % fällig am 15.11.2028                             | 10.000         | 10.404                   | 0,35                              |
| Alibaba Group Holding Ltd.                               |                |                          |                                   |
| 2,700 % fällig am 09.02.2041                             | 3.000          | 2.094                    | 0,07                              |
| Baidu, Inc.                                              |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 23.08.2031                             | 1.900          | 1.694                    | 0,06                              |
| Biocceanico Sovereign Certificate Ltd.                   |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 05.06.2034                             |                |                          |                                   |
| (d)                                                      | 3.848          | 3.063                    | 0,10                              |
| CIFI Holdings Group Co. Ltd.                             |                |                          |                                   |
| 4,450 % fällig am 17.08.2026 ^                           | 2.900          | 268                      | 0,01                              |
| Country Garden Holdings Co. Ltd.                         |                |                          |                                   |
| 2,700 % fällig am 12.07.2026 ^                           | 2.300          | 181                      | 0,01                              |
| 3,875 % fällig am 22.10.2030 ^                           | 1.800          | 141                      | 0,00                              |
| FWD Group Holdings Ltd.                                  |                |                          |                                   |
| 7,635 % fällig am 02.07.2031                             | 5.100          | 5.594                    | 0,19                              |
| Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.            |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 15.07.2031                             | 13.000         | 11.381                   | 0,38                              |
| Interoceanica Finance Ltd.                               |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025                             |                |                          |                                   |
| (d)                                                      | 46             | 45                       | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am 15.05.2030                             |                |                          |                                   |
| (d)                                                      | 1.792          | 1.473                    | 0,05                              |
| 7,860 % fällig am 15.05.2030                             | 2.040          | 2.117                    | 0,07                              |
| Kaisa Group Holdings Ltd.                                |                |                          |                                   |
| 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^                           | 1.850          | 83                       | 0,00                              |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^                           | 300            | 13                       | 0,00                              |
| 11,250 % fällig am 09.04.2022                            |                |                          |                                   |
| ^                                                        | 1.000          | 45                       | 0,00                              |
| 11,500 % fällig am 30.01.2023                            |                |                          |                                   |
| ^                                                        | 200            | 9                        | 0,00                              |
| 11,650 % fällig am 01.06.2026                            |                |                          |                                   |
| ^                                                        | 3.600          | 162                      | 0,01                              |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025                            |                |                          |                                   |
| ^                                                        | 1.450          | 65                       | 0,00                              |
| 11,950 % fällig am 12.11.2023                            |                |                          |                                   |
| ^                                                        | 300            | 14                       | 0,00                              |
| Kingston Airport Revenue Finance Ltd.                    |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 15.12.2036                             | 2.700          | 2.717                    | 0,09                              |
| Lima Metro Line Finance Ltd.                             |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034                             | 398            | 404                      | 0,01                              |
| MAF Sukuk Ltd.                                           |                |                          |                                   |
| 4,638 % fällig am 14.05.2029                             | 3.600          | 3.581                    | 0,12                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % bar oder 6,000 % PIK) |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 30.09.2026                             |                |                          |                                   |
| ^ (b)                                                    | 433            | 53                       | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK) |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 30.09.2027                             |                |                          |                                   |
| ^ (b)                                                    | 434            | 54                       | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK) |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 30.09.2027                             |                |                          |                                   |
| ^ (b)                                                    | 869            | 109                      | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK) |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 30.09.2028                             |                |                          |                                   |
| ^ (b)                                                    | 1.307          | 163                      | 0,01                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 30.09.2029                             |                |                          |                                   |
| ^ (b)                                                    | 1.310          | 164                      | 0,01                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK) |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 30.09.2030                             |                |                          |                                   |
| ^ (b)                                                    | 617            | 76                       | 0,00                              |
| TIB Diversified Payment Rights Finance Co.               |                |                          |                                   |
| 7,226 % fällig am 15.11.2034                             | 5.400          | 5.401                    | 0,18                              |
| Xiaomi Best Time International Ltd.                      |                |                          |                                   |
| 4,100 % fällig am 14.07.2051                             | 9.500          | 7.353                    | 0,25                              |
| Summe Kaimaninseln                                       |                | 58.921                   | 1,97                              |

| BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                          |                                   |
| RAK Capital                                              |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 12.03.2035                             | \$ 7.200       | \$ 7.302                 | 0,24                              |
| Summe Kaimaninseln                                       |                | 67.321                   | 2,25                              |
| <b>CHILE</b>                                             |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   |
| Banco de Credito e Inversiones S.A.                      |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am                                        |                |                          |                                   |
| 12.12.2034 (g)(i)(h)                                     | 12.900         | 12.952                   | 0,43                              |
| Banco del Estado de Chile                                |                |                          |                                   |
| 7,950 % fällig am                                        |                |                          |                                   |
| 02.05.2029 (g)(i)(h)                                     | 5.000          | 5.209                    | 0,17                              |
| Caja de Compensacion de Asignacion Familiar de Los Andes |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 30.07.2029                             | 15.200         | 15.914                   | 0,53                              |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile                        |                |                          |                                   |
| 3,700 % fällig am 30.01.2050                             | 700            | 475                      | 0,02                              |
| 4,375 % fällig am 05.02.2049                             | 200            | 152                      | 0,01                              |
| 4,500 % fällig am 01.08.2047                             | 500            | 391                      | 0,01                              |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044                             | 300            | 251                      | 0,01                              |
| 5,950 % fällig am 08.01.2034                             | 1.400          | 1.430                    | 0,05                              |
| 6,300 % fällig am 08.09.2053                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 2.500          | 2.455                    | 0,08                              |
| 6,330 % fällig am 13.01.2035                             | 4.600          | 4.785                    | 0,16                              |
| 6,780 % fällig am 13.01.2055                             | 4.300          | 4.414                    | 0,15                              |
| Empresa de los Ferrocarriles del Estado                  |                |                          |                                   |
| 3,068 % fällig am 18.08.2050                             | 600            | 356                      | 0,01                              |
| 3,830 % fällig am 14.09.2061                             | 2.300          | 1.473                    | 0,05                              |
| Engie Energia Chile S.A.                                 |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 17.04.2034                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 14.900         | 15.469                   | 0,52                              |
| Inversiones CMPC S.A.                                    |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 26.02.2034                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 10.000         | 10.261                   | 0,34                              |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.                  |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 07.11.2033                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 12.100         | 12.854                   | 0,43                              |
| Summe Chile                                              |                | 88.841                   | 2,97                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                          |                                   |
| Chile Government International Bond                      |                |                          |                                   |
| 3,100 % fällig am 07.05.2041                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 1.400          | 1.044                    | 0,03                              |
| 3,100 % fällig am 22.01.2061                             | 7.900          | 4.805                    | 0,16                              |
| 3,250 % fällig am 21.09.2071                             | 4.800          | 2.925                    | 0,10                              |
| 3,500 % fällig am 25.01.2050                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 8.600          | 6.137                    | 0,20                              |
| 3,500 % fällig am 15.04.2053                             |                |                          |                                   |
| (i)                                                      | 12.600         | 8.834                    | 0,30                              |
| 4,340 % fällig am 07.03.2042                             | 7.700          | 6.684                    | 0,22                              |
| 4,950 % fällig am 05.01.2036                             | 2.000          | 1.965                    | 0,07                              |
|                                                          |                | 32.394                   | 1,08                              |
| Summe Chile                                              |                | 121.235                  | 4,05                              |
| <b>CHINA</b>                                             |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   |
| Yango Justice International Ltd.                         |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 17.02.2025 ^                           | 3.300          | 17                       | 0,00                              |
| 7,875 % fällig am 04.09.2024 ^                           | 2.000          | 10                       | 0,00                              |
| Summe China                                              |                | 27                       | 0,00                              |
| <b>KOLUMBIEN</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |                |                          |                                   |
| Banco Davivienda S.A.                                    |                |                          |                                   |
| 6,650 % fällig am 22.04.2031                             |                |                          |                                   |
| (g)(h)                                                   | 4.620          | 4.116                    | 0,14                              |
| 8,125 % fällig am 02.07.2035                             |                |                          |                                   |
| (a)(h)                                                   | 5.100          | 5.129                    | 0,17                              |
| Summe Kolumbien                                          |                | 9.245                    | 0,31                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |                |                          |                                   |
| Colombia Government International Bond                   |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 22.04.2032                             | 22.600         | 17.932                   | 0,60                              |
| 3,875 % fällig am 22.03.2026                             | € 1.300        | 1.533                    | 0,05                              |
| 8,000 % fällig am 14.11.2035                             | \$ 31.300      | 31.513                   | 1,05                              |
| 8,375 % fällig am 07.11.2054                             | 1.500          | 1.429                    | 0,05                              |
| 8,500 % fällig am 25.04.2035                             | 13.400         | 13.936                   | 0,46                              |
| 8,750 % fällig am 14.11.2053                             | 25.000         | 24.821                   | 0,83                              |
|                                                          |                | 91.164                   | 3,04                              |
| Summe Kolumbien                                          |                | 100.409                  | 3,35                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>COSTA RICA<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   | <b>EL SALVADOR<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   |
| Costa Rica Government International Bond                           |                |                          |                                   | El Salvador Government International Bond                         |                |                          |                                   | Hong Kong Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043 \$                                    | 18.950         | \$ 17.036                | 0,57                              | 8,500 % fällig am 31.01.2047                                      | \$ 2.000       | \$ 1.625                 | 0,05                              | 2,375 % fällig am 02.02.2051                       | \$ 1.200       | \$ 749                   | 0,03                              |
| 7,158 % fällig am 12.03.2045                                       | 2.400          | 2.484                    | 0,08                              | 8,750 % fällig am 30.09.2051                                      | 8.500          | 6.986                    | 0,23                              | 3,750 % fällig am 07.06.2032                       | € 6.800        | 8.365                    | 0,28                              |
| 7,300 % fällig am 13.11.2054                                       | 4.200          | 4.361                    | 0,15                              | 21,954 % fällig am 04.03.2028                                     | EGP 1.286.900  | 25.622                   | 0,86                              | 5,250 % fällig am 11.01.2053                       | \$ 3.500       | 3.619                    | 0,12                              |
| Summe Costa Rica                                                   |                | 23.881                   | 0,80                              | Summe Ägypten                                                     |                | 96.807                   | 3,23                              | Summe Hongkong                                     |                | 12.733                   | 0,43                              |
| <b>ZYPERN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | <b>ESTLAND<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>               |                |                          |                                   | <b>UNGARN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Atrium Finance PLC                                                 |                |                          |                                   | Eesti Energia A/S                                                 |                |                          |                                   | MVM Energetika Zrt                                 |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027 €                                     | 8.000          | 8.646                    | 0,29                              | 7,875 % fällig am 15.07.2029 (g)                                  | € 10.000       | 12.215                   | 0,41                              | 7,500 % fällig am 09.06.2028                       | 4.400          | 4.638                    | 0,16                              |
| <b>TSSCHECHISCHE REPUBLIK<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | <b>FRANKREICH<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   |
| EPH Financing International A/S                                    |                |                          |                                   | New Immo Holding S.A.                                             |                |                          |                                   | Hungary Government International Bond              |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 30.11.2029                                       | 7.100          | 8.916                    | 0,30                              | 2,750 % fällig am 26.11.2026                                      | 1.700          | 1.969                    | 0,06                              | 1,625 % fällig am 28.04.2032                       | € 1.200        | 1.227                    | 0,04                              |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                |                |                          |                                   | <b>GABUN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 05.06.2035 (i)                   | 10.200         | 9.513                    | 0,32                              |
| Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik                      |                |                          |                                   | Gabon Government International Bond                               |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 21.09.2051 (i)                   | \$ 3.750       | 2.219                    | 0,07                              |
| 13,000 % fällig am 05.12.2025                                      | DOP 170.200    | 2.838                    | 0,09                              | 6,625 % fällig am 06.02.2031                                      | \$ 200         | 160                      | 0,01                              | 3,125 % fällig am 21.09.2051                       | 3.850          | 2.279                    | 0,08                              |
| 13,000 % fällig am 30.01.2026                                      | 107.500        | 1.790                    | 0,06                              | 9,500 % fällig am 18.02.2029                                      | 12.000         | 10.993                   | 0,36                              | 4,000 % fällig am 25.07.2029                       | € 11.700       | 14.116                   | 0,47                              |
| Dominican Republic Government International Bond                   |                |                          |                                   | Summe Gabun                                                       |                | 11.153                   | 0,37                              | 4,875 % fällig am 22.03.2040                       | 13.000         | 14.941                   | 0,50                              |
| 4,500 % fällig am 30.01.2030                                       | \$ 3.000       | 2.856                    | 0,10                              | <b>GEORGIEN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 16.06.2029                       | \$ 4.400       | 4.441                    | 0,15                              |
| 4,875 % fällig am 23.09.2032                                       | 2.000          | 1.852                    | 0,06                              | Georgian Railway JSC                                              |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 26.09.2030                       | 4.300          | 4.345                    | 0,14                              |
| 5,300 % fällig am 21.01.2041                                       | 7.100          | 6.139                    | 0,20                              | 4,000 % fällig am 17.06.2028                                      | 10.700         | 9.655                    | 0,32                              | 5,375 % fällig am 12.09.2033                       | € 1.600        | 2.025                    | 0,07                              |
| 5,500 % fällig am 22.02.2029                                       | 8.800          | 8.783                    | 0,29                              | <b>GHANA<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 16.06.2034 (i)                   | \$ 8.100       | 7.962                    | 0,26                              |
| 5,875 % fällig am 30.01.2060                                       | 29.500         | 24.835                   | 0,83                              | Ghana Government International Bond                               |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 26.03.2036                       | 12.400         | 11.977                   | 0,40                              |
| 6,000 % fällig am 19.07.2028                                       | 1.520          | 1.546                    | 0,05                              | 8,350 % fällig am 16.02.2027                                      | GHS 14.200     | 1.178                    | 0,04                              | 6,000 % fällig am 26.09.2035                       | 3.400          | 3.422                    | 0,11                              |
| 6,400 % fällig am 05.06.2049 (i)                                   | 2.500          | 2.346                    | 0,08                              | 8,950 % fällig am 11.02.2031                                      | 12.000         | 739                      | 0,02                              | 6,750 % fällig am 25.09.2052                       | 14.400         | 14.691                   | 0,49                              |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048                                       | 200            | 190                      | 0,01                              | Ghana Government International Bond                               |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 23.09.2055                       | 2.300          | 2.319                    | 0,08                              |
| 6,600 % fällig am 01.06.2036                                       | 22.400         | 22.589                   | 0,75                              | 0,000 % fällig am 03.01.2030 (d)                                  | \$ 4.788       | 4.013                    | 0,13                              | 7,625 % fällig am 29.03.2041                       | 500            | 565                      | 0,02                              |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 (i)                                   | 2.800          | 2.777                    | 0,09                              | 1,500 % fällig am 03.01.2037                                      | 10.100         | 4.646                    | 0,16                              | Magyar Export-Import Bank                          |                |                          |                                   |
| 6,950 % fällig am 15.03.2037                                       | 5.500          | 5.600                    | 0,19                              | 5,000 % fällig am 03.07.2029                                      | 18.650         | 17.531                   | 0,59                              | 6,000 % fällig am 16.05.2029                       | € 6.200        | 7.863                    | 0,26                              |
| 7,150 % fällig am 24.02.2055                                       | 5.100          | 5.098                    | 0,17                              | 5,000 % fällig am 03.07.2035                                      | 8.418          | 6.570                    | 0,22                              | 6,125 % fällig am 04.12.2027                       | \$ 4.000       | 4.097                    | 0,14                              |
| 10,500 % fällig am 15.03.2037                                      | DOP 1.407.000  | 23.937                   | 0,80                              | Summe Ghana                                                       |                | 34.677                   | 1,16                              | MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt                    |                |                          |                                   |
| 10,750 % fällig am 01.06.2036                                      | 326.000        | 5.637                    | 0,19                              | <b>GUERNSEY, KANALINSELN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 29.06.2028                       | 10.700         | 11.097                   | 0,37                              |
| 11,250 % fällig am 15.09.2035                                      | 14.900         | 265                      | 0,01                              | Globalworth Real Estate Investments Ltd.                          |                |                          |                                   | Summe Ungarn                                       |                | 119.099                  | 3,97                              |
| 13,625 % fällig am 03.02.2033                                      | 65.300         | 1.284                    | 0,04                              | 6,250 % fällig am 31.03.2030                                      | € 1.570        | 1.876                    | 0,06                              | Summe Indien                                       |                | 123.737                  | 4,13                              |
| 13,625 % fällig am 10.02.2034                                      | 113.700        | 2.292                    | 0,08                              | <b>HONGKONG<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | <b>INDIEN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Summe Dominikanische Republik                                      |                | 122.654                  | 4,09                              | AIA Group Ltd.                                                    |                |                          |                                   | IIFL Finance Ltd.                                  |                |                          |                                   |
| <b>ECUADOR<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                                |                |                          |                                   | 3,200 % fällig am 16.09.2040                                      | \$ 200         | 154                      | 0,01                              | 8,750 % fällig am 24.07.2028                       | 4.000          | 4.027                    | 0,13                              |
| Ecuador Government International Bond                              |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 30.09.2054                                      | 5.000          | 4.683                    | 0,16                              | Indian Railway Finance Corp. Ltd.                  |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)                                   | \$ 9.786       | 7.134                    | 0,23                              | Fortune Star BVI Ltd.                                             |                |                          |                                   | 3,570 % fällig am 21.01.2032                       | 15.700         | 14.451                   | 0,48                              |
| 5,000 % fällig am 31.07.2040                                       | 500            | 316                      | 0,01                              | 3,950 % fällig am 02.10.2026                                      | € 4.000        | 4.555                    | 0,15                              | 3,835 % fällig am 13.12.2027                       | 3.500          | 3.440                    | 0,12                              |
| 5,500 % fällig am 31.07.2035                                       | 47.918         | 35.004                   | 1,17                              | 5,000 % fällig am 18.05.2026                                      | \$ 1.100       | 1.081                    | 0,03                              | ReNew Pvt Ltd.                                     |                |                          |                                   |
| 6,900 % fällig am 31.07.2030                                       | 23.788         | 20.695                   | 0,69                              | 5,050 % fällig am 27.01.2027 (i)                                  | 3.100          | 2.986                    | 0,10                              | 5,875 % fällig am 05.03.2027                       | 1.202          | 1.194                    | 0,04                              |
| Ecuador Social Bond SARL                                           |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 19.05.2028                                      | 4.800          | 4.833                    | 0,16                              | ReNew Wind Energy AP2                              |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 30.01.2035 (d)                                   | 5.406          | 3.839                    | 0,13                              | Lenovo Group Ltd.                                                 |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 14.07.2028                       | 10.000         | 9.498                    | 0,32                              |
| Summe Ecuador                                                      |                | 66.988                   | 2,23                              | 6,536 % fällig am 27.07.2032 (i)                                  | 6.800          | 7.276                    | 0,24                              | SAEL Ltd.                                          |                |                          |                                   |
| <b>ÄGYPTEN<br/>STAATSEMISSIONEN</b>                                |                |                          |                                   | MTR Corp. Ltd.                                                    |                |                          |                                   | 7,800 % fällig am 31.07.2031                       | 10.198         | 9.945                    | 0,33                              |
| Egypt Government International Bond                                |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 01.04.2055                                      | 13.800         | 13.531                   | 0,45                              | Summe Indien                                       |                | 42.555                   | 1,42                              |
| 4,750 % fällig am 16.04.2026                                       | € 1.000        | 1.183                    | 0,04                              | <b>INDONESIEN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 06.10.2025                                       | \$ 10.200      | 10.187                   | 0,34                              | Bank Mandiri Persero Tbk PT                                       |                |                          |                                   | Indonesia Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031                                       | € 14.200       | 15.503                   | 0,52                              | 2,000 % fällig am 19.04.2026                                      | 6.700          | 6.566                    | 0,22                              | 1,300 % fällig am 23.03.2034                       | € 18.200       | 17.672                   | 0,59                              |
| 7,053 % fällig am 15.01.2032                                       | \$ 5.400       | 4.953                    | 0,17                              | 4,900 % fällig am 24.03.2028                                      | 6.600          | 6.642                    | 0,22                              | 3,875 % fällig am 15.01.2033                       | 4.600          | 5.510                    | 0,18                              |
| 7,300 % fällig am 30.09.2033                                       | 5.800          | 5.160                    | 0,17                              | Summe Indonesien                                                  |                | 13.208                   | 0,44                              | 4,125 % fällig am 15.01.2037                       | 4.600          | 5.470                    | 0,18                              |
| 7,500 % fällig am 16.02.2061                                       | 12.600         | 9.189                    | 0,31                              | <b>INDONESIEN<br/>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | 5,650 % fällig am 11.01.2053                       | \$ 700         | 694                      | 0,02                              |
| 7,625 % fällig am 29.05.2032                                       | 11.700         | 10.851                   | 0,36                              | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia                                |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 12.10.2035                       | 1.055          | 1.337                    | 0,05                              |
| 7,903 % fällig am 21.02.2048                                       | 3.700          | 2.846                    | 0,09                              | 3,550 % fällig am 09.06.2051 (i)                                  | 5.500          | 3.925                    | 0,13                              | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia                 |                |                          |                                   |
| 8,150 % fällig am 20.11.2059                                       | 3.500          | 2.702                    | 0,09                              | 3,550 % fällig am 09.06.2051                                      | 3.600          | 2.569                    | 0,09                              | 3,550 % fällig am 09.06.2051                       | 27.800         | 27.887                   | 0,93                              |
|                                                                    |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 06.06.2032                                      | 200            | 197                      | 0,01                              | 5,650 % fällig am 25.11.2054                       | 200            |                          |                                   |
|                                                                    |                |                          |                                   | Summe Indonesien                                                  |                | 78.469                   | 2,62                              |                                                    |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>INTERNATIONAL</b>                                                               |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                          |                |                          |                                   |
| Project Mercury<br>0,400 % - 6.668 % fällig<br>am 11.08.2030                       | € 4.800        | \$ 5.819                 | 0,19                              |
| Republik Senegal<br>TBD % fällig am<br>22.12.2028                                  | 6.000          | 6.176                    | 0,21                              |
| Summe International                                                                |                | 11.995                   | 0,40                              |
| <b>IRLAND</b>                                                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                            |                |                          |                                   |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC<br>5,950 % fällig am<br>15.04.2030 ^ (h)   | \$ 3.900       | 234                      | 0,01                              |
| CIMA Finance DAC<br>2,950 % fällig am<br>05.09.2029                                | 4.336          | 3.989                    | 0,13                              |
| Iridium Capital PLC<br>9,250 % fällig am<br>18.06.2029                             | € 17.800       | 22.670                   | 0,76                              |
| Sovcombank Via SovCom Capital DAC<br>3,400 % fällig am<br>26.01.2025 ^             | \$ 5.400       | 146                      | 0,00                              |
|                                                                                    |                | 27.039                   | 0,90                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                          |                |                          |                                   |
| Republic of Panama<br>4,103 % fällig am<br>05.03.2027                              | € 13.200       | 15.607                   | 0,52                              |
| Summe Irland                                                                       |                | 42.646                   | 1,42                              |
| <b>ELFENBEINKÜSTE</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                          |                |                          |                                   |
| Republik Elfenbeinküste<br>TBD % fällig am<br>06.03.2026                           | 17.600         | 20.584                   | 0,69                              |
| TBD % fällig am<br>18.03.2026                                                      | 4.600          | 5.356                    | 0,18                              |
|                                                                                    |                | 25.940                   | 0,87                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                            |                |                          |                                   |
| Ivory Coast Government International Bond<br>4,875 % fällig am<br>30.01.2032       | 4.400          | 4.637                    | 0,15                              |
| 5,250 % fällig am<br>22.03.2030                                                    | 5.500          | 6.184                    | 0,21                              |
| 5,875 % fällig am<br>17.10.2031                                                    | 5.400          | 6.005                    | 0,20                              |
| 6,625 % fällig am<br>22.03.2048                                                    | 3.900          | 3.584                    | 0,12                              |
| 6,875 % fällig am<br>17.10.2040                                                    | 1.700          | 1.701                    | 0,06                              |
| 7,625 % fällig am<br>30.01.2033                                                    | \$ 16.400      | 16.215                   | 0,54                              |
| 8,075 % fällig am<br>01.04.2036                                                    | 2.200          | 2.126                    | 0,07                              |
| 8,250 % fällig am<br>30.01.2037                                                    | 10.700         | 10.334                   | 0,34                              |
|                                                                                    |                | 50.786                   | 1,69                              |
| Summe Elfenbeinküste                                                               |                | 76.726                   | 2,56                              |
| <b>JAMAICA</b>                                                                     |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                            |                |                          |                                   |
| Jamaica Government International Bond<br>7,875 % fällig am<br>28.07.2045           | 2.600          | 3.042                    | 0,10                              |
| <b>JORDANIEN</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                            |                |                          |                                   |
| Jordan Government International Bond<br>5,750 % fällig am<br>31.01.2027 (i)        | 300            | 299                      | 0,01                              |
| 7,500 % fällig am<br>13.01.2029                                                    | 6.900          | 7.094                    | 0,24                              |
| Summe Jordanien                                                                    |                | 7.393                    | 0,25                              |
| <b>KASACHSTAN</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                            |                |                          |                                   |
| Baiterek National Managing Holding JSC<br>5,450 % fällig am<br>08.05.2028          | 6.700          | 6.790                    | 0,23                              |
| <b>KENIA</b>                                                                       |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                          |                |                          |                                   |
| Republik Kenia<br>9,849 % fällig am<br>05.04.2028                                  | 3.800          | 3.791                    | 0,13                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                            |                |                          |                                   |
| Republic of Kenya Government International Bond<br>6,300 % fällig am<br>23.01.2034 | 5.700          | 4.625                    | 0,15                              |
| 7,250 % fällig am<br>28.02.2028                                                    | 5.000          | 4.918                    | 0,16                              |

| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 9,500 % fällig am 05.03.2036                                                  | \$ 4.600       | \$ 4.345                 | 0,15                              |
| 9,750 % fällig am 16.02.2031                                                  |                |                          |                                   |
| (i)                                                                           | 13.200         | 13.420                   | 0,45                              |
|                                                                               |                | 27.308                   | 0,91                              |
| Summe Kenia                                                                   |                | 31.099                   | 1,04                              |
| <b>LETTLAND</b>                                                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                       |                |                          |                                   |
| Latvia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 30.07.2034          | 5.600          | 5.609                    | 0,19                              |
| <b>LUXEMBURG</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                       |                |                          |                                   |
| Ammaggi Luxembourg International SARL<br>5,250 % fällig am 28.01.2028         | 6.000          | 5.858                    | 0,20                              |
| Chile Electricity Lux MPC SARL<br>5,580 % fällig am 20.10.2035                | 5.767          | 5.777                    | 0,19                              |
| 5,672 % fällig am 20.10.2035                                                  | 1.400          | 1.411                    | 0,05                              |
| 6,010 % fällig am 20.01.2033                                                  | 8.091          | 8.392                    | 0,28                              |
| MHP Lux S.A.<br>6,950 % fällig am 03.04.2026                                  | 522            | 487                      | 0,02                              |
| Raizen Fuels Finance S.A.<br>5,700 % fällig am 17.01.2035                     | 8.800          | 8.246                    | 0,27                              |
| 6,950 % fällig am 05.03.2054                                                  | 13.600         | 12.627                   | 0,42                              |
| Virtuo2 Finance SARL<br>7,930 % fällig am 12.01.2034                          | € 6.700        | 7.875                    | 0,26                              |
| Summe Luxemburg                                                               |                | 50.673                   | 1,69                              |
| <b>MAZEDONIEN</b>                                                             |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                       |                |                          |                                   |
| North Macedonia Government International Bond<br>6,960 % fällig am 13.03.2027 | 5.600          | 6.897                    | 0,23                              |
| <b>MALAYSIA</b>                                                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                       |                |                          |                                   |
| Axiata SPV5 Labuan Ltd.<br>3,064 % fällig am 19.08.2050                       | \$ 1.259       | 848                      | 0,03                              |
| <b>MAURITIUS</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                       |                |                          |                                   |
| Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.<br>4,250 % fällig am 25.03.2027     | 4.508          | 4.377                    | 0,14                              |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % fällig am 27.09.2028          | 10.000         | 10.088                   | 0,34                              |
| Summe Mauritius                                                               |                | 14.465                   | 0,48                              |
| <b>MEXIKO</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                       |                |                          |                                   |
| Banco Mercantil del Norte S.A.<br>6,625 % fällig am<br>24.01.2032 (g)(h)      | 2.000          | 1.857                    | 0,06                              |
| 8,375 % fällig am<br>14.10.2030 (g)(h)                                        | 400            | 415                      | 0,01                              |
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC<br>5,875 % fällig am 07.05.2030       | 6.700          | 6.805                    | 0,23                              |
| BBVA Bancomer S.A.<br>7,625 % fällig am<br>11.02.2035 (h)                     | 4.100          | 4.220                    | 0,14                              |
| Corp. GEO S.A.B. de C.V.<br>8,875 % fällig am<br>25.09.2014 ^                 | 500            | 0                        | 0,00                              |
| Metalsa S.A. de C.V.<br>3,750 % fällig am 04.05.2031                          | 10.600         | 8.719                    | 0,29                              |
| Trust Fibra Uno<br>6,390 % fällig am 15.01.2050                               | 1.000          | 836                      | 0,03                              |
| 7,375 % fällig am 13.02.2034                                                  |                |                          |                                   |
| (i)                                                                           | 9.600          | 9.783                    | 0,33                              |
| 7,700 % fällig am 23.01.2032                                                  | 4.200          | 4.382                    | 0,15                              |
| 8,250 % fällig am 23.01.2037                                                  | 4.300          | 4.538                    | 0,15                              |
|                                                                               |                | 41.555                   | 1,39                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                       |                |                          |                                   |
| Mexico Government International Bond<br>1,350 % fällig am<br>18.09.2027       | € 600          | 683                      | 0,02                              |
| 2,250 % fällig am<br>12.08.2036                                               | 9.700          | 8.854                    | 0,30                              |
| 2,750 % fällig am<br>27.11.2031 (f)                                           | MXN 135.163    | 6.341                    | 0,21                              |
| 3,750 % fällig am<br>19.04.2071                                               | \$ 1.100       | 626                      | 0,02                              |
| 4,875 % fällig am<br>19.05.2033                                               | 25.300         | 23.926                   | 0,80                              |

| BESCHREIBUNG                                                                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,750 % fällig am<br>12.10.2110 (i)                                                                               | \$ 16.940      | \$ 13.408                | 0,45                              |
| 5,850 % fällig am<br>02.07.2032 (a)                                                                               | 4.300          | 4.357                    | 0,14                              |
| 6,000 % fällig am 07.05.2036                                                                                      | 3.700          | 3.661                    | 0,12                              |
| 6,338 % fällig am 04.05.2053                                                                                      | 5.185          | 4.771                    | 0,16                              |
| 6,625 % fällig am<br>29.01.2038 (a)                                                                               | 4.300          | 4.371                    | 0,15                              |
| 6,875 % fällig am 13.05.2037                                                                                      | 3.600          | 3.764                    | 0,13                              |
| 7,375 % fällig am 13.05.2055                                                                                      | 3.900          | 4.035                    | 0,13                              |
|                                                                                                                   |                | 78.797                   | 2,63                              |
| Summe Mexiko                                                                                                      |                | 120.352                  | 4,02                              |
| <b>MONGOLEI</b>                                                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                                           |                |                          |                                   |
| City of Ulaanbaatar Mongolia<br>7,750 % fällig am 21.08.2027                                                      | 8.700          | 8.739                    | 0,29                              |
| Mongolia Government International Bond<br>3,500 % fällig am 07.07.2027                                            | 4.250          | 3.989                    | 0,13                              |
| 6,625 % fällig am 25.02.2030                                                                                      | 200            | 197                      | 0,01                              |
| 7,875 % fällig am 05.06.2029                                                                                      |                |                          |                                   |
| (i)                                                                                                               | 800            | 835                      | 0,03                              |
| 8,650 % fällig am 19.01.2028                                                                                      | 268            | 281                      | 0,01                              |
| Summe Mongolei                                                                                                    |                | 14.041                   | 0,47                              |
| <b>MAROKKO</b>                                                                                                    |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                                           |                |                          |                                   |
| Morocco Government International Bond<br>4,000 % fällig am 15.12.2050                                             | 17.400         | 11.873                   | 0,40                              |
| 5,500 % fällig am 11.12.2042                                                                                      | 3.500          | 3.132                    | 0,10                              |
| Summe Marokko                                                                                                     |                | 15.005                   | 0,50                              |
| <b>MULTINATIONAL</b>                                                                                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                                           |                |                          |                                   |
| NXP BV<br>3,400 % fällig am 01.05.2030                                                                            | 500            | 473                      | 0,02                              |
| <b>AKTIEN</b>                                                                                                     |                |                          |                                   |
| <b>NIEDERLANDE</b>                                                                                                |                |                          |                                   |
| <b>STAMMAKTIVEN</b>                                                                                               |                |                          |                                   |
| Stichting<br>Administratiekan<br>Holding (c)                                                                      | 10.402         | 0                        | 0,00                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                                           |                |                          |                                   |
| ING Groep NV<br>1,125 % fällig am<br>07.12.2028                                                                   | £ 3.300        | 4.180                    | 0,14                              |
| InterCement Financial Operations BV<br>5,750 % fällig am<br>17.07.2024 ^                                          | \$ 200         | 102                      | 0,00                              |
| NE Property BV<br>2,000 % fällig am<br>20.01.2030 (i)                                                             | € 5.600        | 6.202                    | 0,21                              |
| 3,375 % fällig am<br>14.07.2027                                                                                   | 2.300          | 2.724                    | 0,09                              |
| Prosus NV<br>1,539 % fällig am<br>03.08.2028                                                                      | 800            | 900                      | 0,03                              |
| 2,031 % fällig am<br>03.08.2032                                                                                   | 400            | 420                      | 0,01                              |
| 3,257 % fällig am<br>19.01.2027                                                                                   | \$ 200         | 196                      | 0,01                              |
| 4,027 % fällig am<br>03.08.2050                                                                                   | 800            | 536                      | 0,02                              |
| Unigel Netherlands Holding Corp. BV (15,000 % bar oder<br>15,000 % PIK)<br>15,000 % fällig am<br>31.12.2044 ^ (b) | 2.234          | 73                       | 0,00                              |
|                                                                                                                   |                | 15.333                   | 0,51                              |
| Summe Niederlande                                                                                                 |                | 15.333                   | 0,51                              |
| <b>OMAN</b>                                                                                                       |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                                           |                |                          |                                   |
| Oman Government International Bond<br>5,625 % fällig am 17.01.2028                                                | 6.200          | 6.344                    | 0,21                              |
| 6,000 % fällig am 01.08.2029                                                                                      | 8.600          | 9.029                    | 0,30                              |
| 6,250 % fällig am 25.01.2031                                                                                      | 2.100          | 2.233                    | 0,08                              |
| 6,500 % fällig am 08.03.2047                                                                                      | 2.650          | 2.689                    | 0,09                              |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048                                                                                      | 10.500         | 10.864                   | 0,36                              |
| 7,000 % fällig am 25.01.2051                                                                                      | 4.400          | 4.685                    | 0,16                              |
| Summe Oman                                                                                                        |                | 35.844                   | 1,20                              |
| <b>PAKISTAN</b>                                                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                                           |                |                          |                                   |
| Pakistan Government International Bond<br>6,000 % fällig am<br>08.04.2026                                         | 18.820         | 18.554                   | 0,62                              |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                    |    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------|----|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| 6,875 % fällig am<br>05.12.2027 | \$ | 1.895          | 1.793                           | 0,06                              |
| 8,250 % fällig am<br>30.09.2025 |    | 2.400          | 2.398                           | 0,08                              |
| Summe Pakistan                  |    |                | 22.745                          | 0,76                              |

### PANAMA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                                 |  |       |       |      |
|-------------------------------------------------|--|-------|-------|------|
| <b>Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.</b> |  |       |       |      |
| 5,125 % fällig am<br>11.08.2061                 |  | 2.900 | 2.045 | 0,07 |
| <b>Banco General S.A.</b>                       |  |       |       |      |
| 5,250 % fällig am<br>07.05.2031 (g)             |  | 5.500 | 4.964 | 0,17 |
| <b>Banco Nacional de Panamá</b>                 |  |       |       |      |
| 2,500 % fällig am<br>11.08.2030                 |  | 400   | 335   | 0,01 |
| <b>Empresa de Transmision Electrica S.A.</b>    |  |       |       |      |
| 5,125 % fällig am<br>02.05.2049                 |  | 1.000 | 722   | 0,02 |
|                                                 |  |       | 8.066 | 0,27 |

### STAATSEMISSIONEN

|                                             |  |        |        |      |
|---------------------------------------------|--|--------|--------|------|
| <b>Panama Government International Bond</b> |  |        |        |      |
| 3,870 % fällig am 23.07.2060                |  | 8.500  | 4.866  | 0,16 |
| 4,300 % fällig am 29.04.2053                |  | 1.500  | 973    | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2047                |  | 200    | 139    | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 16.04.2050                |  | 9.800  | 6.645  | 0,22 |
| 4,500 % fällig am<br>01.04.2056 (i)         |  | 12.800 | 8.329  | 0,28 |
| 4,500 % fällig am<br>19.01.2063 (i)         |  | 16.900 | 10.919 | 0,36 |
| 6,400 % fällig am 14.02.2035                |  | 4.800  | 4.685  | 0,16 |
| 6,853 % fällig am 28.03.2054                |  | 5.200  | 4.777  | 0,16 |
| 6,875 % fällig am 31.01.2036                |  | 1.000  | 997    | 0,03 |
| 7,875 % fällig am<br>01.03.2057 (i)         |  | 2.600  | 2.652  | 0,09 |
| 8,000 % fällig am 01.03.2038                |  | 1.600  | 1.718  | 0,06 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034                |  | 1.000  | 1.080  | 0,04 |
|                                             |  |        | 47.780 | 1,59 |
| Summe Panama                                |  |        | 55.846 | 1,86 |

### PARAGUAY

|                                               |     |            |        |      |
|-----------------------------------------------|-----|------------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |     |            |        |      |
| <b>Paraguay Government International Bond</b> |     |            |        |      |
| 2,730 % fällig am 29.01.2033                  |     | 1.900      | 1.623  | 0,05 |
| 3,849 % fällig am 28.06.2033                  |     | 1.900      | 1.728  | 0,06 |
| 5,400 % fällig am 30.03.2050                  |     | 10.300     | 8.858  | 0,30 |
| 5,600 % fällig am 13.03.2048                  |     | 1.800      | 1.607  | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 09.02.2036                  |     | 2.000      | 2.038  | 0,07 |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044                  |     | 1.800      | 1.732  | 0,06 |
| 6,650 % fällig am 04.03.2055                  |     | 3.100      | 3.104  | 0,10 |
| 7,900 % fällig am<br>09.02.2031               | PYG | 45.493.000 | 5.518  | 0,18 |
| 8,500 % fällig am<br>04.03.2035               |     | 19.002.000 | 2.324  | 0,08 |
| Summe Paraguay                                |     |            | 28.532 | 0,95 |

### PERU

|                                                     |     |        |        |      |
|-----------------------------------------------------|-----|--------|--------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |     |        |        |      |
| <b>Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.</b> |     |        |        |      |
| 9,700 % fällig am<br>05.03.2045                     | PEN | 31.400 | 9.242  | 0,31 |
| 10,100 % fällig am<br>15.12.2043                    |     | 17.100 | 5.120  | 0,17 |
| <b>InRetail Consumer</b>                            |     |        |        |      |
| 3,250 % fällig am<br>22.03.2028                     | \$  | 3.700  | 3.512  | 0,12 |
| <b>Niagara Energy SAC</b>                           |     |        |        |      |
| 5,746 % fällig am<br>03.10.2034                     |     | 7.100  | 7.035  | 0,23 |
|                                                     |     |        | 24.909 | 0,83 |

### STAATSEMISSIONEN

|                                            |     |        |        |      |
|--------------------------------------------|-----|--------|--------|------|
| <b>Corp. Financiera de Desarrollo S.A.</b> |     |        |        |      |
| 5,500 % fällig am<br>06.05.2030            |     | 7.000  | 7.095  | 0,24 |
| 5,950 % fällig am<br>30.04.2029            |     | 20.400 | 21.047 | 0,70 |
| <b>Fondo MIVIVIENDA S.A.</b>               |     |        |        |      |
| 4,625 % fällig am<br>12.04.2027            |     | 13.572 | 13.590 | 0,45 |
| <b>Peru Government International Bond</b>  |     |        |        |      |
| 1,950 % fällig am<br>17.11.2036 (i)        | €   | 8.300  | 7.908  | 0,26 |
| 3,000 % fällig am<br>15.01.2034            | \$  | 19.600 | 16.559 | 0,55 |
| 3,600 % fällig am<br>15.01.2072            |     | 10.200 | 6.297  | 0,21 |
| 5,400 % fällig am<br>12.08.2034            | PEN | 5.300  | 1.414  | 0,05 |
| 5,500 % fällig am<br>30.03.2036            | \$  | 4.800  | 4.809  | 0,16 |
| 6,150 % fällig am<br>12.08.2032            | PEN | 13.700 | 3.994  | 0,13 |

| BESCHREIBUNG                    |     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------|-----|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| 6,200 % fällig am<br>30.06.2055 | \$  | 4.400          | 4.425                           | 0,15                              |
| 6,900 % fällig am<br>12.08.2037 | PEN | 1.800          | 517                             | 0,02                              |
| 6,950 % fällig am<br>12.08.2031 |     | 5.841          | 1.790                           | 0,06                              |
| 7,300 % fällig am<br>12.08.2033 |     | 3.600          | 1.107                           | 0,04                              |
|                                 |     |                | 90.552                          | 3,02                              |
| Summe Peru                      |     |                | 115.461                         | 3,85                              |

### PHILIPPINEN

|                                         |    |       |       |      |
|-----------------------------------------|----|-------|-------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |       |       |      |
| <b>Globe Telecom, Inc.</b>              |    |       |       |      |
| 2,500 % fällig am<br>23.07.2030         | \$ | 9.600 | 8.583 | 0,29 |

### STAATSEMISSIONEN

|                                                  |  |        |        |      |
|--------------------------------------------------|--|--------|--------|------|
| <b>Philippines Government International Bond</b> |  |        |        |      |
| 4,200 % fällig am 29.03.2047                     |  | 11.700 | 9.580  | 0,32 |
| 5,500 % fällig am 17.01.2048                     |  | 18.200 | 17.721 | 0,59 |
| 5,600 % fällig am 14.05.2049                     |  | 15.450 | 15.142 | 0,50 |
|                                                  |  |        | 42.443 | 1,41 |
| Summe Philippinen                                |  |        | 51.026 | 1,70 |

### POLEN

|                                         |   |     |     |      |
|-----------------------------------------|---|-----|-----|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |   |     |     |      |
| <b>mBank S.A.</b>                       |   |     |     |      |
| 4,778 % fällig am<br>25.09.2035         | € | 200 | 236 | 0,01 |

### STAATSEMISSIONEN

|                                    |    |       |       |      |
|------------------------------------|----|-------|-------|------|
| <b>Bank Gospodarstwa Krajowego</b> |    |       |       |      |
| 4,375 % fällig am<br>13.03.2039    |    | 5.400 | 6.328 | 0,21 |
| 5,750 % fällig am<br>09.07.2034    | \$ | 5.800 | 5.977 | 0,20 |
| 6,250 % fällig am<br>09.07.2054    |    | 5.800 | 5.766 | 0,19 |

### Poland Government International Bond

|                              |  |        |        |      |
|------------------------------|--|--------|--------|------|
| 4,875 % fällig am 12.02.2030 |  | 2.700  | 2.756  | 0,09 |
| 5,375 % fällig am 12.02.2035 |  | 5.400  | 5.511  | 0,18 |
| 5,500 % fällig am 04.04.2053 |  |        |        |      |
| (i)                          |  | 11.200 | 10.450 | 0,35 |
| 5,500 % fällig am 18.03.2054 |  | 16.000 | 14.886 | 0,50 |
|                              |  |        | 51.674 | 1,72 |
| Summe Polen                  |  |        | 51.910 | 1,73 |

### KATAR

|                                            |  |        |        |      |
|--------------------------------------------|--|--------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |  |        |        |      |
| <b>Qatar Government International Bond</b> |  |        |        |      |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050               |  | 15.200 | 12.871 | 0,43 |
| 4,750 % fällig am 29.05.2034               |  | 28.400 | 28.960 | 0,96 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049               |  | 7.565  | 6.802  | 0,23 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048               |  | 7.200  | 6.798  | 0,23 |
| Summe Katar                                |  |        | 55.431 | 1,85 |

### RUMÄNIEN

|                                              |   |        |        |      |
|----------------------------------------------|---|--------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |   |        |        |      |
| <b>Romania Government International Bond</b> |   |        |        |      |
| 5,250 % fällig am<br>10.03.2030              | € | 4.100  | 4.920  | 0,17 |
| 5,625 % fällig am<br>22.02.2036 (i)          |   | 83.400 | 93.300 | 3,11 |
| Summe Rumänien                               |   |        | 98.220 | 3,28 |

### RUSSLAND

|                                         |    |       |     |      |
|-----------------------------------------|----|-------|-----|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |       |     |      |
| <b>MMK International Capital DAC</b>    |    |       |     |      |
| 4,375 % fällig am<br>13.06.2024 ^       | \$ | 2.800 | 168 | 0,01 |

### SENEGAL

|                                              |    |        |        |      |
|----------------------------------------------|----|--------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |    |        |        |      |
| <b>Senegal Government International Bond</b> |    |        |        |      |
| 4,750 % fällig am<br>13.03.2028              | €  | 6.500  | 6.053  | 0,20 |
| 5,375 % fällig am<br>08.06.2037              |    | 11.100 | 8.101  | 0,27 |
| 6,250 % fällig am<br>23.05.2033              | \$ | 5.600  | 3.701  | 0,12 |
| 7,750 % fällig am<br>10.06.2031              |    | 6.100  | 4.481  | 0,15 |
| Summe Senegal                                |    |        | 22.336 | 0,74 |

### SERBIEN

|                                             |    |        |        |      |
|---------------------------------------------|----|--------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                     |    |        |        |      |
| <b>Serbia Government International Bond</b> |    |        |        |      |
| 1,000 % fällig am<br>23.09.2028 (i)         | €  | 26.800 | 29.066 | 0,97 |
| 6,000 % fällig am<br>12.06.2034             | \$ | 33.400 | 33.766 | 1,13 |
| Summe Serbien                               |    |        | 62.832 | 2,10 |

| BESCHREIBUNG                            |    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| <b>SINGAPUR</b>                         |    |                |                                 |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |                |                                 |                                   |
| <b>Cathaylife Singapore Pte Ltd.</b>    |    |                |                                 |                                   |
| 5,950 % fällig am<br>05.07.2034         | \$ | 5.300          | 5.454                           | 0,18                              |
| <b>Flex Ltd.</b>                        |    |                |                                 |                                   |
| 4,875 % fällig am<br>15.06.2029         |    | 200            | 201                             | 0,01                              |
| Summe Singapur                          |    |                | 5.655                           | 0,19                              |

### SÜDAFRIKA

|                                                   |     |         |        |      |
|---------------------------------------------------|-----|---------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |     |         |        |      |
| <b>South Africa Government International Bond</b> |     |         |        |      |
| 4,850 % fällig am<br>30.09.2029                   |     | 2.700   | 2.606  | 0,09 |
| 5,375 % fällig am<br>24.07.2044                   |     | 9.300   | 7.102  | 0,24 |
| 5,750 % fällig am<br>30.09.2049                   |     | 21.800  | 16.436 | 0,55 |
| 7,100 % fällig am<br>19.11.2036                   |     | 4.700   | 4.668  | 0,15 |
| 7,950 % fällig am<br>19.11.2054                   |     | 4.700   | 4.493  | 0,15 |
| 8,500 % fällig am<br>31.01.2037                   | ZAR | 99.500  | 4.874  | 0,16 |
| 8,875 % fällig am<br>28.02.2035                   |     | 297.000 | 15.606 | 0,52 |
| Summe Südafrika                                   |     |         | 55.785 | 1,86 |

### SÜDKOREA

|                                         |    |        |        |      |
|-----------------------------------------|----|--------|--------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |        |        |      |
| <b>Hanwha Life Insurance Co. Ltd.</b>   |    |        |        |      |
| 3,379 % fällig am<br>04.02.2032         | \$ | 6.700  | 6.522  | 0,22 |
| <b>KB Kookmin Card Co. Ltd.</b>         |    |        |        |      |
| 1,500 % fällig am<br>13.05.2026         |    | 10.000 | 9.738  | 0,33 |
| <b>KEB Hana Bank</b>                    |    |        |        |      |
| 3,500 % fällig am<br>19.10.2026 (g)(h)  |    | 6.500  | 6.334  | 0,21 |
| 5,375 % fällig am<br>23.04.2029         |    | 7.300  | 7.567  | 0,25 |
| <b>Kookmin Bank</b>                     |    |        |        |      |
| 2,500 % fällig am<br>04.11.2030 (h)     |    | 2.500  | 2.236  | 0,07 |
| <b>Shinhan Bank Co. Ltd.</b>            |    |        |        |      |
| 4,375 % fällig am<br>13.04.2032 (i)(h)  |    | 9.000  | 8.627  | 0,29 |
| 5,750 % fällig am<br>15.04.2034 (i)(h)  |    | 6.900  | 7.084  | 0,24 |
| <b>Shinhan Financial Group Co. Ltd.</b> |    |        |        |      |
| 2,875 % fällig am<br>12.05.2026 (g)(h)  |    | 8.000  | 7.803  | 0,26 |
| <b>SK Hynix, Inc.</b>                   |    |        |        |      |
| 2,375 % fällig am<br>19.01.2031         |    | 21.800 | 19.281 | 0,64 |
| 6,500 % fällig am<br>17.01.2033         |    | 5.600  | 6.055  | 0,20 |
| <b>Woori Card Co. Ltd.</b>              |    |        |        |      |
| 1,750 % fällig am<br>23.03.2026         |    | 6.000  | 5.875  | 0,20 |
|                                         |    |        | 87.122 | 2,91 |

### STAATSEMISSIONEN

|                                    |  |        |         |      |
|------------------------------------|--|--------|---------|------|
| <b>Export-Import Bank of Korea</b> |  |        |         |      |
| 2,125 % fällig am 18.01.2032       |  | 14.700 | 12.682  | 0,42 |
| 5,125 % fällig am 11.01.2033       |  | 8.400  | 8.673   | 0,29 |
| <b>Korea Water Resources Corp.</b> |  |        |         |      |
| 4,375 % fällig am 21.05.2027       |  | 10.000 | 10.049  | 0,34 |
|                                    |  |        | 31.404  | 1,05 |
| Summe Südkorea                     |  |        | 118.526 | 3,96 |

### SRI LANKA

| STAATSEMISSIONEN                        |        |        |      |  |
|-----------------------------------------|--------|--------|------|--|
| Sri Lanka Government International Bond |        |        |      |  |
| 3,100 % fällig am 15.01.2030            | 4.742  | 4.238  | 0,14 |  |
| 3,350 % fällig am 15.03.2033            | 11.375 | 9.209  | 0,31 |  |
| 3,600 % fällig am 15.06.2035            | 1.908  | 1.314  | 0,04 |  |
| 3,600 % fällig am 15.05.2036            |        |        |      |  |
| (i)                                     | 5.002  | 4.083  | 0,14 |  |
| 3,600 % fällig am 15.02.2038            | 10.009 | 8.151  | 0,27 |  |
| 4,000 % fällig am 15.04.2028            | 5.100  | 4.800  | 0,16 |  |
| Summe Sri Lanka                         |        | 31.795 | 1,06 |  |



| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung |                |                                 |                                   |
| 5,310 % fällig am<br>05.02.2026                      | ZAR 114.000    | \$ 6.356                        | 0,21                              |
| Summe Supranational                                  |                | 21.624                          | 0,72                              |

#### TANSANIA KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                                 |          |        |      |
|---------------------------------|----------|--------|------|
| Ministry of Finance of Tanzania |          |        |      |
| TBD % fällig am<br>26.04.2028   | € 3.164  | 3.719  | 0,12 |
| TBD % fällig am<br>26.04.2028   | \$ 1.667 | 1.671  | 0,06 |
| TBD % fällig am<br>20.06.2030   | 6.650    | 6.624  | 0,22 |
| TBD % fällig am<br>26.04.2031   | 1.200    | 1.200  | 0,04 |
| Summe Tansania                  |          | 13.214 | 0,44 |

#### TRINIDAD UND TOBAGO STAATSEMISSIONEN

|                                                 |       |       |      |
|-------------------------------------------------|-------|-------|------|
| Trinidad & Tobago Government International Bond |       |       |      |
| 5,950 % fällig am<br>14.01.2031                 | 4.400 | 4.412 | 0,15 |

#### TÜRKEI UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                     |       |        |      |
|-------------------------------------|-------|--------|------|
| Akbank TAS                          |       |        |      |
| 7,498 % fällig am<br>20.01.2030     | 9.000 | 9.170  | 0,31 |
| Turkish Airlines Pass-Through Trust |       |        |      |
| 4,200 % fällig am<br>15.09.2028     | 108   | 105    | 0,00 |
| Turkiye Is Bankasi A/S              |       |        |      |
| 7,750 % fällig am<br>12.06.2029     | 8.900 | 9.149  | 0,31 |
| Ulker Bisküvi Sanayi A/S            |       |        |      |
| 7,875 % fällig am<br>08.07.2031 (i) | 8.000 | 8.202  | 0,27 |
|                                     |       | 26.626 | 0,89 |

#### KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                                 |         |       |      |
|---------------------------------|---------|-------|------|
| Turkiye Vakıflar Bankası T.A.O. |         |       |      |
| 5,001 % fällig am<br>15.12.2028 | € 3.800 | 4.477 | 0,15 |

#### STAATSEMISSIONEN

|                                         |             |        |      |
|-----------------------------------------|-------------|--------|------|
| Hazine Mustesarlığı Varlik Kiralama A/S |             |        |      |
| 6,750 % fällig am<br>01.09.2030 (a)     | \$ 6.300    | 6.299  | 0,21 |
| Turkey Government International Bond    |             |        |      |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043            | 1.000       | 706    | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047            | 6.600       | 4.962  | 0,17 |
| 7,125 % fällig am 12.02.2032            | 6.800       | 6.819  | 0,23 |
| 7,125 % fällig am 17.07.2032            | 900         | 902    | 0,03 |
| 9,125 % fällig am 13.07.2030            | 11.600      | 12.880 | 0,43 |
| 46,872 % fällig am<br>16.06.2027        | TRY 269.700 | 6.738  | 0,22 |
| 49,053 % fällig am<br>20.05.2026        | 38.900      | 982    | 0,03 |
| 49,053 % fällig am<br>19.08.2026        | 33.600      | 848    | 0,03 |
| 49,053 % fällig am<br>17.05.2028        | 427.300     | 10.416 | 0,35 |
| Turkiye İhracat Kredi Bankası A/S       |             |        |      |
| 6,875 % fällig am<br>03.07.2028         | \$ 2.500    | 2.505  | 0,08 |
|                                         |             | 54.057 | 1,80 |
| Summe Türkei                            |             | 85.160 | 2,84 |

#### UKRAINE STAATSEMISSIONEN

|                                       |        |        |      |
|---------------------------------------|--------|--------|------|
| Ukraine Government International Bond |        |        |      |
| 0,000 % fällig am 01.02.2030          | 3.033  | 1.466  | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 01.02.2034          | 11.334 | 4.397  | 0,15 |
| 0,000 % fällig am 01.02.2035          | 8.833  | 4.195  | 0,14 |
| 0,000 % fällig am 01.02.2036          | 3.709  | 1.753  | 0,06 |
| 0,000 % fällig am 01.08.2041          | 11.950 | 8.634  | 0,29 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2029<br>(i)   | 814    | 504    | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2034          | 16.653 | 8.660  | 0,29 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2035          | 15.307 | 7.853  | 0,26 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2036          | 9.359  | 4.679  | 0,15 |
| Summe Ukraine                         |        | 42.141 | 1,41 |

#### VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                          |       |       |      |
|------------------------------------------|-------|-------|------|
| Abu Dhabi Commercial Bank PJSC           |       |       |      |
| 5,500 % fällig am<br>12.01.2029          | 7.500 | 7.756 | 0,26 |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC |       |       |      |
| 5,250 % fällig am<br>02.10.2054          | 7.200 | 6.688 | 0,22 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC                |       |       |      |
| 4,774 % fällig am<br>06.06.2028          | 6.500 | 6.563 | 0,22 |

| BESCHREIBUNG                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.  |                |                                 |                                   |
| 4,875 % fällig am<br>25.07.2029     | \$ 12.500      | \$ 12.617                       | 0,42                              |
| 4,875 % fällig am 21.05.2030        | 3.300          | 3.339                           | 0,11                              |
| 4,875 % fällig am 25.07.2033        | 18.000         | 17.848                          | 0,60                              |
| 5,375 % fällig am 21.05.2035        | 4.200          | 4.278                           | 0,14                              |
| MDGH GMTN RSC Ltd.                  |                |                                 |                                   |
| 5,875 % fällig am 01.05.2034        | 9.900          | 10.538                          | 0,35                              |
| NBK SPC Ltd.                        |                |                                 |                                   |
| 5,500 % fällig am<br>06.06.2030 (i) | 14.600         | 15.026                          | 0,50                              |
| Sweihan PV Power Co. PJSC           |                |                                 |                                   |
| 3,625 % fällig am<br>31.01.2049     | 4.242          | 3.509                           | 0,12                              |
|                                     |                | 88.162                          | 2,94                              |

#### KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                               |           |       |      |
|-------------------------------|-----------|-------|------|
| NMC Healthcare LLC            |           |       |      |
| TBD % fällig am<br>25.03.2027 | AED 7.294 | 1.989 | 0,07 |

#### STAATSEMISSIONEN

|                                                    |          |         |      |
|----------------------------------------------------|----------|---------|------|
| Emirate of Abu Dhabi Government International Bond |          |         |      |
| 5,500 % fällig am<br>30.04.2054                    | \$ 6.100 | 6.087   | 0,20 |
| Finance Department Government of Sharjah           |          |         |      |
| 6,500 % fällig am<br>23.11.2032                    | 8.400    | 8.786   | 0,29 |
|                                                    |          | 14.873  | 0,49 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate                 |          | 105.024 | 3,50 |

#### GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                               |       |       |      |
|-----------------------------------------------|-------|-------|------|
| Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC |       |       |      |
| 7,875 % fällig am 15.07.2028                  | 3.825 | 2.956 | 0,10 |
| 8,250 % fällig am 09.07.2026                  | 3.664 | 3.041 | 0,10 |
|                                               |       | 5.997 | 0,20 |

#### NON-AGENCY-MBS

|                                 |         |        |      |
|---------------------------------|---------|--------|------|
| Canada Square Funding PLC       |         |        |      |
| 5,161 % fällig am<br>17.01.2059 | £ 1.567 | 2.152  | 0,07 |
| Polaris PLC                     |         |        |      |
| 5,524 % fällig am 23.05.2059    | 2.154   | 2.954  | 0,10 |
| Rochester Financing PLC         |         |        |      |
| 4,939 % fällig am<br>18.12.2044 | 1.205   | 1.651  | 0,06 |
| Tower Bridge Funding PLC        |         |        |      |
| 4,959 % fällig am 20.12.2063    | 546     | 748    | 0,02 |
|                                 |         | 7.505  | 0,25 |
| Summe Großbritannien            |         | 13.502 | 0,45 |

#### USA FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

|                                                   |        |     |      |
|---------------------------------------------------|--------|-----|------|
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. |        |     |      |
| 4,914 % fällig am<br>25.02.2037                   | \$ 368 | 357 | 0,01 |
| 5,559 % fällig am<br>25.11.2035                   | 440    | 436 | 0,02 |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC |        |     |      |
| 3,114 % fällig am<br>25.01.2037                   | 2.189  | 605 | 0,02 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                    |        |     |      |
| 4,734 % fällig am<br>25.09.2036                   | 735    | 472 | 0,02 |

|                                                      |     |     |      |
|------------------------------------------------------|-----|-----|------|
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                  |     |     |      |
| 4,874 % fällig am<br>25.11.2036                      | 808 | 478 | 0,02 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust               |     |     |      |
| 5,229 % fällig am<br>25.03.2034                      | 571 | 602 | 0,02 |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust |     |     |      |
| 4,734 % fällig am<br>25.07.2036                      | 124 | 116 | 0,00 |

|                                                                    |       |       |      |
|--------------------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| Option One Mortgage Loan Trust                                     |       |       |      |
| 4,654 % fällig am<br>25.05.2037                                    | 202   | 122   | 0,00 |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |       |       |      |
| 5,214 % fällig am<br>25.09.2035                                    | 1.000 | 913   | 0,03 |
| Saxon Asset Securities Trust                                       |       |       |      |
| 4,744 % fällig am<br>25.09.2037                                    | 31    | 30    | 0,00 |
| Soundview Home Loan Trust                                          |       |       |      |
| 4,794 % fällig am<br>25.02.2037                                    | 185   | 50    | 0,00 |
| 5,334 % fällig am<br>25.10.2037                                    | 108   | 83    | 0,00 |
|                                                                    |       | 4.264 | 0,14 |

#### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                 |        |        |      |
|---------------------------------|--------|--------|------|
| Ford Motor Co.                  |        |        |      |
| 3,250 % fällig am<br>12.02.2032 | 12.000 | 10.122 | 0,34 |

| BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT VERMÖ-<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------|----------------|---------------------------------|-----------------------------------|
| Gabon Blue Bond Master Trust           |                |                                 |                                   |
| 6,097 % fällig am<br>01.08.2038        | \$ 1.200       | \$ 1.203                        | 0,04                              |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp. |                |                                 |                                   |
| 5,000 % fällig am<br>27.07.2028 (i)    | 14.200         | 14.462                          | 0,48                              |
| Rutas 2 & 7 Finance Ltd.               |                |                                 |                                   |
| 0,000 % fällig am<br>30.09.2036 (d)    | 3.987          | 2.893                           | 0,10                              |
| Santander Holdings USA, Inc.           |                |                                 |                                   |
| 5,807 % fällig am<br>09.09.2026        | 12.000         | 12.022                          | 0,40                              |
|                                        |                | 40.702                          | 1,36                              |

#### KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                                 |          |        |      |
|---------------------------------|----------|--------|------|
| Stepstone Group Midco GmbH      |          |        |      |
| 6,673 % fällig am<br>26.04.2032 | € 10.200 | 11.764 | 0,39 |
| Ziraat Bank                     |          |        |      |
| TBD % fällig am<br>15.06.2034   | \$ 9.000 | 8.948  | 0,30 |
|                                 |          | 20.712 | 0,69 |

#### NON-AGENCY-MBS

|                                                         |       |       |      |
|---------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. |       |       |      |
| 4,407 % fällig am<br>15.11.2061                         | 3.300 | 3.291 | 0,11 |
| Benchmark Mortgage Trust                                |       |       |      |
| 4,261 % fällig am<br>10.10.2051                         | 4.400 | 4.343 | 0,15 |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust                     |       |       |      |
| 5,084 % fällig am<br>25.10.2036                         | 64    | 49    | 0,00 |
| Countrywide Alternative Loan Trust                      |       |       |      |
| 4,784 % fällig am<br>25.05.2036                         | 112   | 43    | 0,00 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates             |       |       |      |
| 3,241 % fällig am<br>30.11.2037                         | 450   | 412   | 0,01 |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                             |       |       |      |
| 3,500 % fällig am 25.11.2037                            | 159   | 131   | 0,00 |
| 4,794 % fällig am 25.02.2037                            | 218   | 206   | 0,01 |
| 5,074 % fällig am 25.07.2045                            | 47    | 37    | 0,00 |
| JPMorgan Resecuritization Trust                         |       |       |      |
| 2,500 % fällig am<br>25.03.2056                         | 14    | 13    | 0,00 |
| Lehman XS Trust                                         |       |       |      |
| 4,814 % fällig am 25.09.2046                            | 180   | 161   | 0,01 |
| 4,934 % fällig am 25.08.2037                            | 555   | 545   | 0,02 |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust             |       |       |      |
| 4,734 % fällig am<br>25.02.2037                         | 332   | 318   | 0,01 |
| SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust            |       |       |      |
| 4,979 % fällig am<br>25.10.2037                         | 46    | 41    | 0,00 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust           |       |       |      |
| 4,585 % fällig am<br>25.03.2036                         | 170   | 154   | 0,01 |
|                                                         |       | 9.744 | 0,33 |

#### US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

|                                                 |        |        |      |
|-------------------------------------------------|--------|--------|------|
| Uniform Mortgage-Backed Security                |        |        |      |
| 5,000 % fällig am<br>01.05.2053 -<br>01.10.2053 | 81.338 | 80.065 | 2,67 |

#### US-SCHATZOBIGATIONEN

|                              |        |         |      |
|------------------------------|--------|---------|------|
| U.S. Treasury Bonds          |        |         |      |
| 2,375 % fällig am 15.02.2042 | 8.600  | 6.259   | 0,21 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042 | 58.600 | 48.498  | 1,62 |
| 3,375 % fällig am 15.08.2042 | 24.300 | 20.404  | 0,68 |
|                              |        | 75.161  | 2,51 |
| Summe USA                    |        | 230.648 | 7,70 |

#### URUGUAY STAATSEMISSIONEN

|                                       |        |        |      |
|---------------------------------------|--------|--------|------|
| Uruguay Government International Bond |        |        |      |
| 5,250 % fällig am 10.09.2060          | 5.400  | 4.911  | 0,16 |
| 5,442 % fällig am 14.02.2037          | 3.400  | 3.482  | 0,12 |
| 5,750 % fällig am 28.10.2034<br>(i)   | 24.900 | 26.324 | 0,88 |
| Summe Uruguay                         |        | 34.717 | 1,16 |

#### USBKISTAN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                            |       |       |      |
|--------------------------------------------|-------|-------|------|
| Ipoteka-Bank ATIB                          |       |       |      |
| 5,500 % fällig am<br>19.11.2025            | 1.300 | 1.297 | 0,04 |
| Uzbek Industrial and Construction Bank ATB |       |       |      |
| 8,950 % fällig am<br>24.07.2029            | 4.700 | 4.954 | 0,17 |
|                                            |       | 6.251 | 0,21 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b> |                |                          |                                   |
| <b>National Bank of Uzbekistan</b>               |                |                          |                                   | <b>EGYPT TREASURY BILLS</b>     |                |                          |                                   |
| 4,850 % fällig am                                |                |                          |                                   | 27,220 % fällig am              |                |                          |                                   |
| 21.10.2025                                       | \$ 3.078       | \$ 3.066                 | 0,10                              | 09.09.2025                      |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am                                |                |                          |                                   | (d)(e)                          | EGP 500.000    | \$ 9.569                 | 0,32                              |
| 05.07.2029                                       | 10.170         | 10.691                   | 0,35                              | 27,349 % fällig am              |                |                          |                                   |
| <b>Republic of Uzbekistan International Bond</b> |                |                          |                                   | 15.07.2025                      |                |                          |                                   |
| 5,100 % fällig am                                |                |                          |                                   | (d)(e)                          | 59.000         | 1.178                    | 0,04                              |
| 25.02.2029                                       | € 9.200        | 11.069                   | 0,37                              | 27,448 % fällig am              |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am                                |                |                          |                                   | 12.08.2025                      |                |                          |                                   |
| 29.05.2027                                       | 7.900          | 9.509                    | 0,32                              | (d)(e)                          | 343.825        | 6.720                    | 0,22                              |
|                                                  |                | 34.335                   | 1,14                              | 27,499 % fällig am              |                |                          |                                   |
|                                                  |                | 40.586                   | 1,35                              | 26.08.2025                      |                |                          |                                   |
| Summe Usbekistan                                 |                |                          |                                   | (d)(e)                          | 74.350         | 1.439                    | 0,05                              |
| <b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>                 |                |                          |                                   | 27,500 % fällig am              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   | 23.09.2025                      |                |                          |                                   |
| <b>Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.</b>  |                |                          |                                   | (d)(e)                          | 467.975        | 8.861                    | 0,30                              |
| 6,750 % fällig am                                |                |                          |                                   | 27,501 % fällig am              |                |                          |                                   |
| 24.04.2033                                       | \$ 5.271       | 5.372                    | 0,18                              | 26.08.2025                      |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | (d)(e)                          | 99.400         | 1.923                    | 0,06                              |
| <b>SAMBIA</b>                                    |                |                          |                                   | Summe kurzfristige Instrumente  |                | 29.690                   | 0,99                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |                                 |                |                          |                                   |
| <b>Zambia Government International Bond</b>      |                |                          |                                   | Summe Übertragbare              |                |                          |                                   |
| 0,500 % fällig am                                |                |                          |                                   | Wertpapiere                     | \$ 3.120.670   | 104,15                   |                                   |
| 31.12.2053                                       | 248            | 171                      | 0,00                              |                                 |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am                                |                |                          |                                   |                                 |                |                          |                                   |
| 30.06.2033                                       | 221            | 203                      | 0,01                              |                                 |                |                          |                                   |
| Summe Sambia                                     |                | 374                      | 0,01                              |                                 |                |                          |                                   |

### PENSIONS-GESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                     | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse<br>aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|-----------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| DEU                     | 4,470 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 100             | U.S. Treasury Bonds 3,750 %<br>fällig am 15.11.2043 | \$ (103)                   | \$ 100                              | \$ 100                                                                 | 0,00                    |
| FICC                    | 4,400           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 56.500             | U.S. Treasury Notes 4,000 %<br>fällig am 15.12.2027 | (58.089)                   | 56.500                              | 56.507                                                                 | 1,89                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                                     | \$ (58.192)                | \$ 56.600                           | \$ 56.607                                                              | 1,89                    |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025          | 34                      | \$ 10                                           | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                                    | Long  | 09.2025          | 297                     | (347)                                           | (0,01)                  |
| Euro-OAT September Futures                                     | Short | 09.2025          | 374                     | 334                                             | 0,01                    |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Long  | 09.2025          | 408                     | (90)                                            | 0,00                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025          | 2.492                   | 2.886                                           | 0,09                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025          | 4.015                   | 7.160                                           | 0,24                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025          | 81                      | 205                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025          | 301                     | 1.372                                           | 0,04                    |
|                                                                |       |                  |                         | \$ 11.530                                       | 0,38                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | \$ 11.530                                       | 0,38                    |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,750 %           | 15.12.2031            | \$ 1.800        | \$ (241)                                        | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,000             | 19.03.2030            | 69.500          | 2.021                                           | 0,07                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250             | 18.06.2030            | 90.800          | 1.259                                           | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250             | 19.03.2035            | 9.900           | (357)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250             | 19.03.2045            | 6.500           | 71                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250             | 19.03.2055            | 3.400           | (61)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250             | 18.06.2055            | 25.900          | (487)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500             | 20.12.2030            | 29.000          | (752)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500             | 20.12.2033            | 9.250           | 379                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500             | 18.12.2054            | 24.050          | (2.964)                                         | (0,10)                  |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620             | 30.11.2029            | 148.662         | (1.380)                                         | (0,05)                  |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex        | Fest-<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,730 %           | 03.08.2033            | \$ 2.300        | \$ 12                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735             | 07.08.2033            | 2.700           | 16                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2029            | 6.600           | (265)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2029            | 14.200          | 605                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 18.12.2029            | 149.715         | (907)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 18.12.2029            | 2.370           | 44                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2034            | 36.300          | (850)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 18.12.2034            | 5.100           | (117)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750             | 20.06.2036            | 5.700           | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,830             | 12.10.2053            | 1.700           | (27)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870             | 17.10.2053            | 1.400           | (13)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880             | 16.10.2053            | 1.700           | (13)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,000             | 20.06.2026            | 68.700          | 313                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030             | 04.10.2033            | 1.300           | 40                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150             | 12.10.2033            | 3.400           | 139                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,155             | 02.10.2033            | 4.500           | 184                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,165             | 27.09.2033            | 5.500           | 230                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,175             | 10.10.2033            | 4.000           | 170                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,230             | 23.10.2033            | 2.800           | 132                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250             | 20.03.2034            | 23.700          | (234)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250             | 20.03.2034            | 9.100           | 130                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,255             | 23.10.2033            | 2.200           | 108                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,393             | 25.10.2033            | 200             | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,450             | 31.10.2033            | 2.500           | 162                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                | 9,842             | 04.01.2027            | BRL 110.100     | (1.391)                                         | (0,05)                  |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                | 11,253            | 04.01.2027            | 207.600         | 1.491                                           | 0,05                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                | 11,550            | 04.01.2027            | 14.300          | (86)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                | 11,570            | 04.01.2027            | 151.400         | (894)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                | 13,055            | 04.01.2027            | 81.200          | (22)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                | 13,615            | 02.01.2029            | 75.600          | 170                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                | 13,685            | 02.01.2029            | 75.600          | 195                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CLP-CHILIBOR          | 4,855             | 18.12.2033            | CLP 8.000.000   | (72)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month CLP-CHILIBOR          | 5,511             | 13.11.2033            | 8.456.600       | (349)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,075             | 03.10.2029            | CZK 174.000     | (58)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,080             | 03.10.2029            | 361.000         | (116)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,328             | 09.05.2030            | 750.000         | 491                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,363             | 29.05.2030            | 993.800         | 108                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,489             | 30.10.2029            | 458.000         | 412                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR            | 3,530             | 15.07.2029            | 767.200         | 526                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR            | 4,250             | 18.04.2029            | 180.700         | (12)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 17.09.2030            | € 137.400       | (1.867)                                         | (0,06)                  |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 17.09.2035            | 52.000          | (270)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 20.03.2044            | 1.800           | 73                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250             | 17.09.2055            | 35.100          | 1.449                                           | 0,05                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,818             | 26.06.2029            | 24.100          | (25)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR           | 3,300             | 03.10.2033            | 3.700           | 355                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR           | 3,370             | 09.10.2028            | 1.000           | 71                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR           | 3,450             | 20.10.2028            | 4.300           | 320                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR               | 5,935             | 08.05.2030            | HUF 13.405.000  | (146)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR             | 4,075             | 11.04.2030            | PLN 75.300      | 188                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR             | 4,855             | 10.02.2030            | 75.300          | 360                                             | 0,01                    |
|                                                |                               |                   |                       |                 | \$ (1.738)                                      | (0,06)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                               |                   |                       |                 | \$ (1.738)                                      | (0,06)                  |

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

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

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVIENSOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|------------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 46,850         | 14.08.2025         | 7.053                          | \$ (138)   | \$ (56)        | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,500             | 12.01.2026         | 11.987                         | (479)      | (368)          | (0,01)                  |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750             | 03.02.2026         | 26.861                         | (967)      | (961)          | (0,03)                  |
| GLM<br>UAG | Call - OTC USD versus TRY | 42,960             | 04.09.2025         | 7.116                          | (236)      | (151)          | (0,01)                  |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 39,750             | 11.08.2025         | 5.907                          | (185)      | (4)            | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750             | 11.08.2025         | 5.907                          | (130)      | (31)           | 0,00                    |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600             | 12.11.2025         | 6.140                          | (234)      | (33)           | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900             | 12.11.2025         | 6.140                          | (171)      | (114)          | (0,01)                  |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,750             | 09.12.2025         | 8.196                          | (294)      | (105)          | 0,00                    |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 57,750             | 09.12.2025         | 8.196                          | (205)      | (172)          | (0,01)                  |
|            |                           |                    |                    |                                | \$ (3.039) | \$ (1.995)     | (0,07)                  |

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                       | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Oman Government International Bond    | (1,000) %                      | 20.12.2027            | \$ 2.200                       | \$ 72                                    | \$ (97)                                         | \$ (25)        | 0,00                    |
| BPS        | Hungary Government International Bond | (1,000)                        | 20.12.2029            | 9.000                          | 71                                       | (5)                                             | 66             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond  | (1,000)                        | 20.06.2029            | 8.800                          | 35                                       | (81)                                            | (46)           | 0,00                    |
|            | Oman Government International Bond    | (1,000)                        | 20.12.2027            | 700                            | 23                                       | (31)                                            | (8)            | 0,00                    |
| BRC        | Oman Government International Bond    | (1,000)                        | 20.12.2027            | 3.400                          | 91                                       | (130)                                           | (39)           | 0,00                    |
| CBK        | Mexico Government International Bond  | (1,000)                        | 20.06.2029            | 2.400                          | 9                                        | (22)                                            | (13)           | 0,00                    |
| GST        | Mexico Government International Bond  | (1,000)                        | 20.06.2029            | 16.100                         | 70                                       | (155)                                           | (85)           | (0,01)                  |
| JPM        | Mexico Government International Bond  | (1,000)                        | 20.06.2029            | 8.500                          | 52                                       | (97)                                            | (45)           | 0,00                    |
| MYC        | Mexico Government International Bond  | (1,000)                        | 20.06.2029            | 10.200                         | 48                                       | (102)                                           | (54)           | 0,00                    |
|            |                                       |                                |                       |                                | \$ 471                                   | \$ (720)                                        | \$ (249)       | (0,01)                  |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Indonesia Government International Bond    | 1,000 %                        | 20.06.2030            | \$ 3.600                       | \$ 12                                    | \$ 25                                           | \$ 37          | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.06.2026            | 6.400                          | 26                                       | 18                                              | 44             | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.12.2031            | 10.700                         | (451)                                    | 437                                             | (14)           | 0,00                    |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2025            | 1.200                          | (66)                                     | 70                                              | 4              | 0,00                    |
|            | Turkey Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2027            | 100                            | (20)                                     | 18                                              | (2)            | 0,00                    |
| BPS        | Brazil Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2026            | 10.400                         | (639)                                    | 700                                             | 61             | 0,00                    |
|            | Brazil Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2027            | 8.200                          | (589)                                    | 630                                             | 41             | 0,00                    |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2029            | 12.000                         | (432)                                    | 95                                              | (337)          | (0,01)                  |
|            | Indonesia Government International Bond    | 1,000                          | 20.06.2030            | 2.600                          | 6                                        | 21                                              | 27             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2025            | 6.550                          | 32                                       | (8)                                             | 24             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2026            | 13.700                         | 76                                       | 7                                               | 83             | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2027            | 6.000                          | 12                                       | 44                                              | 56             | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.06.2026            | 6.100                          | 54                                       | (12)                                            | 42             | 0,00                    |
|            | Romania Government International Bond      | 1,000                          | 20.12.2025            | 15.750                         | 25                                       | (2)                                             | 23             | 0,00                    |
|            | Serbia Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2027            | 1.600                          | (142)                                    | 144                                             | 2              | 0,00                    |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2028            | 32.000                         | (2.761)                                  | 2.625                                           | (136)          | 0,00                    |
|            | Turkey Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2027            | 3.800                          | (751)                                    | 691                                             | (60)           | 0,00                    |
| BRC        | Benin Government International Bond        | 1,000                          | 20.06.2026            | 2.600                          | (89)                                     | 69                                              | (20)           | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2026            | 2.500                          | 14                                       | 15                                              | 29             | 0,00                    |
|            | Cote d'Ivoire                              | 1,000                          | 20.06.2026            | 1.000                          | (31)                                     | 20                                              | (11)           | 0,00                    |
|            | Indonesia Government International Bond    | 1,000                          | 20.06.2030            | 4.100                          | 10                                       | 32                                              | 42             | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.12.2025            | 17.500                         | 360                                      | (294)                                           | 66             | 0,00                    |
|            | Poland Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2028            | 6.500                          | 49                                       | 50                                              | 99             | 0,00                    |
|            | Romania Government International Bond      | 1,000                          | 20.12.2025            | 9.950                          | 0                                        | 14                                              | 14             | 0,00                    |
| CBK        | Benin Government International Bond        | 1,000                          | 20.06.2026            | 425                            | (15)                                     | 12                                              | (3)            | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2029            | 8.400                          | 169                                      | 14                                              | 183            | 0,01                    |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2029            | 12.200                         | (440)                                    | 97                                              | (343)          | (0,01)                  |
|            | Cote d'Ivoire                              | 1,000                          | 20.06.2026            | 2.150                          | (70)                                     | 46                                              | (24)           | 0,00                    |
|            | Cote d'Ivoire                              | 1,000                          | 20.06.2030            | 1.700                          | (215)                                    | 12                                              | (203)          | (0,01)                  |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2029            | 17.000                         | (151)                                    | 169                                             | 18             | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2034            | 5.000                          | (573)                                    | (33)                                            | (606)          | (0,02)                  |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.06.2026            | 2.100                          | 18                                       | (4)                                             | 14             | 0,00                    |
|            | Qatar Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2026            | 5.000                          | 140                                      | (77)                                            | 63             | 0,00                    |
| DUB        | Indonesia Government International Bond    | 1,000                          | 20.06.2030            | 9.500                          | 17                                       | 81                                              | 98             | 0,00                    |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2026            | 900                            | (15)                                     | 19                                              | 4              | 0,00                    |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026            | 10.400                         | (638)                                    | 678                                             | 40             | 0,00                    |
| GST        | Brazil Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2026            | 200                            | (11)                                     | 12                                              | 1              | 0,00                    |
|            | Chile Government International Bond        | 1,000                          | 20.06.2028            | 8.900                          | 17                                       | 158                                             | 175            | 0,01                    |
|            | Chile Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2029            | 10.000                         | 201                                      | 17                                              | 218            | 0,01                    |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2029            | 7.200                          | (259)                                    | 57                                              | (202)          | (0,01)                  |
|            | Indonesia Government International Bond    | 1,000                          | 20.06.2030            | 2.500                          | 8                                        | 18                                              | 26             | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2030            | 200                            | (8)                                      | 0                                               | (8)            | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.06.2026            | 13.700                         | 99                                       | (6)                                             | 93             | 0,00                    |
|            | Poland Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2028            | 8.500                          | 77                                       | 52                                              | 129            | 0,01                    |
|            | Qatar Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2029            | 7.600                          | 211                                      | 8                                               | 219            | 0,01                    |
|            | Turkey Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2027            | 4.300                          | (840)                                    | 772                                             | (68)           | 0,00                    |
| JPM        | Cote d'Ivoire                              | 1,000                          | 20.06.2030            | 525                            | (66)                                     | 3                                               | (63)           | 0,00                    |
|            | Hungary Government International Bond      | 1,000                          | 20.06.2027            | 5.700                          | (290)                                    | 326                                             | 36             | 0,00                    |
|            | Poland Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2028            | 900                            | (2)                                      | 16                                              | 14             | 0,00                    |
|            | Turkey Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2029            | 3.600                          | (270)                                    | 27                                              | (243)          | (0,01)                  |
| MYC        | Chile Government International Bond        | 1,000                          | 20.06.2026            | 15.000                         | 208                                      | (87)                                            | 121            | 0,01                    |
|            | Chile Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2026            | 16.300                         | 112                                      | 75                                              | 187            | 0,01                    |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2029            | 13.300                         | (478)                                    | 104                                             | (374)          | (0,01)                  |
|            | Cote d'Ivoire                              | 1,000                          | 20.06.2030            | 325                            | (41)                                     | 2                                               | (39)           | 0,00                    |
|            | Indonesia Government International Bond    | 1,000                          | 20.06.2030            | 2.400                          | 6                                        | 19                                              | 25             | 0,00                    |
|            | Nigeria Government International Bond      | 1,000                          | 20.06.2030            | 320                            | (85)                                     | 34                                              | (51)           | 0,00                    |
|            | Panama Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2034            | 5.000                          | (573)                                    | (33)                                            | (606)          | (0,02)                  |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.06.2026            | 9.800                          | 45                                       | 22                                              | 67             | 0,00                    |
|            | Peru Government International Bond         | 1,000                          | 20.12.2026            | 20.000                         | 80                                       | 109                                             | 189            | 0,01                    |
|            | Qatar Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2026            | 3.900                          | 57                                       | (8)                                             | 49             | 0,00                    |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026            | 4.600                          | (206)                                    | 224                                             | 18             | 0,00                    |

| Kontrahent | Referenzeinheit                      | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|--------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| MYI        | Turkey Government International Bond | 1,000 %                        | 20.06.2027            | \$ 1.800                       | \$ (356)                                 | \$ 327                                          | \$ (29)        | 0,00                         |
|            | Peru Government International Bond   | 1,000                          | 20.06.2026            | 1.300                          | 11                                       | (2)                                             | 9              | 0,00                         |
|            |                                      |                                |                       |                                | \$ (9.421)                               | \$ 8.669                                        | \$ (752)       | (0,02)                       |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD                    | 952                      | \$ 618                           | \$ 0                               | \$ (5)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 1.762                    | 2.033                            | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 818                      | 492                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 619                      | AUD 952                          | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 08.2025               |                        | 1.051                    | € 896                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 493                      | NZD 818                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | DOP                    | 163.618                  | \$ 2.741                         | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 377.694                  | 429.456                          | 0                                  | (13.900)                                             | (0,46)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 71.184.304               | 4.363                            | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 32.981                   | 9.065                            | 0                                  | (227)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.400                    | KRW 3.271.625                    | 19                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 9                        | SGD 12                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    | 7.425                    | \$ 124                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 12                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TRY                    | 30.394                   | 709                              | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                    |
|            | 10.2025               | \$                     | 576                      | PEN 2.128                        | 22                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 02.2026               | TRY                    | 175.308                  | \$ 3.666                         | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 753.683                  | 46                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 98                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 835                      | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 64.243                   | 1.977                            | 0                                  | (235)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 36                       | BRL 204                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 29                       | € 25                             | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 400                      | IDR 6.539.686                    | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.240                    | THB 41.031                       | 23                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CZK                    | 1.894                    | \$ 85                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.556                    | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TRY                    | 44.506                   | 1.069                            | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 60.842                   | 1.867                            | 0                                  | (248)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 124                      | TWD 4.063                        | 17                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 05.2026               |                        | 2.697                    | KWD 822                          | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 06.2026               |                        | 3.967                    | 1.212                            | 1                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 06.2027               |                        | 1.056                    | 320                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 05.2029               | KWD                    | 4.233                    | \$ 14.553                        | 636                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2029               |                        | 930                      | 3.200                            | 139                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 05.2030               |                        | 2.509                    | 8.640                            | 345                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               | €                      | 14.979                   | 17.056                           | 0                                  | (528)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | ILS                    | 1.334                    | 372                              | 0                                  | (24)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 30.623                   | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 250.236                  | 6.190                            | 0                                  | (54)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 11.166                   | £ 8.207                          | 80                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 24                       | ¥ 3.488                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 37                       | KRW 50.218                       | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 43                       | NOK 442                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 123                      | PLN 462                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 908                      | TRY 37.229                       | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 382.908                  | \$ 21.183                        | 0                                  | (329)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | CZK                    | 18.686                   | 840                              | 0                                  | (49)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | £                      | 8.207                    | 11.168                           | 0                                  | (80)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 412                      | CZK 8.823                        | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 13                       | TRY 562                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BSH        | 12.2025               | TRY                    | 71.654                   | \$ 1.490                         | 0                                  | (81)                                                 | 0,00                    |
|            | 02.2026               | \$                     | 3.666                    | TRY 175.491                      | 13                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 439                      | PEN 1.581                        | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 75                       | 270                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 11.2025               | PEN                    | 1.587                    | \$ 439                           | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 11.2025               | \$                     | 1.414                    | PEN 5.226                        | 54                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 6.983                    | \$ 8.095                         | 0                                  | (102)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 2.389.823                | 1.744                            | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025               | PEN                    | 18.110                   | \$ 4.986                         | \$ 0                               | \$ (115)                                             | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 5                        | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 5.104                    | 153                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 96.168                   | 2.957                            | 0                                  | (354)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 17.129                   | BRL 99.421                       | 1.088                              | 0                                                    | 1.088                   |
|            | 07.2025               |                        | 996                      | £ 743                            | 23                                 | 0                                                    | 23                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.537                    | IDR 25.030.319                   | 4                                  | 0                                                    | 4                       |
|            | 07.2025               |                        | 379                      | KRW 521.124                      | 6                                  | 0                                                    | 6                       |
|            | 07.2025               |                        | 496                      | THB 16.560                       | 14                                 | 0                                                    | 14                      |
|            | 07.2025               |                        | 7.799                    | TWD 231.767                      | 180                                | 0                                                    | 180                     |
|            | 08.2025               | COP                    | 8.580.391                | \$ 2.058                         | 0                                  | (32)                                                 | (32)                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 8.997                    | 104                              | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025               | PEN                    | 22.727                   | 6.152                            | 0                                  | (245)                                                | (245)                   |
|            | 08.2025               | TWD                    | 102.477                  | 3.138                            | 0                                  | (424)                                                | (424)                   |
|            | 08.2025               | \$                     | 0                        | EGP 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025               |                        | 402                      | INR 34.604                       | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 08.2025               |                        | 113                      | PEN 408                          | 2                                  | 0                                                    | 2                       |
|            | 09.2025               |                        | 2                        | KZT 885                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 12.2025               | PEN                    | 6.562                    | \$ 1.773                         | 0                                  | (69)                                                 | (69)                    |
|            | 07.2025               | KES                    | 172.524                  | 1.307                            | 0                                  | (26)                                                 | (26)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 459.623                  | € 396.192                        | 5.448                              | 0                                                    | 5.448                   |
|            | 07.2025               |                        | 3.506                    | KZT 1.837.045                    | 5                                  | 0                                                    | 5                       |
|            | 07.2025               |                        | 208                      | TWD 6.173                        | 5                                  | 0                                                    | 5                       |
|            | 08.2025               | €                      | 395.324                  | \$ 459.623                       | 0                                  | (5.440)                                              | (5.440)                 |
|            | 08.2025               | INR                    | 5.362                    | 62                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 09.2025               | \$                     | 83                       | KZT 44.061                       | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 09.2025               |                        | 5                        | MXN 96                           | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 10.2025               | EGP                    | 187.970                  | \$ 3.299                         | 0                                  | (344)                                                | (344)                   |
|            | 12.2025               | \$                     | 808                      | KZT 430.333                      | 0                                  | (20)                                                 | (20)                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 99.637                   | \$ 17.458                        | 0                                  | (798)                                                | (798)                   |
|            | 07.2025               | CHF                    | 305                      | 371                              | 0                                  | (13)                                                 | (13)                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 1.098.954                | 7.550                            | 0                                  | (58)                                                 | (58)                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 1.007                    | 273                              | 0                                  | (6)                                                  | (6)                     |
|            | 07.2025               | \$                     | 614                      | AUD 952                          | 10                                 | 0                                                    | 10                      |
|            | 07.2025               |                        | 381                      | CHF 305                          | 2                                  | 0                                                    | 2                       |
|            | 07.2025               |                        | 13.414                   | ¥ 1.924.305                      | 0                                  | (92)                                                 | (92)                    |
|            | 07.2025               |                        | 8.787                    | PEN 31.404                       | 61                                 | 0                                                    | 61                      |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | SGD 5                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025               | CHF                    | 304                      | \$ 381                           | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     |
|            | 08.2025               | INR                    | 2.568                    | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025               | SGD                    | 5                        | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 7.550                    | ¥ 1.094.912                      | 58                                 | 0                                                    | 58                      |
|            | 09.2025               | MXN                    | 80.393                   | \$ 4.129                         | 0                                  | (92)                                                 | (92)                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 908                      | BRL 5.091                        | 11                                 | 0                                                    | 11                      |
|            | 09.2025               |                        | 0                        | PEN 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 11.2025               | PEN                    | 7.025                    | \$ 1.919                         | 0                                  | (53)                                                 | (53)                    |
|            | 12.2025               |                        | 31.563                   | 8.787                            | 0                                  | (63)                                                 | (63)                    |
|            | 07.2025               | DOP                    | 413.375                  | 6.978                            | 87                                 | 0                                                    | 87                      |
|            | 07.2025               | ILS                    | 1.264                    | 372                              | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     |
|            | 07.2025               | \$                     | 364                      | IDR 5.937.295                    | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 07.2025               |                        | 632                      | MYR 2.675                        | 4                                  | 0                                                    | 4                       |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 1.596                    | \$ 88                            | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
|            | 08.2025               | DOP                    | 67.728                   | 1.117                            | 11                                 | (18)                                                 | (7)                     |
|            | 08.2025               | HUF                    | 677.892                  | 1.871                            | 0                                  | (114)                                                | (114)                   |
|            | 09.2025               | AED                    | 4.026                    | 1.096                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 09.2025               | DOP                    | 678.397                  | 10.789                           | 60                                 | (418)                                                | (358)                   |
|            | 09.2025               | \$                     | 89                       | KZT 46.525                       | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
|            | 10.2025               | EGP                    | 153.138                  | \$ 2.698                         | 0                                  | (261)                                                | (261)                   |
|            | 11.2025               | DOP                    | 198.721                  | 3.288                            | 81                                 | 0                                                    | 81                      |
|            | 07.2025               | KRW                    | 199.009                  | 145                              | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     |
|            | 07.2025               | PHP                    | 7.729                    | 138                              | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 07.2025               | PLN                    | 1.816                    | 491                              | 0                                  | (11)                                                 | (11)                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 81                       | 63                               | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
|            | 07.2025               | TWD                    | 64.988                   | 1.998                            | 0                                  | (239)                                                | (239)                   |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.822                    | € 1.591                          | 45                                 | 0                                                    | 45                      |
|            | 07.2025               |                        | 121                      | £ 88                             | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025               |                        | 488                      | NZD 818                          | 9                                  | 0                                                    | 9                       |
|            | 07.2025               |                        | 1.320                    | PLN 4.959                        | 52                                 | 0                                                    | 52                      |
|            | 07.2025               |                        | 6                        | SGD 8                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025               |                        | 951                      | TWD 28.244                       | 21                                 | 0                                                    | 21                      |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 108.570                  | \$ 6.075                         | 0                                  | (25)                                                 | (25)                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.735                    | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025               | SGD                    | 8                        | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025               | TWD                    | 41.097                   | 1.256                            | 0                                  | (173)                                                | (173)                   |
|            | 10.2025               | EGP                    | 364.946                  | 6.402                            | 0                                  | (659)                                                | (659)                   |
|            | 07.2026               |                        | 129.218                  | 2.094                            | 0                                  | (142)                                                | (142)                   |
|            | 07.2025               | CAD                    | 846                      | 616                              | 0                                  | (4)                                                  | (4)                     |
|            | 07.2025               | €                      | 231                      | 265                              | 0                                  | (6)                                                  | (6)                     |
|            | 07.2025               | PHP                    | 4.363                    | 78                               | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 07.2025               | SGD                    | 196                      | 152                              | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
|            | 07.2025               | THB                    | 2.562                    | 77                               | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     |
|            | 07.2025               | TWD                    | 35.403                   | 1.086                            | 0                                  | (133)                                                | (133)                   |



| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| MYI        | 07.2025               | \$                     | 615                      | CAD                              | 846                                | \$                                                   | 5                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 4.974                    | €                                | 4.315                              |                                                      | 91                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 307                      | IDR                              | 4.985.432                          |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 588                      | ¥                                | 84.410                             |                                                      | (3)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 947                      | PLN                              | 3.545                              |                                                      | 34                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 160                      | SGD                              | 207                                |                                                      | 2                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 744                      | THB                              | 24.812                             |                                                      | 20                      | 0,00   |
|            | 08.2025               | CAD                    | 844                      | \$                               | 615                                |                                                      | (5)                     | 0,00   |
|            | 08.2025               | SGD                    | 206                      |                                  | 160                                |                                                      | (3)                     | 0,00   |
|            | 08.2025               | TWD                    | 40.091                   |                                  | 1.230                              |                                                      | (163)                   | (0,01) |
|            | 08.2025               | \$                     | 449                      | EGP                              | 24.752                             |                                                      | 40                      | 0,00   |
|            | 10.2025               | EGP                    | 215.115                  | \$                               | 3.762                              |                                                      | (403)                   | (0,01) |
|            | 07.2025               | CHF                    | 6                        |                                  | 8                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | €                      | 204                      |                                  | 233                                |                                                      | (6)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | ¥                      | 350.115                  |                                  | 2.401                              |                                                      | (23)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | NOK                    | 4.179                    |                                  | 414                                |                                                      | 1                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | PLN                    | 5                        |                                  | 1                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 7                        | CHF                              | 5                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 100                      | €                                | 85                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 285                      | £                                | 208                                |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 301                      | ¥                                | 43.470                             |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 2.401                    |                                  | 348.828                            |                                                      | 23                      | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 414                      | NOK                              | 4.178                              |                                                      | (1)                     | 0,00   |
|            | 10.2025               | EGP                    | 140.543                  | \$                               | 2.470                              |                                                      | (234)                   | (0,01) |
|            | 10.2025               | \$                     | 3.457                    | EGP                              | 197.402                            |                                                      | 357                     | 0,01   |
|            | 07.2025               | ¥                      | 434                      | \$                               | 3                                  |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | KES                    | 90.552                   |                                  | 686                                |                                                      | (14)                    | 0,00   |
| 07.2025    | \$                    | 1.695                  | IDR                      | 27.612.480                       |                                    | 6                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | 32                     | SGD                      | 41                               |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | 8.587                  | TWD                      | 254.123                          |                                    | 162                                                  | 0,01                    |        |
| 08.2025    | INR                   | 1.799                  | \$                       | 21                               |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    | SGD                   | 41                     |                          | 32                               |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    | TWD                   | 20.109                 |                          | 616                              |                                    | (83)                                                 | 0,00                    |        |
| 08.2025    | \$                    | 3                      | ¥                        | 433                              |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    | ¥                     | 50.789                 | \$                       | 352                              |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    | NOK                   | 435                    |                          | 43                               |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    | \$                    | 79                     | €                        | 68                               |                                    | 2                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | 59                     | RON                      | 261                              |                                    | 1                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    | HUF                   | 31.996                 | \$                       | 88                               |                                    | (5)                                                  | 0,00                    |        |
| 08.2025    | \$                    | 352                    | ¥                        | 50.603                           |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                       | 43                     | NOK                      | 435                              |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    | £                     | 8.950                  | \$                       | 12.118                           |                                    | (146)                                                | (0,01)                  |        |
| 07.2025    | \$                    | 8.347                  | €                        | 7.198                            |                                    | 102                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    | ILS                   | 189                    | \$                       | 53                               |                                    | (3)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    | THB                   | 462                    |                          | 14                               |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    | \$                    | 1.295                  | CLP                      | 1.215.529                        |                                    | 8                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | 196                    | ¥                        | 28.363                           |                                    | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | 411                    | NOK                      | 4.172                            |                                    | 1                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                       | 45                     | RON                      | 198                              |                                    | 1                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                       | 945                    | TRY                      | 41.727                           |                                    | 68                                                   | 0,00                    |        |
| 11.2025    |                       | 1.044                  |                          | 49.194                           |                                    | 58                                                   | 0,00                    |        |
| 12.2025    |                       | 1.490                  |                          | 71.654                           |                                    | 80                                                   | 0,00                    |        |
| 07.2025    | €                     | 7.444                  | \$                       | 8.718                            |                                    | (20)                                                 | 0,00                    |        |
| 07.2025    | ¥                     | 583.588                |                          | 4.052                            |                                    | 12                                                   | 0,00                    |        |
| 08.2025    | \$                    | 8.456                  | €                        | 7.196                            |                                    | 9                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                       | 4.052                  | ¥                        | 581.440                          |                                    | (12)                                                 | 0,00                    |        |
|            |                       |                        |                          | \$                               | 9.791                              | \$ (27.618)                                          | \$ (17.827)             | (0,59) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

|            | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| Kontrahent |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |        |
| BOA        | 07.2025               | CHF                    | 43                       | \$                               | 53                                 | \$                                                   | (1)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 581                      | CHF                              | 474                                |                                                      | 15                      | 0,00   |
| BRC        | 07.2025               |                        | 379                      |                                  | 309                                |                                                      | 10                      | 0,00   |
| CBK        | 07.2025               |                        | 4.785                    |                                  | 3.897                              |                                                      | 111                     | 0,00   |
| FAR        | 07.2025               | CHF                    | 188.520                  | \$                               | 235.483                            |                                                      | (1.352)                 | (0,04) |
|            | 07.2025               | \$                     | 224.518                  | CHF                              | 184.885                            |                                                      | 7.750                   | 0,26   |
|            | 08.2025               |                        | 235.483                  |                                  | 187.744                            |                                                      | 1.357                   | 0,05   |
| MBC        | 07.2025               | CHF                    | 269                      | \$                               | 331                                |                                                      | (8)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 224.623                  | CHF                              | 184.590                            |                                                      | 7.274                   | 0,24   |
| MYI        | 07.2025               | CHF                    | 414                      | \$                               | 507                                |                                                      | (13)                    | 0,00   |
| RBC        | 07.2025               | \$                     | 211.741                  | CHF                              | 173.655                            |                                                      | 6.418                   | 0,21   |
| SCX        | 07.2025               |                        | 13                       |                                  | 10                                 |                                                      | 0                       | 0,00   |
|            |                       |                        |                          | \$                               | 22.935                             | \$                                                   | (1.374)                 |        |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$                                                   | 21.561                  | 0,72   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 293.651              | \$ 343.830               | \$ 0                             | \$ (872)                           | \$ (872)                                             | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | \$ 344.583             | € 293.651                | 870                              | 0                                  | 870                                                  | 0,03                    |
| BOA        | 07.2025               | 350.159                | 307.954                  | 11.333                           | 0                                  | 11.333                                               | 0,38                    |
| BPS        | 07.2025               | € 461                  | \$ 533                   | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 970                 | € 855                    | 33                               | 0                                  | 33                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | 361.466                | 318.250                  | 12.112                           | 0                                  | 12.112                                               | 0,40                    |
| CBK        | 07.2025               | 19.278                 | 16.633                   | 247                              | 0                                  | 247                                                  | 0,01                    |
| DUB        | 07.2025               | € 327.217              | \$ 379.605               | 0                                | (4.499)                            | (4.499)                                              | (0,15)                  |
|            | 08.2025               | \$ 379.605             | € 326.500                | 4.493                            | 0                                  | 4.493                                                | 0,15                    |
| MBC        | 07.2025               | € 172                  | \$ 196                   | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 15.682              | € 13.634                 | 322                              | 0                                  | 322                                                  | 0,01                    |
| WST        | 07.2025               | € 324.486              | \$ 380.509               | 0                                | (389)                              | (389)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$ 331.723             | € 293.633                | 12.958                           | 0                                  | 12.958                                               | 0,43                    |
|            | 08.2025               | 381.339                | 324.486                  | 390                              | 0                                  | 390                                                  | 0,01                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 42.758                        | \$ (5.773)                         | \$ 36.985                                            | 1,23                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £ 4.023                | \$ 5.520                 | \$ 7                             | \$ 0                               | \$ 7                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 5.521               | £ 4.023                  | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025               | £ 462                  | \$ 627                   | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | 4.879                  | 6.631                    | 0                                | (56)                               | (56)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 6.424               | £ 4.758                  | 96                               | 0                                  | 96                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 5.994                  | 4.405                    | 43                               | 0                                  | 43                                                   | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | £ 73                   | \$ 98                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 3                   | £ 2                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | £ 38                   | \$ 52                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 6.183               | £ 4.586                  | 100                              | 0                                  | 100                                                  | 0,01                    |
| SSB        | 07.2025               | £ 4.372                | \$ 5.995                 | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 6.396               | £ 4.724                  | 77                               | 0                                  | 77                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 5.995                  | 4.372                    | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | £ 222                  | \$ 301                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 327                           | \$ (79)                            | \$ 248                                               | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC        | 07.2025               | \$ 195                 | NOK 1.990                | \$ 1                             | \$ 0                               | \$ 1                                                 | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | 8                      | 80                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | NOK 1.841              | \$ 183                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 197                 | NOK 2.000                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 183                    | 1.841                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025               | NOK 2.036              | \$ 203                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 203                 | NOK 2.036                | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | 177                    | 1.800                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 6                             | \$ (3)                             | \$ 3                                                 | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Investor SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA                              | 07.2025               | SEK 32                 | \$ 3                     | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
| BPS                              | 07.2025               | 14                     | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 17                  | SEK 163                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC                              | 07.2025               | 2                      | 21                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK                              | 07.2025               | SEK 9.666              | \$ 1.020                 | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 21                  | SEK 195                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | 1.010                  | 9.553                    | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
| FAR                              | 07.2025               | 972                    | 9.313                    | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| IND                              | 07.2025               | SEK 9.470              | \$ 1.001                 | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$ 1.001               | SEK 9.450                | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
| MBC                              | 07.2025               | SEK 104                | \$ 11                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI                              | 07.2025               | \$ 898                 | SEK 8.630                | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
| RYL                              | 07.2025               | SEK 11                 | \$ 1                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 21                  | SEK 195                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX                              | 07.2025               | 0                      | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025               | 972                    | 9.342                    | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 33                            | \$ (13)                            | \$ 20                                                | 0,00                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 37.994                                            | 1,27                    |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                          |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 2.100.000   | \$ 252                   | 0,01                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | \$ 252                   | 0,01                         |
| Summe Anlagen                              |                | \$ 3.225.308             | 107,64                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |                | \$ (228.995)             | (7,64)                       |
| Nettovermögen                              |                | \$ 2.996.313             | 100,00                       |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 277.420 USD (31. Dezember 2024: 1.433 USD) und Barmittel in Höhe von 809 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 10.010 USD) als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 659 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 31.299 USD (31. Dezember 2024: 32.004 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD null (31. Dezember 2024: 10 USD) und Barmittel in Höhe von 8.287 USD (31. Dezember 2024: 33.543 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 3.019.518                                                    | \$ 101.152                                                   | \$ 3.120.670        |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 56.600                                                          | 0                                                            | 56.600              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (93)                                                                        | 47.879                                                          | 0                                                            | 47.786              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 252                                                             | 0                                                            | 252                 |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ (93)</b>                                                              | <b>\$ 3.124.249</b>                                             | <b>\$ 101.152</b>                                            | <b>\$ 3.225.308</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 2.819.289                                                    | \$ 76.248                                                    | \$ 2.895.537        |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 93.431                                                          | 0                                                            | 93.431              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (96)                                                                        | (33.073)                                                        | 0                                                            | (33.169)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 263                                                             | 0                                                            | 263                 |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ (96)</b>                                                              | <b>\$ 2.879.910</b>                                             | <b>\$ 76.248</b>                                             | <b>\$ 2.956.062</b> |

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

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

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond ESG Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS                                | 3,600 %         | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (1.057)        | \$ (1.077)                                                      | (0,04)                  |
|                                    | 4,100           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.578)           | (2.635)                                                         | (0,09)                  |
| BRC                                | 1,700           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (6.773)         | (7.958)                                                         | (0,27)                  |
|                                    | 2,080           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (28.546)          | (33.546)                                                        | (1,12)                  |
|                                    | 3,500           | 26.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (2.184)        | (2.205)                                                         | (0,07)                  |
|                                    | 4,150           | 28.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (301)             | (303)                                                           | (0,01)                  |
|                                    | 4,350           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (5.082)           | (5.200)                                                         | (0,17)                  |
|                                    | 4,450           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.239)           | (2.292)                                                         | (0,08)                  |
|                                    | 4,500           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (13.824)          | (14.157)                                                        | (0,47)                  |
| GSC                                | 2,000           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (3.798)         | (4.463)                                                         | (0,15)                  |
| JML                                | 4,550           | 09.05.2025            | 01.08.2025            | \$ (2.251)        | (2.266)                                                         | (0,07)                  |
| MEI                                | 3,000           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (862)             | (862)                                                           | (0,03)                  |
|                                    | 4,100           | 24.06.2025            | 01.08.2025            | (7.075)           | (7.081)                                                         | (0,24)                  |
|                                    | 4,200           | 24.06.2025            | 01.08.2025            | (9.449)           | (9.456)                                                         | (0,32)                  |
|                                    | 4,300           | 26.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.846)           | (1.867)                                                         | (0,06)                  |
| MYI                                | 2,030           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (4.312)         | (5.068)                                                         | (0,17)                  |
|                                    | 3,250           | 23.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (318)          | (319)                                                           | (0,01)                  |
|                                    | 3,250           | 05.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (191)             | (191)                                                           | (0,01)                  |
|                                    | 3,750           | 05.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.007)           | (1.009)                                                         | (0,03)                  |
|                                    | 4,200           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.357)           | (1.388)                                                         | (0,05)                  |
| NOM                                | 4,450           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (9.641)           | (9.871)                                                         | (0,33)                  |
|                                    | 4,200           | 26.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (5.282)           | (5.285)                                                         | (0,18)                  |
|                                    | 4,250           | 25.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.010)           | (1.017)                                                         | (0,03)                  |
|                                    | 4,300           | 26.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.563)           | (2.564)                                                         | (0,08)                  |
|                                    | 4,500           | 26.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (38.006)          | (38.030)                                                        | (1,27)                  |
|                                    | 4,600           | 29.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (12.199)          | (12.297)                                                        | (0,41)                  |
| SCX                                | 2,100           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (10.302)        | (12.107)                                                        | (0,40)                  |
|                                    | 4,000           | 05.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (753)          | (757)                                                           | (0,02)                  |
|                                    | 4,000           | 29.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.348)           | (2.357)                                                         | (0,08)                  |
|                                    | 4,150           | 07.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.475)           | (2.499)                                                         | (0,08)                  |
|                                    | 4,150           | 05.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.630)           | (1.641)                                                         | (0,05)                  |
|                                    | 4,150           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (5.360)           | (5.373)                                                         | (0,18)                  |
|                                    | 4,200           | 29.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (4.882)           | (4.901)                                                         | (0,16)                  |
|                                    | 4,250           | 20.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (3.557)           | (3.600)                                                         | (0,12)                  |
|                                    | 4,250           | 29.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (3.495)           | (3.509)                                                         | (0,12)                  |
|                                    | 4,450           | 10.01.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.549)           | (2.603)                                                         | (0,09)                  |
|                                    | 4,450           | 29.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (3.621)           | (3.636)                                                         | (0,12)                  |
|                                    | 4,500           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (4.569)           | (4.679)                                                         | (0,16)                  |
| TDM                                | 4,520           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (32.107)          | (32.885)                                                        | (1,10)                  |
|                                    | 4,520           | 26.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (5.909)           | (5.972)                                                         | (0,20)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (258.926)                                                    | (8,64)                  |

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (34)                             | \$ 0                                  | \$ (34)                             | \$ 259                              | \$ 0                                  | \$ 259                              |
| BOA        | (4.128)                             | 4.100                                 | (28)                                | (328)                               | 310                                   | (18)                                |
| BPS        | 504                                 | (270)                                 | 234                                 | 4.936                               | (3.970)                               | 966                                 |
| BRC        | 11.362                              | (10.510)                              | 852                                 | (3.893)                             | 2.950                                 | (943)                               |
| BSH        | 55                                  | (60)                                  | (5)                                 | 33                                  | 0                                     | 33                                  |
| CBK        | (608)                               | 904                                   | 296                                 | (1.021)                             | 952                                   | (69)                                |
| DUB        | (236)                               | 310                                   | 74                                  | (6.666)                             | 5.930                                 | (736)                               |
| FAR        | 6.725                               | (5.990)                               | 735                                 | (58)                                | 0                                     | (58)                                |
| GLM        | (723)                               | 910                                   | 187                                 | (4.273)                             | 4.549                                 | 276                                 |
| GST        | 498                                 | (454)                                 | 44                                  | (725)                               | 741                                   | 16                                  |
| JPM        | (1.425)                             | 1.250                                 | (175)                               | 662                                 | (890)                                 | (228)                               |
| MBC        | 7.152                               | (5.920)                               | 1.232                               | (6.307)                             | 5.820                                 | (487)                               |
| MYC        | (497)                               | 490                                   | (7)                                 | (314)                               | 70                                    | (244)                               |
| MYI        | 121                                 | (80)                                  | 41                                  | (106)                               | (107)                                 | (213)                               |
| RBC        | 6.418                               | (5.270)                               | 1.148                               | (1.114)                             | 820                                   | (294)                               |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 257                                 | 0                                     | 257                                 |
| SCX        | 71                                  | 0                                     | 71                                  | (11.602)                            | 10.771                                | (831)                               |
| SOG        | (2)                                 | 0                                     | (2)                                 | 62                                  | 0                                     | 62                                  |
| SSB        | 33                                  | 0                                     | 33                                  | 129                                 | 0                                     | 129                                 |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (13)                                | 10                                    | (3)                                 |
| UAG        | (240)                               | 323                                   | 83                                  | (450)                               | 630                                   | 180                                 |
| WST        | 12.948                              | (12.350)                              | 598                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

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

**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| <b>Analyse des Gesamtvermögens</b>                                     | <b>30. Jun. 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|------------------------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 80,76                    | 84,23                    |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 10,58                    | 6,95                     |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 1,66                     | 2,94                     |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,35                     | k. A.                    |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,36                     | 0,41                     |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,30                     | 0,56                     |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,01                     | 0,01                     |
| Sonstige Aktiva                                                        | 3,98                     | 4,90                     |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>            | <b>100,00</b>            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| <b>Anlagen zum Marktwert</b> | <b>30. Jun. 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Argentinien                  | 2,73                     | 3,19                     |
| Österreich                   | 0,35                     | 0,38                     |
| Bahrain                      | 1,09                     | 0,96                     |
| Benin                        | 0,60                     | 0,67                     |
| Bermuda                      | 0,12                     | 0,13                     |
| Brasilien                    | 2,54                     | 2,85                     |
| Bulgarien                    | 0,48                     | k. A.                    |
| Kaimaninseln                 | 2,25                     | 2,27                     |
| Chile                        | 4,05                     | 4,20                     |
| China                        | 0,00                     | 0,00                     |
| Kolumbien                    | 3,35                     | 2,58                     |
| Costa Rica                   | 0,80                     | 0,94                     |
| Zypern                       | 0,29                     | 0,28                     |
| Tschechische Republik        | 0,30                     | 0,29                     |
| Dominikanische Republik      | 4,09                     | 3,73                     |
| Ecuador                      | 2,23                     | 2,08                     |
| Ägypten                      | 3,23                     | 3,05                     |
| El Salvador                  | 1,23                     | 1,50                     |
| Estland                      | 0,41                     | 0,41                     |
| Frankreich                   | 0,06                     | k. A.                    |
| Gabun                        | 0,37                     | 0,09                     |
| Georgien                     | 0,32                     | 0,35                     |
| Ghana                        | 1,16                     | 1,40                     |
| Guernsey, Kanalinseln        | 0,06                     | 0,06                     |
| Hongkong                     | 1,73                     | 1,60                     |
| Ungarn                       | 4,13                     | 3,65                     |
| Indien                       | 1,42                     | 1,44                     |
| Indonesien                   | 2,62                     | 2,25                     |
| International                | 0,40                     | 0,41                     |
| Irland                       | 1,42                     | 0,88                     |
| Elfenbeinküste               | 2,56                     | 2,52                     |
| Jamaika                      | 0,10                     | 0,11                     |
| Jordanien                    | 0,25                     | 0,48                     |
| Kasachstan                   | 0,23                     | k. A.                    |
| Kenia                        | 1,04                     | 1,05                     |
| Lettland                     | 0,19                     | 0,20                     |
| Luxemburg                    | 1,69                     | 1,09                     |
| Mazedonien                   | 0,23                     | 0,25                     |
| Malaysia                     | 0,03                     | 0,03                     |
| Mauritius                    | 0,48                     | 0,17                     |
| Mexiko                       | 4,02                     | 4,41                     |
| Mongolei                     | 0,47                     | 0,52                     |
| Marokko                      | 0,50                     | 0,56                     |
| Multinational                | 0,02                     | 0,02                     |
| Niederlande                  | 0,51                     | 0,50                     |
| Oman                         | 1,20                     | 1,31                     |
| Pakistan                     | 0,76                     | 0,80                     |
| Panama                       | 1,86                     | 2,02                     |
| Paraguay                     | 0,95                     | 0,86                     |
| Peru                         | 3,85                     | 3,38                     |
| Philippinen                  | 1,70                     | 1,59                     |
| Polen                        | 1,73                     | 1,65                     |
| Katar                        | 1,85                     | 2,21                     |
| Rumänien                     | 3,28                     | 3,10                     |
| Russland                     | 0,01                     | 0,01                     |
| Senegal                      | 0,74                     | 0,72                     |
| Serbien                      | 2,10                     | 2,24                     |
| Singapur                     | 0,19                     | 0,21                     |
| Südafrika                    | 1,86                     | 2,16                     |
| Südkorea                     | 3,96                     | 4,66                     |
| Sri Lanka                    | 1,06                     | 1,37                     |
| Supranational                | 0,72                     | 0,96                     |
| Tansania                     | 0,44                     | 0,51                     |
| Trinidad und Tobago          | 0,15                     | 0,16                     |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Tunesien                                                                               | k. A.             | 0,58              |
| Türkei                                                                                 | 2,84              | 3,26              |
| Ukraine                                                                                | 1,41              | 1,63              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 3,50              | 4,52              |
| Großbritannien                                                                         | 0,45              | 0,60              |
| USA                                                                                    | 7,70              | 8,64              |
| Uruguay                                                                                | 1,16              | 1,14              |
| Usbekistan                                                                             | 1,35              | 0,99              |
| Jungferninseln (Britisch)                                                              | 0,18              | 0,22              |
| Sambia                                                                                 | 0,01              | 0,01              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,99              | 3,14              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 1,89              | 3,49              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,38              | (0,25)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Zinsswaps                                                                              | (0,06)            | 0,15              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,07)            | (0,14)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | (0,01)            | (0,03)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | (0,02)            | (0,07)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,59)            | 0,46              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,96              | (1,36)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,01              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (7,64)            | (10,46)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                                                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------|--------------------------|-------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                                                                                        |                |                |                          |       |
| KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG                                                                              |                |                |                          |       |
| Republik Elfenbeinküste<br>TBD % fällig am 06.03.2026                                                           | € 800          | \$ 935         | 0,57                     |       |
| Republik Panama<br>4,103 % fällig am 05.03.2027                                                                 | 400            | 473            | 0,29                     |       |
| SOCAR Turkey Enerji A/S<br>TBD % fällig am 11.08.2026                                                           | 1.000          | 1.172          | 0,72                     |       |
| Stepstone Group Midco GmbH<br>8,608 % - 8,651 % fällig<br>am 19.12.2031                                         | \$ 700         | 681            | 0,42                     |       |
| Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.<br>5,001 % fällig am 15.12.2028                                                 | € 1.000        | 1.178          | 0,72                     |       |
| Veon Amsterdam<br>8,531 % - 10,750 % fällig<br>am 25.03.2027                                                    | \$ 500         | 500            | 0,30                     |       |
|                                                                                                                 |                | 4.939          | 3,02                     |       |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                                                                                |                |                |                          |       |
| BANKEN UND FINANZEN                                                                                             |                |                |                          |       |
| Abu Dhabi Commercial Bank PJSC<br>3,500 % fällig am 31.03.2027                                                  | 700            | 690            | 0,42                     |       |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC<br>4,500 % fällig am 06.05.2030                                        | 400            | 400            | 0,24                     |       |
| 5,000 % fällig am 06.05.2035                                                                                    | 400            | 400            | 0,24                     |       |
| AerCap Ireland Capital DAC<br>6,100 % fällig am 15.01.2027                                                      | 200            | 205            | 0,12                     |       |
| AIA Group Ltd.<br>3,600 % fällig am 09.04.2029                                                                  | 500            | 489            | 0,30                     |       |
| Akbank TAS<br>7,498 % fällig am 20.01.2030                                                                      | 1.153          | 1.175          | 0,72                     |       |
| Aldar Investment Properties Sukuk Ltd.<br>5,250 % fällig am 25.03.2035                                          | 400            | 403            | 0,25                     |       |
| Alpha Star Holding Ltd.<br>7,000 % fällig am 26.08.2028                                                         | 700            | 710            | 0,43                     |       |
| Arabian Centres Sukuk Ltd.<br>9,500 % fällig am 06.03.2029                                                      | 300            | 308            | 0,19                     |       |
| Azule Energy Finance PLC<br>8,125 % fällig am 23.01.2030                                                        | 1.000          | 991            | 0,61                     |       |
| Banco Davivienda S.A.<br>8,125 % fällig am<br>02.07.2035 (a)(h)                                                 | 800            | 805            | 0,49                     |       |
| Banco de Chile<br>2,990 % fällig am 09.12.2031                                                                  | 1.100          | 981            | 0,60                     |       |
| Banco de Credito del Peru S.A.<br>3,125 % fällig am<br>01.07.2030 (h)                                           | 800            | 800            | 0,49                     |       |
| 6,450 % fällig am 30.07.2035                                                                                    | 800            | 816            | 0,50                     |       |
| Banco do Brasil S.A.<br>8,500 % fällig am 29.07.2026                                                            | MXN 13.000     | 690            | 0,42                     |       |
| Banco Inbursa S.A.<br>4,375 % fällig am 11.04.2027                                                              | \$ 1.025       | 1.015          | 0,62                     |       |
| Banco Mercantil del Norte S.A.<br>5,875 % fällig am<br>24.01.2027 (f)(h)                                        | 400            | 389            | 0,24                     |       |
| Banco Votorantim S.A.<br>5,875 % fällig am<br>08.04.2028 (j)                                                    | 800            | 812            | 0,50                     |       |
| Bank Hapoalim B.M.<br>3,255 % fällig am<br>21.01.2032 (h)                                                       | 400            | 383            | 0,23                     |       |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.<br>7,129 % fällig am<br>18.07.2033 (h)                                                | 400            | 411            | 0,25                     |       |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT<br>4,900 % fällig am 24.03.2028                                                     | 1.600          | 1.610          | 0,98                     |       |
| BBVA Bancomer S.A.<br>7,625 % fällig am<br>11.02.2035 (h)                                                       | 400            | 412            | 0,25                     |       |
| Caixa Economica Federal<br>5,625 % fällig am 13.05.2030                                                         | 800            | 800            | 0,49                     |       |
| Cathaylife Singapore Pte Ltd.<br>5,950 % fällig am 05.07.2034                                                   | 300            | 309            | 0,19                     |       |
| Central Plaza Development Ltd.<br>7,150 % fällig am 21.03.2028                                                  | 800            | 811            | 0,50                     |       |
| CFAMC Co. Ltd.<br>3,375 % fällig am 24.02.2030                                                                  | 200            | 184            | 0,11                     |       |
| CIMA Finance DAC<br>2,950 % fällig am 05.09.2029                                                                | 213            | 196            | 0,12                     |       |
| Country Garden Holdings Co. Ltd.<br>3,125 % fällig am<br>22.10.2025 ^                                           | 200            | 15             | 0,01                     |       |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.<br>9,700 % fällig am 05.03.2045                                    | PEN 900        | 265            | 0,16                     |       |
| 10,100 % fällig am 15.12.2043                                                                                   | 1.100          | 329            | 0,20                     |       |
| Elect Global Investments Ltd.<br>7,200 % fällig am<br>11.09.2030 (f)                                            | \$ 600         | 583            | 0,36                     |       |
| Emaar Sukuk Ltd.<br>3,635 % fällig am 15.09.2026                                                                | 400            | 395            | 0,24                     |       |
| Emirates NBD Bank PJSC<br>5,875 % fällig am 11.10.2028                                                          | 500            | 522            | 0,32                     |       |
| Esic Sukuk Ltd.<br>5,831 % fällig am 14.02.2029                                                                 | 400            | 407            | 0,25                     |       |
| First Abu Dhabi Bank PJSC<br>5,125 % fällig am 13.10.2027                                                       | 900            | 915            | 0,56                     |       |
| FWD Group Holdings Ltd.<br>8,400 % fällig am 05.04.2029                                                         | 300            | 308            | 0,19                     |       |
| GLP Pte. Ltd.<br>9,750 % fällig am 20.05.2028                                                                   | 400            | 384            | 0,23                     |       |
| Greentown China Holdings Ltd.<br>8,450 % fällig am 24.02.2028                                                   | 700            | 715            | 0,44                     |       |
| Hanwha Life Insurance Co. Ltd.<br>6,300 % fällig am 24.06.2055                                                  | 800            | 825            | 0,50                     |       |
| Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.<br>9,620 % fällig am 28.06.2018                                              | MXN 34.709     | 0              | 0,00                     |       |
| IIFL Finance Ltd.<br>8,750 % fällig am 24.07.2028                                                               | \$ 400         | 403            | 0,25                     |       |
| Interocéanica Finance Ltd.<br>0,000 % fällig am<br>30.11.2025 (d)                                               | 4              | 4              | 0,00                     |       |
| Iridium Capital PLC<br>9,250 % fällig am 18.06.2029                                                             | € 500          | 637            | 0,39                     |       |
| Kaisa Group Holdings Ltd.<br>9,375 % fällig am 30.06.2024 ^                                                     | \$ 300         | 13             | 0,01                     |       |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^                                                                                  | 1.400          | 63             | 0,04                     |       |
| Kasikornbank PCL<br>3,343 % fällig am<br>02.10.2031 (h)                                                         | 600            | 584            | 0,36                     |       |
| KFH Sukuk Co.<br>5,376 % fällig am 14.01.2030                                                                   | 300            | 307            | 0,19                     |       |
| Kookmin Bank<br>2,500 % fällig am<br>04.11.2030 (h)                                                             | 1.100          | 984            | 0,60                     |       |
| Kuwait Projects Co. SPC Ltd.<br>4,229 % fällig am<br>29.10.2026 (j)                                             | 500            | 473            | 0,29                     |       |
| 4,500 % fällig am 23.02.2027                                                                                    | 482            | 458            | 0,28                     |       |
| Longfor Group Holdings Ltd.<br>4,500 % fällig am 16.01.2028                                                     | 200            | 179            | 0,11                     |       |
| mBank S.A.<br>4,778 % fällig am 25.09.2035                                                                      | € 100          | 118            | 0,07                     |       |
| Muthoot Finance Ltd.<br>6,375 % fällig am 23.04.2029                                                            | \$ 300         | 299            | 0,18                     |       |
| Nanshan Life Pte Ltd.<br>5,450 % fällig am 11.09.2034                                                           | 400            | 376            | 0,23                     |       |
| NBK SPC Ltd.<br>1,625 % fällig am 15.09.2027                                                                    | 2.000          | 1.927          | 1,18                     |       |
| 5,500 % fällig am 06.06.2030                                                                                    | 400            | 412            | 0,25                     |       |
| New Immo Holding S.A.<br>2,750 % fällig am 26.11.2026                                                           | € 100          | 116            | 0,07                     |       |
| NWD Finance BVI Ltd.<br>5,250 % fällig am<br>22.03.2026 (f)                                                     | \$ 300         | 86             | 0,05                     |       |
| OEC Finance Ltd. (4,375 % PIK)<br>4,375 % fällig am<br>25.10.2029 ^ (b)                                         | 784            | 8              | 0,00                     |       |
| OEC Finance Ltd. (5,250 % PIK)<br>5,250 % fällig am<br>27.12.2033 ^ (b)                                         | 473            | 6              | 0,00                     |       |
| OEC Finance Ltd. (7,125 % PIK)<br>7,125 % fällig am<br>26.12.2046 ^ (b)                                         | 1.739          | 6              | 0,00                     |       |
| OTP Bank Nyrt<br>8,750 % fällig am 15.05.2033                                                                   | 200            | 214            | 0,13                     |       |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC<br>0,000 % fällig am<br>05.04.2032 (d)                           | 200            | 142            | 0,09                     |       |
| Petrorio Luxembourg Holding SARL<br>6,125 % fällig am 09.06.2026                                                | 200            | 200            | 0,12                     |       |
| QNB Finance Ltd.<br>1,375 % fällig am 26.01.2026                                                                | 1.400          | 1.374          | 0,84                     |       |
| 4,875 % fällig am 30.01.2029                                                                                    | 800            | 812            | 0,50                     |       |
| Shinhan Bank Co. Ltd.<br>4,500 % fällig am<br>26.03.2028 (h)                                                    | 300            | 299            | 0,18                     |       |
| Shinhan Card Co. Ltd.<br>2,500 % fällig am 27.01.2027                                                           | 500            | 485            | 0,30                     |       |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd.<br>5,000 % fällig am 24.07.2028                                                | \$ 200         | \$ 203         | 0,12                     |       |
| Shriram Finance Ltd.<br>4,150 % fällig am 18.07.2025                                                            | 327            | 327            | 0,20                     |       |
| SNB Funding Ltd.<br>6,000 % fällig am 24.06.2035                                                                | 400            | 403            | 0,25                     |       |
| Sobha Sukuk Ltd.<br>7,996 % fällig am 19.02.2029                                                                | 400            | 409            | 0,25                     |       |
| SRC Sukuk Ltd.<br>5,000 % fällig am 27.02.2028                                                                  | 700            | 706            | 0,43                     |       |
| Standard Chartered PLC<br>7,767 % fällig am 16.11.2028                                                          | 700            | 749            | 0,46                     |       |
| SURA Asset Management S.A.<br>6,350 % fällig am 13.05.2032                                                      | 200            | 211            | 0,13                     |       |
| Trust Fibra Uno<br>4,869 % fällig am 15.01.2030                                                                 | 200            | 190            | 0,12                     |       |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050                                                                                    | 750            | 627            | 0,38                     |       |
| 7,700 % fällig am 23.01.2032                                                                                    | 500            | 522            | 0,32                     |       |
| Türkiye İş Bankası A/S<br>7,750 % fällig am 12.06.2029                                                          | 400            | 411            | 0,25                     |       |
| Unigel Netherlands Holding Corp. (15,000 % bar order<br>15,000 % PIK)<br>15,000 % fällig am<br>31.12.2044 ^ (b) | 592            | 20             | 0,02                     |       |
| VD DPR Finance Co.<br>6,833 % fällig am 15.03.2035                                                              | 600            | 588            | 0,36                     |       |
| WE Soda Investments Holding PLC<br>9,375 % fällig am 14.02.2031                                                 | 400            | 419            | 0,26                     |       |
| 9,500 % fällig am 06.10.2028                                                                                    | 600            | 627            | 0,38                     |       |
| Yango Justice International Ltd.<br>7,500 % fällig am<br>17.02.2025 ^                                           | 400            | 2              | 0,00                     |       |
| 7,875 % fällig am<br>04.09.2024 ^                                                                               | 200            | 1              | 0,00                     |       |
| Yapi ve Kredi Bankası A/S<br>7,125 % fällig am 10.10.2029                                                       | 300            | 300            | 0,18                     |       |
| 9,250 % fällig am 16.10.2028                                                                                    | 300            | 321            | 0,20                     |       |
|                                                                                                                 |                | 40.879         | 24,98                    |       |
| INDUSTRIEWERTE                                                                                                  |                |                |                          |       |
| Adani Electricity Mumbai Ltd.<br>3,949 % fällig am 12.02.2030                                                   | 349            | 313            | 0,19                     |       |
| Adani Transmission Step-One Ltd.<br>4,000 % fällig am 03.08.2026                                                | 400            | 396            | 0,24                     |       |
| Alfa Desarrollo SpA<br>4,550 % fällig am 27.09.2051                                                             | 1.087          | 800            | 0,49                     |       |
| Alfa S.A.B. de C.V.<br>6,875 % fällig am 25.03.2044                                                             | 400            | 429            | 0,26                     |       |
| Anadolu Efes Biracılık Ve Malt Sanayii A/S<br>3,375 % fällig am 29.06.2028                                      | 200            | 181            | 0,11                     |       |
| Anglo American Capital PLC<br>5,500 % fällig am 02.05.2033                                                      | 1.800          | 1.836          | 1,12                     |       |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC<br>3,375 % fällig am 01.11.2028                                                  | 200            | 191            | 0,12                     |       |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030                                                                                    | 900            | 840            | 0,51                     |       |
| Antofagasta PLC<br>2,375 % fällig am 14.10.2030                                                                 | 700            | 620            | 0,38                     |       |
| 6,250 % fällig am 02.05.2034                                                                                    | 400            | 420            | 0,26                     |       |
| Arcos Dorados BV<br>6,125 % fällig am 27.05.2029                                                                | 500            | 509            | 0,31                     |       |
| Avianca Midco PLC<br>9,000 % fällig am 01.12.2028                                                               | 900            | 854            | 0,52                     |       |
| Axiata SPV2 Bhd.<br>2,163 % fällig am 19.08.2030                                                                | 300            | 268            | 0,16                     |       |
| Bimbo Bakeries USA, Inc.<br>5,375 % fällig am 09.01.2036                                                        | 300            | 297            | 0,18                     |       |
| 6,050 % fällig am 15.01.2029                                                                                    | 400            | 418            | 0,26                     |       |
| Braskem Idesa SAPI<br>7,450 % fällig am 15.11.2029                                                              | 400            | 295            | 0,18                     |       |
| Braskem Netherlands Finance BV<br>4,500 % fällig am 10.01.2028                                                  | 400            | 345            | 0,21                     |       |
| CA Magnum Holdings<br>5,375 % fällig am 31.10.2026                                                              | 400            | 398            | 0,24                     |       |
| Caja de Compensacion de Asignacion Familiar de<br>Los Andes<br>7,000 % fällig am 30.07.2029                     | 400            | 419            | 0,26                     |       |
| Cencosud S.A.<br>5,950 % fällig am 28.05.2031                                                                   | 900            | 930            | 0,57                     |       |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| China Modern Dairy Holdings Ltd.<br>2,125 % fällig am 14.07.2026               | \$ 600         | \$ 583                   | 0,36                              | Kosmos Energy Ltd.<br>7,750 % fällig am 01.05.2027                          | \$ 500         | \$ 447                   | 0,27                              | Saudi Arabian Oil Co.<br>4,750 % fällig am 02.06.2030                         | \$ 800         | \$ 804                   | 0,49                              |
| Corp. GEO S.A.B. de C.V.<br>8,875 % fällig am 25.09.2014 ^                     | 850            | 0                        | 0,00                              | 8,750 % fällig am 01.10.2031                                                | 600            | 445                      | 0,27                              | 5,875 % fällig am 17.07.2064                                                  | 400            | 366                      | 0,22                              |
| CSN Resources S.A.<br>4,625 % fällig am 10.06.2031                             | 900            | 709                      | 0,43                              | Las Vegas Sands Corp.<br>3,900 % fällig am 08.08.2029                       | 800            | 762                      | 0,47                              | 6,375 % fällig am 02.06.2055                                                  | 1.200          | 1.201                    | 0,73                              |
| Czechoslovak Group A/S<br>5,250 % fällig am 10.01.2031 (a)                     | € 100          | 120                      | 0,07                              | 6,000 % fällig am 15.08.2029                                                | 1.100          | 1.131                    | 0,69                              | SK Hynix, Inc.<br>2,375 % fällig am 19.01.2031                                | 800            | 708                      | 0,43                              |
| Eastern European Electric Co. BV<br>6,500 % fällig am 15.05.2030               | 300            | 364                      | 0,22                              | Latam Airlines Group S.A.<br>7,625 % fällig am 07.01.2031 (a)               | 800            | 805                      | 0,49                              | 6,375 % fällig am 17.01.2028                                                  | 400            | 417                      | 0,25                              |
| Ecopetrol S.A.<br>4,625 % fällig am 02.11.2031                                 | \$ 500         | 423                      | 0,26                              | LD Celulose International GmbH<br>7,950 % fällig am 26.01.2032 (j)          | 600            | 632                      | 0,39                              | SK On Co. Ltd.<br>5,375 % fällig am 11.05.2026                                | 700            | 705                      | 0,43                              |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043                                                   | 700            | 584                      | 0,36                              | Leviathan Bond Ltd.<br>6,500 % fällig am 30.06.2027                         | 500            | 498                      | 0,30                              | Snam SpA<br>6,500 % fällig am 28.05.2055                                      | 300            | 312                      | 0,19                              |
| 7,750 % fällig am 01.02.2032                                                   | 700            | 688                      | 0,42                              | LG Energy Solution Ltd.<br>5,750 % fällig am 25.09.2028                     | 400            | 409                      | 0,25                              | Southern Copper Corp.<br>7,500 % fällig am 27.07.2035                         | 300            | 345                      | 0,21                              |
| 8,875 % fällig am 13.01.2033                                                   | 300            | 310                      | 0,19                              | 5,875 % fällig am 02.04.2035                                                | 800            | 798                      | 0,49                              | Stillwater Mining Co.<br>4,000 % fällig am 16.11.2026                         | 600            | 587                      | 0,36                              |
| Embraer Netherlands Finance BV<br>7,000 % fällig am 28.07.2030                 | 1.000          | 1.080                    | 0,66                              | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.<br>4,875 % fällig am 21.05.2030          | 400            | 405                      | 0,25                              | Suzano Austria GmbH<br>3,125 % fällig am 15.01.2032                           | 200            | 176                      | 0,11                              |
| Endeavour Mining PLC<br>7,000 % fällig am 28.05.2030                           | 850            | 855                      | 0,52                              | 4,875 % fällig am 25.07.2033                                                | 1.200          | 1.190                    | 0,73                              | Telecomunicaciones Digitales S.A.<br>4,500 % fällig am 30.01.2030             | 700            | 653                      | 0,40                              |
| Energean Israel Finance Ltd.<br>5,375 % fällig am 30.03.2028                   | 700            | 668                      | 0,41                              | 5,375 % fällig am 21.05.2035                                                | 400            | 407                      | 0,25                              | Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.<br>3,250 % fällig am 15.08.2030 | 1.600          | 1.425                    | 0,87                              |
| First Quantum Minerals Ltd.<br>8,000 % fällig am 01.03.2033                    | 500            | 513                      | 0,31                              | Medco Cypress Tree Pte Ltd.<br>8,625 % fällig am 19.05.2030                 | 400            | 410                      | 0,25                              | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>4,100 % fällig am 01.10.2046    | 500            | 360                      | 0,22                              |
| 8,625 % fällig am 01.06.2031                                                   | 900            | 935                      | 0,57                              | Melco Resorts Finance Ltd.<br>5,625 % fällig am 17.07.2027                  | 400            | 400                      | 0,24                              | Turkcell İletişim Hizmetleri A/S<br>7,450 % fällig am 24.01.2030              | 400            | 408                      | 0,25                              |
| 9,375 % fällig am 01.03.2029                                                   | 600            | 638                      | 0,39                              | Mersin Ulusal Arası Liman İşletmeciliği A/S<br>8,250 % fällig am 15.11.2028 | 200            | 208                      | 0,13                              | Turkish Airlines Pass-Through Trust<br>4,200 % fällig am 15.09.2028           | 352            | 341                      | 0,21                              |
| Ford Otomotiv Sanayi A/S<br>7,125 % fällig am 25.04.2029                       | 800            | 803                      | 0,49                              | Metalsa S.A. de C.V.<br>3,750 % fällig am 04.05.2031                        | 800            | 658                      | 0,40                              | Ulker Bisküvi Sanayi A/S<br>7,875 % fällig am 08.07.2031                      | 200            | 205                      | 0,13                              |
| Fortune Star BVI Ltd.<br>3,950 % fällig am 02.10.2026                          | € 200          | 228                      | 0,14                              | Metinvest BV<br>8,500 % fällig am 23.04.2026                                | 500            | 452                      | 0,28                              | Unigel Luxembourg S.A. (11,000 % bar oder 12,000 % PIK)<br>11,000 % fällig am |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 19.05.2028                                                   | \$ 300         | 302                      | 0,18                              | MHP Lux S.A.<br>6,950 % fällig am 03.04.2026                                | 300            | 280                      | 0,17                              | 31.12.2028 (b)                                                                | 209            | 59                       | 0,04                              |
| Freeport Indonesia PT<br>4,763 % fällig am 14.04.2027                          | 900            | 902                      | 0,55                              | Minera Mexico S.A. de C.V.<br>5,625 % fällig am 12.02.2032                  | 700            | 713                      | 0,44                              | 11,000 % fällig am                                                            |                |                          |                                   |
| 5,315 % fällig am 14.04.2032                                                   | 200            | 201                      | 0,12                              | Nakilat, Inc.<br>6,067 % fällig am 31.12.2033                               | 295            | 309                      | 0,19                              | 31.12.2028 ^ (b)                                                              | 477            | 133                      | 0,08                              |
| 6,200 % fällig am 14.04.2052                                                   | 600            | 589                      | 0,36                              | OAS Restructuring BVI Ltd.<br>5,000 % fällig am 31.03.2035 BRL              | 475            | 4                        | 0,00                              | Unigel Luxembourg S.A. (13,500 % bar oder 15,000 % PIK)<br>13,500 % fällig am |                |                          |                                   |
| Fresnillo PLC<br>4,250 % fällig am 02.10.2050                                  | 600            | 438                      | 0,27                              | OCP S.A.<br>5,125 % fällig am 23.06.2051                                    | \$ 500         | 380                      | 0,23                              | 31.12.2027 (b)                                                                | 60             | 48                       | 0,03                              |
| Gerdau Trade, Inc.<br>5,750 % fällig am 09.06.2035                             | 800            | 802                      | 0,49                              | 6,700 % fällig am 01.03.2036                                                | 500            | 503                      | 0,31                              | 13,500 % fällig am                                                            |                |                          |                                   |
| GLP China Holdings Ltd.<br>2,950 % fällig am 29.03.2026                        | 400            | 378                      | 0,23                              | 6,750 % fällig am 02.05.2034                                                | 200            | 208                      | 0,13                              | 31.12.2027 ^ (b)                                                              | 263            | 211                      | 0,13                              |
| Greensaif Pipelines Bidco SARL<br>5,853 % fällig am 23.02.2036                 | 300            | 304                      | 0,19                              | 6,875 % fällig am 25.04.2044                                                | 500            | 484                      | 0,30                              | Vale Overseas Ltd.<br>6,400 % fällig am 28.06.2054                            | 400            | 393                      | 0,24                              |
| 6,129 % fällig am 23.02.2038                                                   | 700            | 722                      | 0,44                              | Odebrecht Holdco Finance Ltd.<br>0,000 % fällig am 10.09.2058 (d)           | 3.424          | 7                        | 0,00                              | Vale S.A.<br>0,000 % (f)                                                      | BRL 6.700      | 421                      | 0,26                              |
| 6,510 % fällig am 23.02.2042                                                   | 200            | 207                      | 0,13                              | ORLEN S.A.<br>3,625 % fällig am 02.07.2032 (a)                              | € 400          | 466                      | 0,28                              | Vedanta Resources Finance PLC<br>9,475 % fällig am 24.07.2030                 | \$ 500         | 496                      | 0,30                              |
| Gruma S.A.B. de C.V.<br>5,761 % fällig am 09.12.2054                           | 200            | 189                      | 0,12                              | 6,000 % fällig am 30.01.2035                                                | \$ 200         | 206                      | 0,13                              | 11,250 % fällig am                                                            |                |                          |                                   |
| Grupo Nutresa S.A.<br>8,000 % fällig am 12.05.2030                             | 400            | 420                      | 0,26                              | Pertamina Hulu Energi PT<br>5,250 % fällig am 21.05.2030                    | 800            | 809                      | 0,49                              | 03.12.2031                                                                    | 400            | 420                      | 0,26                              |
| 9,000 % fällig am 12.05.2035                                                   | 400            | 433                      | 0,26                              | Petron Corp.<br>5,950 % fällig am 19.04.2026 (f)                            | 300            | 298                      | 0,18                              | Windfall Mining Group, Inc.<br>5,854 % fällig am 13.05.2032                   | 1.200          | 1.227                    | 0,75                              |
| Grupo Televisa S.A.B.<br>5,250 % fällig am 24.05.2049                          | 300            | 218                      | 0,13                              | POSCO<br>4,875 % fällig am 23.01.2027                                       | 400            | 402                      | 0,25                              | Wynn Macau Ltd.<br>5,500 % fällig am 15.01.2026                               | 500            | 501                      | 0,31                              |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp.<br>5,000 % fällig am 27.07.2028         | 200            | 204                      | 0,12                              | Prosus NV<br>3,061 % fällig am 13.07.2031                                   | 700            | 620                      | 0,38                              | Yinson Boronia Production BV<br>8,498 % fällig am                             |                |                          |                                   |
| Health & Happiness International Holdings Ltd.<br>9,125 % fällig am 24.07.2028 | 700            | 715                      | 0,44                              | 3,257 % fällig am 19.01.2027                                                | 200            | 196                      | 0,12                              | 31.01.2045 (a)                                                                | 400            | 405                      | 0,25                              |
| Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru<br>7,750 % fällig am 05.11.2038     | 400            | 423                      | 0,26                              | 4,987 % fällig am 19.01.2052                                                | 500            | 386                      | 0,24                              | Yinson Boronia Production BV<br>8,947 % fällig am 31.07.2042                  | 198            | 211                      | 0,13                              |
| ICL Group Ltd.<br>6,375 % fällig am 31.05.2038                                 | 700            | 708                      | 0,43                              | QatarEnergy LNG<br>6,332 % fällig am 30.09.2027                             | 304            | 309                      | 0,19                              | YPF S.A.<br>9,500 % fällig am 17.01.2031                                      | 900            | 949                      | 0,58                              |
| InRetail Consumer<br>3,250 % fällig am 22.03.2028                              | 1.100          | 1.044                    | 0,64                              | Reliance Industries Ltd.<br>2,875 % fällig am 12.01.2032                    | 900            | 800                      | 0,49                              | Yunda Holding Investment Ltd.<br>2,250 % fällig am 19.08.2025                 | 500            | 498                      | 0,30                              |
| Invepar Holdings LLC<br>1,000 % fällig am 31.12.2049 (i)                       | 210            | 0                        | 0,00                              | ReNew Pvt Ltd.<br>5,875 % fällig am 05.03.2027                              | 700            | 695                      | 0,42                              |                                                                               |                | 70.872                   | 43,32                             |
| Ivanhoe Mines Ltd.<br>7,875 % fällig am 23.01.2030                             | 500            | 499                      | 0,31                              | Sable International Finance Ltd.<br>7,125 % fällig am 15.10.2032            | 800            | 803                      | 0,49                              | VERSORGUNGSUNTERNEHMEN                                                        |                |                          |                                   |
| JetBlue Airways Corp.<br>9,875 % fällig am 20.09.2031                          | 300            | 292                      | 0,18                              | Samarco Mineracao S.A. (9,000 % PIK)<br>9,500 % fällig am 30.06.2031 (b)    | 409            | 402                      | 0,25                              | AES Andes S.A.<br>6,300 % fällig am 15.03.2029                                | 300            | 309                      | 0,19                              |
| Kallpa Generacion S.A.<br>5,875 % fällig am 30.01.2032                         | 500            | 513                      | 0,31                              | San Miguel Global Power Holdings Corp.<br>5,450 % fällig am 09.12.2026 (f)  | 400            | 390                      | 0,24                              | Chile Electricity Lux MPC SARL<br>5,672 % fällig am 20.10.2035                | 1.600          | 1.613                    | 0,99                              |
| Kaspi.KZ JSC<br>6,250 % fällig am 26.03.2030 (i)                               | 800            | 806                      | 0,49                              | 8,125 % fällig am 02.12.2029 (f)                                            | 200            | 198                      | 0,12                              | Empresa Electrica Cochran SpA<br>5,500 % fällig am 14.05.2027                 | 93             | 92                       | 0,06                              |
| KazMunayGas National Co. JSC<br>5,750 % fällig am 19.04.2047                   | 200            | 174                      | 0,11                              | 8,750 % fällig am 12.06.2029 (f)                                            | 500            | 503                      | 0,31                              | Engie Energia Chile S.A.<br>6,375 % fällig am 17.04.2034                      | 300            | 312                      | 0,19                              |
| 6,375 % fällig am 24.10.2048                                                   | 1.500          | 1.389                    | 0,85                              | Sands China Ltd.<br>4,375 % fällig am 18.06.2030                            | 800            | 765                      | 0,47                              | EP Infrastructure A/S<br>1,816 % fällig am 02.03.2031                         | € 500          | 526                      | 0,32                              |
|                                                                                |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 08.08.2028                                                | 700            | 706                      | 0,43                              | EPH Financing International A/S<br>4,625 % fällig am 02.07.2032 (a)           | 300            | 355                      | 0,22                              |
|                                                                                |                |                          |                                   | Sasol Financing USA LLC<br>6,500 % fällig am 27.09.2028                     | 900            | 856                      | 0,52                              | 5,875 % fällig am 30.11.2029                                                  | 200            | 251                      | 0,15                              |
|                                                                                |                |                          |                                   |                                                                             |                |                          |                                   | 6,651 % fällig am 13.11.2028                                                  | 300            | 382                      | 0,23                              |
|                                                                                |                |                          |                                   |                                                                             |                |                          |                                   | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % fällig am 27.09.2028          | \$ 800         | 807                      | 0,49                              |
|                                                                                |                |                          |                                   |                                                                             |                |                          |                                   | IHS Holding Ltd.<br>8,250 % fällig am 29.11.2031                              | 1.500          | 1.518                    | 0,93                              |



| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Israel Electric Corp. Ltd.<br>4,250 % fällig am 14.08.2028                    | \$ 300         | \$ 292                   | 0,18                              |
| Korea Southern Power Co. Ltd.<br>5,375 % fällig am 21.09.2026                 | 400            | 405                      | 0,25                              |
| Millicom International Cellular S.A.<br>4,500 % fällig am 27.04.2031          | 1.000          | 914                      | 0,56                              |
| Niagara Energy SAC<br>5,746 % fällig am 03.10.2034                            | 500            | 495                      | 0,30                              |
| Pampa Energia S.A.<br>7,875 % fällig am 16.12.2034                            | 400            | 400                      | 0,24                              |
| Peru LNG SRL<br>5,375 % fällig am 22.03.2030                                  | 417            | 392                      | 0,24                              |
| Raizen Fuels Finance S.A.<br>5,700 % fällig am 17.01.2035                     | 200            | 187                      | 0,11                              |
| 6,250 % fällig am<br>08.07.2032 (a)                                           | 800            | 795                      | 0,49                              |
| 6,950 % fällig am 05.03.2054                                                  | 200            | 186                      | 0,11                              |
| Rio Oil Finance Trust<br>8,200 % fällig am 06.04.2028                         | 612            | 638                      | 0,39                              |
| 9,500 % fällig am 06.01.2027                                                  | 250            | 259                      | 0,16                              |
| Saavi Energia SARL<br>8,875 % fällig am 10.02.2035                            | 500            | 522                      | 0,32                              |
| SAEL Ltd.<br>7,800 % fällig am 31.07.2031                                     | 194            | 189                      | 0,12                              |
| SK Battery America, Inc.<br>4,875 % fällig am 23.01.2027                      | 200            | 201                      | 0,12                              |
| Southern Gas Corridor CJSC<br>6,875 % fällig am 24.03.2026                    | 1.500          | 1.522                    | 0,93                              |
| Telecom Argentina S.A.<br>9,250 % fällig am 28.05.2033                        | 400            | 408                      | 0,25                              |
| Telefonica Moviles Chile S.A.<br>3,537 % fällig am 18.11.2031                 | 700            | 435                      | 0,27                              |
| Trinidad Generation Unlimited<br>7,750 % fällig am 16.06.2033                 | 300            | 311                      | 0,19                              |
| Yinson Production Financial Services Pte Ltd.<br>9,625 % fällig am 03.05.2029 | 400            | 416                      | 0,25                              |
|                                                                               |                | 15.132                   | 9,25                              |
| Summe Unternehmensanleihen und<br>Wechsel                                     |                | 126.883                  | 77,55                             |

**WANDELANLEIHEN & WECHSEL**

|                                                                                       |     |       |      |
|---------------------------------------------------------------------------------------|-----|-------|------|
| Goldman Sachs Finance Corp. International Ltd.<br>0,000 % fällig am<br>04.04.2028 (d) | 400 | 423   | 0,26 |
| Sasol Financing USA LLC<br>4,500 % fällig am 08.11.2027                               | 800 | 737   | 0,45 |
| Wynn Macau Ltd.<br>4,500 % fällig am 07.03.2029                                       | 700 | 698   | 0,43 |
|                                                                                       |     | 1.858 | 1,14 |

**US-REGIERUNGSBEHÖRDEN**

|                                                                       |       |       |      |
|-----------------------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>4,000 % fällig am 01.08.2055 | 450   | 419   | 0,25 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055                                          | 450   | 430   | 0,26 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055                                          |       |       |      |
| - 01.08.2055                                                          | 2.050 | 2.009 | 1,23 |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055                                          | 550   | 550   | 0,34 |
|                                                                       |       | 3.408 | 2,08 |

**US-SCHATZ Obligationen**

|                                                     |       |       |      |
|-----------------------------------------------------|-------|-------|------|
| U.S. Treasury Bonds<br>3,000 % fällig am 15.05.2045 | 6.100 | 4.674 | 2,86 |
|-----------------------------------------------------|-------|-------|------|

**NON-AGENCY-MBS**

|                                                                                      |        |     |      |
|--------------------------------------------------------------------------------------|--------|-----|------|
| Canada Square Funding PLC<br>5,161 % fällig am 17.01.2059                            | £ 71   | 98  | 0,06 |
| Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates<br>4,664 % fällig am 25.10.2035 | \$ 313 | 302 | 0,18 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>5,054 % fällig am 25.08.2036                  | 207    | 188 | 0,11 |
| Countrywide Alternative Loan Trust<br>5,072 % fällig am 20.12.2035                   | 40     | 37  | 0,02 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust<br>4,607 % fällig am 25.11.2037    | 26     | 25  | 0,02 |
| Rochester Financing PLC<br>4,939 % fällig am 18.12.2044                              | £ 78   | 107 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Tower Bridge Funding PLC<br>4,959 % fällig am 20.12.2063 | £ 32           | \$ 44                    | 0,03                              |
|                                                          |                | 801                      | 0,49                              |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE  
HYPOTHEKEN SONSTIGE**

|                                                                                   |       |     |      |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------|-----|------|
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.<br>4,874 % fällig am 25.09.2037 | \$ 25 | 27  | 0,02 |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust<br>4,624 % fällig am 25.04.2037      | 122   | 82  | 0,05 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust<br>4,634 % fällig am 25.09.2037                   | 73    | 72  | 0,04 |
|                                                                                   |       | 181 | 0,11 |

**SICHERHEITEN FÜR WHOLE LOANS**

|                                                                     |     |     |      |
|---------------------------------------------------------------------|-----|-----|------|
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>7,250 % fällig am 25.05.2036 | 311 | 155 | 0,09 |
|                                                                     |     | 336 | 0,20 |

**STAATSEMISSIONEN**

|                                                                                  |               |        |      |
|----------------------------------------------------------------------------------|---------------|--------|------|
| Argentina Government International Bond<br>0,750 % fällig am 09.07.2030          | 16            | 11     | 0,01 |
| Bank Gospodarstwa Krajowego<br>6,250 % fällig am 31.10.2028                      | 200           | 211    | 0,13 |
| Bulgaria Government International Bond<br>3,500 % fällig am 07.05.2034           | € 300         | 356    | 0,22 |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038                                                     | 300           | 359    | 0,22 |
| Colombia Government International Bond<br>8,500 % fällig am 25.04.2035           | \$ 500        | 520    | 0,32 |
| Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik<br>13,000 % fällig am 05.12.2025   | DOP 15.900    | 265    | 0,16 |
| Dominican Republic Government International Bond<br>5,300 % fällig am 21.01.2041 | \$ 200        | 173    | 0,11 |
| 7,050 % fällig am 03.02.2031                                                     | 200           | 210    | 0,13 |
| 10,750 % fällig am 01.06.2036                                                    | DOP 8.000     | 138    | 0,08 |
| 11,250 % fällig am 15.09.2035                                                    | 11.000        | 196    | 0,12 |
| Ecuador Government International Bond<br>6,900 % fällig am 31.07.2030            | \$ 480        | 418    | 0,26 |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028             | EGP 72.700    | 1.447  | 0,88 |
| Israel Government International Bond<br>1,750 % fällig am 31.08.2025             | ILS 4.300     | 1.272  | 0,78 |
| 5,000 % fällig am 30.10.2026                                                     | € 400         | 483    | 0,29 |
| Korea Expressway Corp.<br>5,000 % fällig am 14.05.2027                           | \$ 200        | 203    | 0,12 |
| Magyar Export-Import Bank<br>6,000 % fällig am 16.05.2029                        | € 100         | 127    | 0,08 |
| Malaysia Government Investment Issue<br>3,465 % fällig am 15.10.2030             | MYR 220       | 53     | 0,03 |
| 4,245 % fällig am 30.09.2030                                                     | 210           | 52     | 0,03 |
| Mexico Government International Bond<br>5,750 % fällig am 12.10.2110             | \$ 500        | 396    | 0,24 |
| 6,875 % fällig am 13.05.2037                                                     | 200           | 209    | 0,13 |
| MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt<br>6,500 % fällig am 29.06.2028                  | 200           | 207    | 0,13 |
| National Bank of Uzbekistan<br>19,875 % fällig am 05.07.2027                     | UZS 2.500.000 | 202    | 0,12 |
| Pakistan Government International Bond<br>6,000 % fällig am 08.04.2026           | \$ 200        | 197    | 0,12 |
| Peru Government International Bond<br>5,500 % fällig am 30.03.2036               | 500           | 501    | 0,31 |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033                                                     | PEN 800       | 246    | 0,15 |
| Poland Government International Bond<br>3,625 % fällig am 11.01.2034             | € 40          | 48     | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 11.01.2044                                                     | 40            | 46     | 0,03 |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028       | \$ 200        | 203    | 0,12 |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031                                                     | 200           | 208    | 0,13 |
| South Africa Government International Bond<br>8,875 % fällig am 28.02.2035       | ZAR 23.000    | 1.208  | 0,74 |
| Ukraine Government International Bond<br>0,000 % fällig am 01.02.2030            | \$ 72         | 35     | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 01.02.2034                                                     | 268           | 104    | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 01.02.2035                                                     | 377           | 193    | 0,12 |
|                                                                                  |               | 10.497 | 6,42 |

| BESCHREIBUNG                              | AKTIEN  | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|---------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAMMAKTIEEN</b>                       |         |                          |                                   |
| Hipotecaria Su Casita S.A.<br>de C.V. (c) | 332.624 | 0                        | 0,00                              |
| Stichting Administratiekan<br>Holding (c) | 2.752   | 0                        | 0,00                              |
|                                           |         | 0                        | 0,00                              |

**OPTIONSSCHEINE**

|                                   |         |   |      |
|-----------------------------------|---------|---|------|
| OAS S.A. - Exp.<br>16.05.2039 (i) | 175.616 | 0 | 0,00 |
|-----------------------------------|---------|---|------|

**KURZFRISTIGE INSTRUMENTE**

| KURZFRISTIGE SCHULDTITEL                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Standard Chartered Bank<br>22,238 % fällig am<br>01.12.2025 (d)(e) | PKR 63.300     | 196                      | 0,12                              |
| 22,242 % fällig am<br>03.11.2025 (d)(e)                            | 55.500         | 173                      | 0,10                              |
|                                                                    |                | 369                      | 0,22                              |

**EGYPT TREASURY BILLS**

|                                         |            |     |      |
|-----------------------------------------|------------|-----|------|
| 27,349 % fällig am<br>15.07.2025 (d)(e) | EGP 26.175 | 522 | 0,32 |
|-----------------------------------------|------------|-----|------|

**NIGERIA TREASURY BILLS**

|                                         |             |       |      |
|-----------------------------------------|-------------|-------|------|
| 22,542 % fällig am<br>25.11.2025 (d)(e) | NGN 440.585 | 260   | 0,16 |
| 23,031 % fällig am<br>09.12.2025 (d)(e) | 316.207     | 185   | 0,11 |
| 26,488 % fällig am<br>19.08.2025 (d)(e) | 84.938      | 54    | 0,03 |
| 26,510 % fällig am<br>11.11.2025 (d)(e) | 157.396     | 93    | 0,06 |
| 26,683 % fällig am<br>19.08.2025 (d)(e) | 82.209      | 52    | 0,03 |
| 30,612 % fällig am<br>29.06.2026 (d)(e) | 341.659     | 179   | 0,11 |
| 30,864 % fällig am<br>26.06.2026 (d)(e) | 139.736     | 74    | 0,05 |
| 31,337 % fällig am<br>07.10.2025 (d)(e) | 9.200       | 6     | 0,01 |
| 31,577 % fällig am<br>07.10.2025 (d)(e) | 697.600     | 425   | 0,26 |
| 33,126 % fällig am<br>12.06.2026 (d)(e) | 534.562     | 283   | 0,17 |
| 33,156 % fällig am<br>11.06.2026 (d)(e) | 535.050     | 284   | 0,17 |
|                                         |             | 1.895 | 1,16 |

Summe kurzfristige Instrumente

2.786 1,70

Summe Übertragbare Wertpapiere \$ 156.182 95,46

**AKTIEN**

| INVESTMENTFONDS                                                                    | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                           |                          |                                   |
| PIMCO Select Funds plc -<br>PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating<br>NAV Fund (g) | 990.166                  | 9,874 6,03                        |
| PIMCO Specialty Funds<br>Ireland p.l.c. - PIMCO<br>China Bond Fund (g)             | 25.272                   | 370 0,23                          |
|                                                                                    |                          | 10.244 6,26                       |

**BÖRSENGEHADELTE FONDS**

|                                                                     |           |      |      |
|---------------------------------------------------------------------|-----------|------|------|
| PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>US Dollar Short<br>Maturity UCITS ETF (g) | 1.000     | 100  | 0,06 |
| Summe Investmentfonds                                               | \$ 10.344 | 6,32 |      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025          | 80                      | \$ 66                                           | 0,04                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025          | 198                     | 235                                             | 0,14                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025          | 71                      | 136                                             | 0,08                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025          | 7                       | (20)                                            | (0,01)                  |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025          | 25                      | (117)                                           | (0,07)                  |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025          | 6                       | 13                                              | 0,01                    |
|                                                                |       |                  |                         | <b>\$ 313</b>                                   | <b>0,19</b>             |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | <b>\$ 313</b>                                   | <b>0,19</b>             |

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

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

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

| Index/Tranchen         | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.EM-43 5-Year Index | (1,000) %                      | 20.06.2030            | \$ 1.300                       | \$ (26)                                         | (0,02)                  |

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

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.EM-41 5-Year Index             | 1,000 %                        | 20.06.2029            | \$ 1.600                       | \$ 33                                           | 0,02                    |
| CDX.EM-42 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2029            | 2.000                          | 27                                              | 0,02                    |
| CDX.HY-44 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2030            | 300                            | 4                                               | 0,00                    |
| CDX.IG-43 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2029            | 1.600                          | 6                                               | 0,00                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2030            | 5.400                          | 23                                              | 0,01                    |
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index   | 5,000                          | 20.06.2030            | € 460                          | 10                                              | 0,01                    |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030            | 2.900                          | 10                                              | 0,01                    |
|                                    |                                |                       |                                | <b>\$ 113</b>                                   | <b>0,07</b>             |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 700           | \$ 10                                           | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,750              | 21.06.2047            | \$ 1.700        | 320                                             | 0,20                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2029            | 8.600           | (113)                                           | (0,07)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2030            | 1.100           | (17)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2034            | 2.900           | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2035            | 700             | (9)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2055            | 700             | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 18.12.2054            | 300             | 40                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2029            | 5.900           | (90)                                            | (0,05)                  |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2034            | 1.300           | (28)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                 | 12,131             | 04.01.2027            | BRL 6.500       | (78)                                            | (0,05)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500              | 17.09.2030            | CNY 2.680       | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR             | 4,611              | 06.06.2028            | CZK 12.800      | 13                                              | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2030            | € 2.100         | (21)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2035            | 1.350           | 21                                              | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2055            | 100             | (8)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR                | 5,890              | 09.05.2030            | HUF 462.500     | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE                | 8,207              | 08.12.2025            | MXN 6.900       | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 28-Day MXN-TIIE                | 8,207              | 19.06.2028            | 6.900           | 4                                               | 0,00                    |
|                                                |                                |                    |                       |                 | \$ 42                                           | 0,03                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                |                    |                       |                 | \$ 129                                          | 0,08                    |

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------------------|--------|------------|----------------------|
| DUB        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                | 0,700 %        | 20.08.2025     | 44.000                     | \$ 51  | \$ 14      | 0,01                 |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|----------------------|
| DUB        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,950 %        | 20.08.2025     | 44.000                     | \$ (18) | \$ (7)     | 0,00                 |

#### DEVIENSOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|----------------------|
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY            | 11.08.2025     | 288                        | \$ (9)  | \$ 0       | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY |                | 11.08.2025     | 288                        | (6)     | (1)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600         | 12.11.2025     | 310                        | (12)    | (2)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900         | 12.11.2025     | 310                        | (9)     | (6)        | (0,01)               |
|            |                           |                |                |                            | \$ (36) | \$ (9)     | (0,01)               |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| MYC        | South Korea Government International Bond | (1,000) %                   | 20.12.2034        | \$ 600                     | \$ (29)                               | \$ (2)                                   | \$ (31)    | (0,02)               |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| BOA        | Indonesia Government International Bond   | 1,000 %                     | 20.06.2030        | \$ 100                     | \$ 0                                  | \$ 1                                     | \$ 1       | 0,00                 |
| BPS        | Mexico Government International Bond      | 1,000                       | 20.12.2025        | 350                        | 1                                     | 0                                        | 1          | 0,00                 |
|            | Mexico Government International Bond      | 1,000                       | 20.12.2027        | 300                        | 1                                     | 2                                        | 3          | 0,00                 |
|            | Romania Government International Bond     | 1,000                       | 20.12.2025        | 1.050                      | 1                                     | 1                                        | 2          | 0,00                 |
| BRC        | America Movil S.A.B. de C.V.              | 1,000                       | 20.12.2025        | 1.200                      | (30)                                  | 35                                       | 5          | 0,01                 |
|            | Indonesia Government International Bond   | 1,000                       | 20.06.2030        | 200                        | 1                                     | 1                                        | 2          | 0,00                 |
| DBL        | Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. | 1,000                       | 20.06.2028        | 800                        | (2)                                   | (1)                                      | (3)        | 0,00                 |
| DUB        | Indonesia Government International Bond   | 1,000                       | 20.06.2030        | 400                        | 1                                     | 3                                        | 4          | 0,00                 |
| GST        | Indonesia Government International Bond   | 1,000                       | 20.06.2030        | 100                        | 0                                     | 1                                        | 1          | 0,00                 |
|            | Israel Government International Bond      | 1,000                       | 20.12.2025        | 700                        | 1                                     | 1                                        | 2          | 0,00                 |
|            | Israel Government International Bond      | 1,000                       | 20.06.2026        | 100                        | 0                                     | 1                                        | 1          | 0,00                 |
| JPM        | Petroleos Mexicanos                       | 4,850                       | 07.05.2026        | 768                        | 0                                     | 9                                        | 9          | 0,01                 |
|            | Alibaba Group Holding Ltd.                | 1,000                       | 20.06.2029        | 1.500                      | 8                                     | 8                                        | 16         | 0,01                 |
|            |                                           |                             |                   |                            | \$ (18)                               | \$ 62                                    | \$ 44      | 0,03                 |

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

### CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                        | Zahlung                                                                                              | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag<br>erhaltener<br>Währung | Nennbetrag<br>gelieferter<br>Währung | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030            | \$ 234                              | PHP 13.460                           | \$ (1)                                   | \$ (2)                                          | \$ (3)         | 0,00                         |
| JPM        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030            | 16                                  | 890                                  | 0                                        | 0                                               | 0              | 0,00                         |
|            |                                                                                                                               |                                                                                                      |                       |                                     |                                      | \$ (1)                                   | \$ (2)                                          | \$ (3)         | 0,00                         |

### DEWISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CNH                    | 1.283                    | \$ 178                           | \$ 0                               | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 86                       | 98                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 44                       | AUD 67                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 45                       | NZD 74                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | AUD                    | 67                       | \$ 44                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 2.864                    | 399                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NZD                    | 74                       | 45                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025               | DOP                    | 3.764                    | 63                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 6.700                    | 7.618                            | 0                                  | (248)                                                | (0,15)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 3.005.566                | 184                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MYR                    | 412                      | 97                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 844                      | 232                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 135                      | CHF 109                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 116                      | IDR 1.893.456                    | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 59                       | KRW 80.233                       | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | SGD 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 6                        | \$ 5                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 21                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 182                      | CNH 1.304                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | THB                    | 154                      | \$ 5                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 3.160                    | 97                               | 0                                  | (11)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 6                        | IDR 102.681                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 30                       | THB 993                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 1.400                    | \$ 196                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CZK                    | 184                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 914                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 2.627                    | 81                               | 0                                  | (11)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 182                      | CNH 1.297                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | ILS                    | 3.180                    | \$ 869                           | 0                                  | (77)                                                 | (0,05)                  |
| BRC        | 07.2025               |                        | 530                      | 152                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 633                      | 170                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 305                      | £ 224                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 75                       | ILS 255                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | ¥ 693                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 11                       | PLN 42                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 796                      | TRY 34.455                       | 61                                 | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 18.273                   | \$ 1.011                         | 0                                  | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | CZK                    | 1.812                    | 81                               | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | £                      | 224                      | 305                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 189                      | TRY 7.843                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BSH        | 07.2025               |                        | 236                      | PEN 844                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 1.214                    | \$ 337                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | EGP                    | 22.996                   | 417                              | 0                                  | (42)                                                 | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | €                      | 87                       | 101                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 64.228                   | 47                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 530                      | 146                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 5.655                    | 174                              | 0                                  | (21)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.242                    | CNY 8.906                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 24                       | IDR 392.994                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 26                       | KRW 35.902                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 12                       | THB 401                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 377                      | TWD 11.191                       | 9                                  | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 408                      | \$ 57                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | COP                    | 467.052                  | 112                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 5.282                    | 61                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 6.339                    | 195                              | 0                                  | (26)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 11                       | INR 983                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | ILS                    | 1.094                    | \$ 292                           | 0                                  | (33)                                                 | (0,02)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 183                      | KZT 94.538                       | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | ILS                    | 257                      | \$ 74                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 7.772                    | € 6.699                          | 93                                 | 0                                                    | 0,06                    |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| FAR        | 08.2025               | €                      | 6.684                    | \$ 7.772                         | \$ 0                               | \$ (93)                                              | (0,06)                  |
|            | 08.2025               | INR                    | 3.148                    | 36                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 14                       | EGP 746                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 137                      | KZT 70.498                       | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 1                        | MXN 16                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 5.119                    | \$ 90                            | 0                                  | (9)                                                  | (0,01)                  |
|            | 11.2025               | PKR                    | 20.331                   | 69                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 12.2025               | \$                     | 55                       | KZT 29.061                       | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | AUD                    | 67                       | \$ 43                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 965                      | 169                              | 0                                  | (8)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | CHF                    | 112                      | 136                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 653                      | 91                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 60                       | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 175                      | BRL 968                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 171                      | ¥ 24.470                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| GLM        | 08.2025               | CNH                    | 1.477                    | \$ 206                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.508                    | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | BRL                    | 983                      | 175                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 13.590                   | 698                              | 0                                  | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 11.2025               | PEN                    | 1.304                    | 355                              | 0                                  | (11)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | DOP                    | 8.057                    | 136                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 708                      | 22                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 6                        | IDR 93.224                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 35                       | MYR 150                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    | 119                      | \$ 2                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 6.346                    | 18                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | DOP                    | 10.489                   | 166                              | 1                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 517                      | DOP 33.360                       | 33                                 | 33                                                   | 0,02                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 8.225                    | \$ 145                           | 0                                  | (14)                                                 | (0,01)                  |
|            | 11.2025               | DOP                    | 1.748                    | 29                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | CNH                    | 1.237                    | 171                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 74                       | 44                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PHP                    | 501                      | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 109                      | 29                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 43                       | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 3.199                    | 98                               | 0                                  | (12)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 119                      | PLN 447                          | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 52                       | TWD 1.552                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 4.350                    | \$ 243                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 2.668                    | 372                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.019                    | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 3.958                    | 121                              | 0                                  | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 181                      | CNH 1.295                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 3.625                    | \$ 63                            | 0                                  | (7)                                                  | (0,01)                  |
|            | 11.2025               | PKR                    | 39.664                   | 134                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2026               | EGP                    | 6.477                    | 105                              | 0                                  | (7)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | CAD                    | 109                      | 79                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 593                      | 82                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 77                       | 105                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | HKD                    | 663                      | 85                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PHP                    | 462                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 104                      | 81                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 1.525                    | 47                               | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 79                       | CAD 109                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 201                      | € 174                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 136                      | ILS 481                          | 7                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | ¥ 787                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 85                       | PLN 320                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 84                       | SGD 108                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 18                       | THB 600                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 08.2025               | CAD                    | 109                      | \$ 79                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 595                      | 82                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 108                      | 84                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 1.456                    | 44                               | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 16                       | EGP 904                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 3.622                    | \$ 63                            | 0                                  | (7)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | PLN                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 19                       | € 17                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | ¥ 553                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 1.506                    | \$ 210                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 3.926                    | 69                               | 0                                  | (6)                                                  | (0,01)                  |
|            | 10.2026               | \$                     | 210                      | AZN 376                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2027               |                        | 420                      | 773                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 26.500                   | \$ 184                           | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 14.900                   | 41                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| SCX        | 08.2025               | \$                     | 84                       | CNH 605                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNY                    | 8.927                    | \$ 1.246                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ILS                    | 4                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 27                       | IDR 433.531                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 17                       | SGD 22                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 439                      | TWD 12.984                       | 8                                  | 8                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 2.594                    | \$ 363                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.056                    | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 22                       | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 871                      | 27                               | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |



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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,28 %):

| Emittentenbeschreibung                            | Kauf-<br>datum | Kosten        | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------------|----------------|---------------|----------------|-------------------------|
| Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049 | 16.11.2018     | \$ 0          | \$ 0           | 0,00                    |
| Kaspi.KZ JSC 6,250 % fällig am 26/03/2030         | 18.03.2025     | 800           | 806            | 0,49                    |
| OAS S.A. - Exp. 16.05.2039                        | 16.11.2018     | 5             | 0              | 0,00                    |
|                                                   |                | <b>\$ 805</b> | <b>\$ 806</b>  | <b>0,49</b>             |

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 1.612 USD (31. Dezember 2024: 5.505 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.458 USD (31. Dezember 2024: 1.645 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 1.920 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 151.870                                                      | \$ 4.312                                                     | \$ 156.182        |
| Investmentfonds                     | 10.344                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 10.344            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 13                                                                          | 4.467                                                           | 0                                                            | 4.480             |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 0                                                               | 313                                                          | 313               |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 10.357</b>                                                            | <b>\$ 156.337</b>                                               | <b>\$ 4.625</b>                                              | <b>\$ 171.319</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 137.759                                                      | \$ 3.887                                                     | \$ 141.646        |
| Investmentfonds               | 9.561                                                                       | 100                                                             | 0                                                            | 9.661             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (17)                                                                        | (2.406)                                                         | 0                                                            | (2.423)           |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 9.544</b>                                                             | <b>\$ 135.453</b>                                               | <b>\$ 3.887</b>                                              | <b>\$ 148.884</b> |

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC                                       | 4,050 %         | 28.02.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (463)          | \$ (469)                                                        | (0,29)                  |
| MEI                                       | 3,000           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (582)             | (582)                                                           | (0,35)                  |
|                                           | 3,750           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (486)             | (486)                                                           | (0,30)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                   | <b>\$ (1.537)</b>                                               | <b>(0,94)</b>           |

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



## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.379                            | \$ (1.190)                            | \$ 189                              | \$ 16                               | \$ 0                                  | \$ 16                               |
| BOA        | 1.193                               | (1.140)                               | 53                                  | (28)                                | 0                                     | (28)                                |
| BPS        | (89)                                | 0                                     | (89)                                | 55                                  | 0                                     | 55                                  |
| BRC        | 1.539                               | (1.420)                               | 119                                 | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 |
| BSH        | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 | 1                                   | 0                                     | 1                                   |
| CBK        | (124)                               | 0                                     | (124)                               | (4)                                 | 0                                     | (4)                                 |
| DBL        | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| DUB        | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 | (862)                               | 750                                   | (112)                               |
| FAR        | 45                                  | 0                                     | 45                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| GLM        | 9                                   | 0                                     | 9                                   | 7                                   | 0                                     | 7                                   |
| GST        | 13                                  | 0                                     | 13                                  | 4                                   | 0                                     | 4                                   |
| JPM        | (29)                                | 0                                     | (29)                                | 27                                  | 0                                     | 27                                  |
| MBG        | 68                                  | 0                                     | 68                                  | (643)                               | 450                                   | (193)                               |
| MYC        | (31)                                | 0                                     | (31)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MYI        | (8)                                 | 0                                     | (8)                                 | 0                                   | 50                                    | 50                                  |
| RBC        | 72                                  | 0                                     | 72                                  | 13                                  | 0                                     | 13                                  |
| SCX        | 19                                  | 0                                     | 19                                  | (808)                               | 670                                   | (138)                               |
| SSB        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | 4                                   | 0                                     | 4                                   |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (93)                                | 0                                     | (93)                                |
| UAG        | (4)                                 | 0                                     | (4)                                 | (32)                                | 0                                     | (32)                                |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 61,26             | 77,96             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 24,74             | 8,97              |
| Investmentfonds                                                        | 5,70              | 5,92              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,25              | 0,08              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,29              | 0,30              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 3,08              | 0,19              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,17              | k. A.             |
| Sonstige Aktiva                                                        | 4,51              | 6,58              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 3,02              | 2,83              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 77,55             | 79,42             |
| Wandelanleihen & Wechsel                                                               | 1,14              | 0,50              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 2,08              | 2,30              |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 2,86              | 3,16              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 0,49              | 0,56              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 0,20              | 0,54              |
| Staatsemissionen                                                                       | 6,42              | 4,26              |
| Stammaktien                                                                            | 0,00              | 0,00              |
| Optionsscheine                                                                         | 0,00              | 0,00              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 1,70              | 3,43              |
| Investmentfonds                                                                        | 6,32              | 6,62              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,19              | 0,01              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | (0,02)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,07              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,03              | (0,06)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,01              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,01)            | (0,02)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | (0,02)            | (0,02)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,03              | 0,01              |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | k. A.             | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,33)            | 0,17              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 2,79              | (1,75)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,19              | k. A.             |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (4,71)            | (1,96)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                                                |                |                          |                                   |
| <b>ANGOLA</b>                                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| Angola Government International Bond<br>8,750 % fällig am 14.04.2032                           | \$ 3.700       | \$ 3.272                 | 0,76                              |
| <b>ASERBAIDSCHAN</b>                                                                           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                        |                |                          |                                   |
| SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC<br>7,230 % fällig am 17.03.2026                   | 1.200          | 1.192                    | 0,28                              |
| Southern Gas Corridor CJSC<br>6,875 % fällig am 24.03.2026                                     | 1.200          | 1.217                    | 0,28                              |
| Summe Aserbaidtschan                                                                           |                | 2.409                    | 0,56                              |
| <b>BENIN</b>                                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| Benin Government International Bond<br>4,875 % fällig am 19.01.2032                            | € 336          | 352                      | 0,08                              |
| <b>BRASILIEN</b>                                                                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                        |                |                          |                                   |
| Vale S.A.<br>0,000 % (f)                                                                       | BRL 46.580     | 2.926                    | 0,68                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                                      |                |                          |                                   |
| Oi S.A.<br>0,000 % fällig am 30.12.2050                                                        | \$ 895         | 9                        | 0,00                              |
| Summe Brasilien                                                                                |                | 2.935                    | 0,68                              |
| <b>KAMERUN</b>                                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| Republic of Cameroon Government International Bond<br>5,950 % fällig am 07.07.2032             | € 800          | 736                      | 0,17                              |
| 9,500 % fällig am 31.07.2031                                                                   | \$ 2.600       | 2.430                    | 0,56                              |
| Summe Kamerun                                                                                  |                | 3.166                    | 0,73                              |
| <b>KAIMANINSELN</b>                                                                            |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                        |                |                          |                                   |
| Kaisa Group Holdings Ltd.<br>9,375 % fällig am 30.06.2024 ^                                    | 3.400          | 153                      | 0,04                              |
| 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^                                                                 | 700            | 31                       | 0,01                              |
| 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^                                                                | 200            | 9                        | 0,00                              |
| Peru Payroll Deduction Finance Ltd.<br>0,000 % fällig am 01.11.2029 (c)                        | 991            | 865                      | 0,20                              |
| Poinsettia Finance Ltd.<br>6,625 % fällig am 17.06.2031                                        | 680            | 636                      | 0,15                              |
| Red Dorsal Finance Ltd.<br>5,875 % fällig am 12.10.2031                                        | 296            | 294                      | 0,07                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % bar oder 6,000 % PIK)<br>5,000 % fällig am 30.09.2026 ^ (b) | 23             | 3                        | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK)<br>5,250 % fällig am 30.09.2027 ^ (b) | 23             | 3                        | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK)<br>5,500 % fällig am 30.09.2027 ^ (b) | 46             | 6                        | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK)<br>5,750 % fällig am 30.09.2028 ^ (b) | 70             | 9                        | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)<br>6,000 % fällig am 30.09.2029 ^ (b) | 70             | 9                        | 0,00                              |
| Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK)<br>6,250 % fällig am 30.09.2030 ^ (b) | 33             | 4                        | 0,00                              |
| TIB Diversified Payment Rights Finance Co.<br>7,226 % fällig am 15.11.2034                     | 1.100          | 1.100                    | 0,25                              |
| VD DPR Finance Co.<br>6,833 % fällig am 15.03.2035                                             | 2.500          | 2.451                    | 0,57                              |
| Summe Kaimaninseln                                                                             |                | 5.573                    | 1,29                              |
| <b>CHINA</b>                                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                        |                |                          |                                   |
| Yango Justice International Ltd.<br>7,500 % fällig am 17.02.2025 ^                             | 1.100          | 6                        | 0,00                              |

| BESCHREIBUNG                                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>KOLUMBIEN</b>                                                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                               |                |                          |                                   |
| Ecopetrol S.A.<br>5,875 % fällig am 28.05.2045 (i)                                    | \$ 6.300       | \$ 4.353                 | 1,01                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                               |                |                          |                                   |
| Colombia Government International Bond<br>1,000 % fällig am 09.02.2033                | COP 25.000.000 | 6.396                    | 1,48                              |
| 8,375 % fällig am 07.11.2054                                                          | \$ 1.000       | 953                      | 0,22                              |
| 8,500 % fällig am 25.04.2035                                                          | 2.100          | 2.184                    | 0,50                              |
| Colombian TES<br>7,000 % fällig am 26.03.2031                                         | COP 64.083.400 | 12.659                   | 2,93                              |
|                                                                                       |                | 22.192                   | 5,13                              |
| Summe Kolumbien                                                                       |                | 26.545                   | 6,14                              |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                                                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                               |                |                          |                                   |
| Czechoslovak Group A/S<br>5,250 % fällig am 10.01.2031 (a)                            | € 200          | 240                      | 0,06                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                               |                |                          |                                   |
| Czech Republic Government International Bond<br>5,000 % fällig am 30.09.2030          | CZK 150.100    | 7.533                    | 1,74                              |
| Summe Tschechische Republik                                                           |                | 7.773                    | 1,80                              |
| <b>DÄNEMARK</b>                                                                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                               |                |                          |                                   |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab<br>1,000 % fällig am 01.10.2050                  | DKK 0          | 0                        | 0,00                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                                                          | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Nykredit Realkredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.10.2050                               | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2052                                                          | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Realkredit Danmark A/S<br>1,000 % fällig am 01.10.2050                                | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053                                                          | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                                                          | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Summe Dänemark                                                                        |                | 0                        | 0,00                              |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                                                        |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                               |                |                          |                                   |
| Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik<br>13,000 % fällig am 05.12.2025        | DOP 115.700    | 1.929                    | 0,45                              |
| Dominican Republic Government International Bond<br>10,500 % fällig am 15.03.2037 (i) | 1.576.700      | 26.824                   | 6,20                              |
| 10,500 % fällig am 15.03.2037                                                         | 8.000          | 136                      | 0,03                              |
| 10,750 % fällig am 01.06.2036                                                         | 234.200        | 4.049                    | 0,94                              |
| 11,250 % fällig am 15.09.2035                                                         | 13.200         | 235                      | 0,05                              |
| 13,625 % fällig am 03.02.2033                                                         | 19.200         | 378                      | 0,09                              |
| 13,625 % fällig am 10.02.2034                                                         | 49.700         | 1.002                    | 0,23                              |
| Summe Dominikanische Republik                                                         |                | 34.553                   | 7,99                              |
| <b>ECUADOR</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                               |                |                          |                                   |
| Ecuador Government International Bond<br>0,000 % fällig am 31.07.2030 (c)             | \$ 410         | 299                      | 0,07                              |
| 5,000 % fällig am 31.07.2040                                                          | 90             | 57                       | 0,01                              |
| 5,500 % fällig am 31.07.2035                                                          | 752            | 549                      | 0,13                              |
| 6,900 % fällig am 31.07.2030                                                          | 11.564         | 10.061                   | 2,33                              |
| Summe Ecuador                                                                         |                | 10.966                   | 2,54                              |

| BESCHREIBUNG                                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÄGYPTEN</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                        |                |                          |                                   |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028           | EGP 322.900    | \$ 6.429                 | 1,49                              |
| <b>FRANKREICH</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                        |                |                          |                                   |
| New Immo Holding S.A.<br>2,750 % fällig am 26.11.2026                          | € 200          | 232                      | 0,05                              |
| <b>GABUN</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                        |                |                          |                                   |
| Gabon Government International Bond<br>9,500 % fällig am 18.02.2029            | \$ 1.100       | 1.008                    | 0,23                              |
| <b>GHANA</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                        |                |                          |                                   |
| Ghana Government International Bond<br>0,000 % fällig am 03.07.2026 (c)        | \$ 38          | 37                       | 0,01                              |
| 0,000 % fällig am 03.01.2030 (c)                                               | 89             | 75                       | 0,02                              |
| 1,500 % fällig am 03.01.2037                                                   | 600            | 276                      | 0,06                              |
| 5,000 % fällig am 03.07.2029                                                   | 437            | 411                      | 0,09                              |
| 5,000 % fällig am 03.07.2035                                                   | 157            | 123                      | 0,03                              |
| 8,350 % fällig am 16.02.2027                                                   | GHS 34.634     | 2.872                    | 0,66                              |
| 8,950 % fällig am 11.02.2031                                                   | 1.020          | 63                       | 0,01                              |
| 9,100 % fällig am 10.02.2032                                                   | 2.653          | 155                      | 0,04                              |
| 10,000 % fällig am 17.08.2027                                                  | 300            | 24                       | 0,01                              |
| Summe Ghana                                                                    |                | 4.036                    | 0,93                              |
| <b>HONGKONG</b>                                                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                        |                |                          |                                   |
| Fortune Star BVI Ltd.<br>8,500 % fällig am 19.05.2028                          | \$ 1.600       | 1.611                    | 0,37                              |
| <b>INDIEN</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                        |                |                          |                                   |
| IIFL Finance Ltd.<br>8,750 % fällig am 24.07.2028                              | 1.000          | 1.007                    | 0,23                              |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.<br>7,110 % fällig am 11.03.2032             | 2.100          | 2.108                    | 0,49                              |
| Summe Indien                                                                   |                | 3.115                    | 0,72                              |
| <b>INDONESIEN</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                        |                |                          |                                   |
| Pertamina Hulu Energi PT<br>5,250 % fällig am 21.05.2030                       | 1.200          | 1.213                    | 0,28                              |
| <b>IRLAND</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                        |                |                          |                                   |
| Black Diamond CLO DAC<br>3,096 % fällig am 20.01.2032                          | € 38           | 45                       | 0,01                              |
| Cairn CLO DAC<br>3,059 % fällig am 15.10.2031                                  | 583            | 683                      | 0,16                              |
| Carlyle Euro CLO DAC<br>2,979 % fällig am 15.01.2031                           | 801            | 940                      | 0,22                              |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.<br>2,893 % fällig am 15.11.2031 | 655            | 769                      | 0,18                              |
| Oak Hill European Credit Partners DAC<br>2,976 % fällig am 20.10.2031          | 246            | 288                      | 0,06                              |
|                                                                                |                | 2.725                    | 0,63                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                        |                |                          |                                   |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC<br>5,950 % fällig am 15.04.2030 ^ (h)  | \$ 900         | 54                       | 0,01                              |
| CIMA Finance DAC<br>2,950 % fällig am 05.09.2029                               | 995            | 915                      | 0,21                              |
| Iridium Capital PLC<br>9,250 % fällig am 18.06.2029                            | € 3.200        | 4.076                    | 0,94                              |
| Sovcombank Via SovCom Capital DAC<br>8,000 % fällig am 07.04.2030 ^ (h)        | \$ 400         | 24                       | 0,01                              |
|                                                                                |                | 5.069                    | 1,17                              |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                          |       |
| Republik Panama                           |                |                          |                          |       |
| 4,103 % fällig am                         |                |                          |                          |       |
| 05.03.2027                                | € 3.200        | \$ 3.784                 | 0,88                     |       |
| Summe Irland                              |                | 11.578                   | 2,68                     |       |

|                                      |           |       |      |  |
|--------------------------------------|-----------|-------|------|--|
| <b>ISRAEL</b>                        |           |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |           |       |      |  |
| Israel Government International Bond |           |       |      |  |
| 0,500 % fällig am                    |           |       |      |  |
| 27.02.2026                           | ILS 9.900 | 2.874 | 0,67 |  |
| 5,000 % fällig am                    |           |       |      |  |
| 30.10.2026                           | € 1.300   | 1.569 | 0,36 |  |
| Summe Israel                         |           | 4.443 | 1,03 |  |

|                                           |       |       |      |  |
|-------------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>ELFENBEINKÜSTE</b>                     |       |       |      |  |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |       |       |      |  |
| Republik Elfenbeinküste                   |       |       |      |  |
| TBD % fällig am                           |       |       |      |  |
| 06.03.2026                                | 3.400 | 3.976 | 0,92 |  |
| TBD % fällig am                           |       |       |      |  |
| 18.03.2026                                | 1.000 | 1.165 | 0,27 |  |
|                                           |       | 5.141 | 1,19 |  |

|                                           |        |        |      |  |
|-------------------------------------------|--------|--------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |        |        |      |  |
| Ivory Coast Government International Bond |        |        |      |  |
| 6,625 % fällig am                         |        |        |      |  |
| 22.03.2048                                | 6.200  | 5.698  | 1,32 |  |
| 8,075 % fällig am                         |        |        |      |  |
| 01.04.2036                                | \$ 500 | 483    | 0,11 |  |
|                                           |        | 6.181  | 1,43 |  |
| Summe Elfenbeinküste                      |        | 11.322 | 2,62 |  |

|                                      |       |       |      |  |
|--------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>JORDANIEN</b>                     |       |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |       |       |      |  |
| Jordan Government International Bond |       |       |      |  |
| 7,375 % fällig am                    |       |       |      |  |
| 10.10.2047                           | 1.200 | 1.065 | 0,25 |  |

|                                         |       |       |      |  |
|-----------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>KASACHSTAN</b>                       |       |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |       |      |  |
| KazMunayGas National Co. JSC            |       |       |      |  |
| 6,375 % fällig am                       |       |       |      |  |
| 24.10.2048                              | 1.100 | 1.019 | 0,24 |  |

|                                    |             |       |      |  |
|------------------------------------|-------------|-------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |             |       |      |  |
| Development Bank of Kazakhstan JSC |             |       |      |  |
| 10,950 % fällig am                 |             |       |      |  |
| 06.05.2026                         | KZT 291.500 | 538   | 0,12 |  |
| 13,489 % fällig am                 |             |       |      |  |
| 23.05.2028                         | 420.500     | 739   | 0,17 |  |
|                                    |             | 1.277 | 0,29 |  |
| Summe Kasachstan                   |             | 2.296 | 0,53 |  |

|                                           |        |     |      |  |
|-------------------------------------------|--------|-----|------|--|
| <b>KENIA</b>                              |        |     |      |  |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |        |     |      |  |
| Republik Kenia                            |        |     |      |  |
| 9,849 % fällig am                         |        |     |      |  |
| 05.04.2028                                | \$ 900 | 898 | 0,21 |  |

|                                                 |     |       |      |  |
|-------------------------------------------------|-----|-------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                         |     |       |      |  |
| Republic of Kenya Government International Bond |     |       |      |  |
| 9,500 % fällig am                               |     |       |      |  |
| 05.03.2036                                      | 700 | 661   | 0,15 |  |
| Summe Kenia                                     |     | 1.559 | 0,36 |  |

|                                         |         |       |      |  |
|-----------------------------------------|---------|-------|------|--|
| <b>LUXEMBURG</b>                        |         |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |       |      |  |
| Chile Electricity Lux MPC SARL          |         |       |      |  |
| 5,672 % fällig am                       |         |       |      |  |
| 20.10.2035                              | 3.300   | 3.326 | 0,77 |  |
| Greensaif Pipelines Bidco SARL          |         |       |      |  |
| 6,103 % fällig am                       |         |       |      |  |
| 23.08.2042                              | 1.100   | 1.102 | 0,25 |  |
| Raizen Fuels Finance S.A.               |         |       |      |  |
| 6,250 % fällig am                       |         |       |      |  |
| 08.07.2032 (a)                          | 1.200   | 1.193 | 0,28 |  |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.  |         |       |      |  |
| 5,250 % fällig am                       |         |       |      |  |
| 23.05.2023 ^h)                          | 1.600   | 96    | 0,02 |  |
| Virtuo2 Finance SARL                    |         |       |      |  |
| 7,930 % fällig am                       |         |       |      |  |
| 12.01.2034                              | € 1.900 | 2.233 | 0,52 |  |
| Summe Luxemburg                         |         | 7.950 | 1,84 |  |

|                                         |        |     |      |  |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|--|
| <b>MEXIKO</b>                           |        |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |  |
| Metalsa S.A. de C.V.                    |        |     |      |  |
| 3,750 % fällig am                       |        |     |      |  |
| 04.05.2031                              | \$ 800 | 658 | 0,15 |  |

| BESCHREIBUNG               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|----------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>PETROLEOS MEXICANOS</b> |                |                          |                          |       |
| 6,375 % fällig am          |                |                          |                          |       |
| 23.01.2045                 | \$ 1.800       | 1.276                    | 0,30                     |       |
| 7,690 % fällig am          |                |                          |                          |       |
| 23.01.2050                 | 2.100          | 1.653                    | 0,38                     |       |
| Trust Fibra Uno            |                |                          |                          |       |
| 6,390 % fällig am          |                |                          |                          |       |
| 15.01.2050                 | 1.250          | 1.045                    | 0,24                     |       |
|                            |                | 4.632                    | 1,07                     |       |

|                                      |             |        |      |  |
|--------------------------------------|-------------|--------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |             |        |      |  |
| Mexico Government International Bond |             |        |      |  |
| 2,750 % fällig am                    |             |        |      |  |
| 27.11.2031 (e)                       | MXN 114.761 | 5.384  | 1,24 |  |
| 8,500 % fällig am                    |             |        |      |  |
| 01.03.2029                           | 327.000     | 17.286 | 4,00 |  |
| 8,500 % fällig am                    |             |        |      |  |
| 28.02.2030                           | 146.000     | 7.687  | 1,78 |  |
|                                      |             | 30.357 | 7,02 |  |
| Summe Mexiko                         |             | 34.989 | 8,09 |  |

|                                         |          |       |      |  |
|-----------------------------------------|----------|-------|------|--|
| <b>MAROKKO</b>                          |          |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |       |      |  |
| OCP S.A.                                |          |       |      |  |
| 5,125 % fällig am                       |          |       |      |  |
| 23.06.2051                              | \$ 2.200 | 1.673 | 0,39 |  |

|                                         |       |       |      |  |
|-----------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>NIEDERLANDE</b>                      |       |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |       |      |  |
| JAB Holdings BV                         |       |       |      |  |
| 3,750 % fällig am                       |       |       |      |  |
| 28.05.2051                              | 2.500 | 1.652 | 0,38 |  |
| Yinson Boronia Production BV            |       |       |      |  |
| 8,498 % fällig am                       |       |       |      |  |
| 31.01.2045 (a)                          | 1.700 | 1.723 | 0,40 |  |
| Yinson Boronia Production BV            |       |       |      |  |
| 8,947 % fällig am                       |       |       |      |  |
| 31.07.2042                              | 3.271 | 3.485 | 0,81 |  |
|                                         |       | 6.860 | 1,59 |  |

|                                           |       |       |      |  |
|-------------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |       |       |      |  |
| Veon Amsterdam                            |       |       |      |  |
| 8,531 % - 10,750 %                        |       |       |      |  |
| fällig am 25.03.2027                      | 1.700 | 1.701 | 0,39 |  |
| Summe Niederlande                         |       | 8.561 | 1,98 |  |

|                                           |          |       |      |  |
|-------------------------------------------|----------|-------|------|--|
| <b>NIGERIA</b>                            |          |       |      |  |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |          |       |      |  |
| Bank of Industry Ltd.                     |          |       |      |  |
| 3,695 % fällig am                         |          |       |      |  |
| 23.08.2027                                | € 3.000  | 3.498 | 0,81 |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |          |       |      |  |
| Nigeria Government International Bond     |          |       |      |  |
| 7,625 % fällig am                         |          |       |      |  |
| 21.11.2025                                | \$ 1.700 | 1.715 | 0,40 |  |
| Summe Nigeria                             |          | 5.213 | 1,21 |  |

|                                      |       |       |      |  |
|--------------------------------------|-------|-------|------|--|
| <b>PANAMA</b>                        |       |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |       |       |      |  |
| Panama Government International Bond |       |       |      |  |
| 4,500 % fällig am                    |       |       |      |  |
| 01.04.2056 (i)                       | 1.700 | 1.106 | 0,26 |  |

|                                        |               |   |       |      |
|----------------------------------------|---------------|---|-------|------|
| <b>PARAGUAY</b>                        |               |   |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |               |   |       |      |
| Paraguay Government International Bond |               |   |       |      |
| 8,500 % fällig am                      |               |   |       |      |
| 04.03.2035                             | PYG 13.673.00 | 0 | 1,672 | 0,39 |

|                                              |          |       |      |  |
|----------------------------------------------|----------|-------|------|--|
| <b>PERU</b>                                  |          |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |          |       |      |  |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |          |       |      |  |
| 9,700 % fällig am                            |          |       |      |  |
| 05.03.2045                                   | PEN 700  | 206   | 0,05 |  |
| 10,100 % fällig am                           |          |       |      |  |
| 15.12.2043                                   | 23.000   | 6.887 | 1,59 |  |
| Petroleos del Peru S.A.                      |          |       |      |  |
| 5,625 % fällig am                            |          |       |      |  |
| 19.06.2047                                   | \$ 2.200 | 1.393 | 0,32 |  |
|                                              |          | 8.486 | 1,96 |  |

|                                    |           |       |      |  |
|------------------------------------|-----------|-------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |           |       |      |  |
| Peru Government International Bond |           |       |      |  |
| 5,400 % fällig am                  |           |       |      |  |
| 12.08.2034                         | PEN 4.500 | 1.201 | 0,28 |  |
| 5,500 % fällig am                  |           |       |      |  |
| 30.03.2036                         | \$ 1.300  | 1.303 | 0,30 |  |

| BESCHREIBUNG      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|-------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| <b>PEN</b>        |                |                          |                          |       |
| 6,150 % fällig am |                |                          |                          |       |
| 12.08.2032        | PEN 30.800     | \$ 8.978                 | 2,08                     |       |
| 6,200 % fällig am |                |                          |                          |       |
| 30.06.2055        | \$ 1.300       | 1.307                    | 0,30                     |       |
| 6,850 % fällig am |                |                          |                          |       |
| 12.08.2035        | PEN 10.600     | 3.085                    | 0,71                     |       |
| 6,900 % fällig am |                |                          |                          |       |
| 12.08.2037        | 1.400          | 402                      | 0,09                     |       |
| 6,950 % fällig am |                |                          |                          |       |
| 12.08.2031        | 22.241         | 6.815                    | 1,58                     |       |
| 7,300 % fällig am |                |                          |                          |       |
| 12.08.2033        | 13.800         | 4.244                    | 0,98                     |       |
|                   |                | 27.335                   | 6,32                     |       |
| Summe Peru        |                | 35.821                   | 8,28                     |       |

|                                      |            |        |      |  |
|--------------------------------------|------------|--------|------|--|
| <b>POLEN</b>                         |            |        |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |            |        |      |  |
| Poland Government International Bond |            |        |      |  |
| 4,750 % fällig am                    |            |        |      |  |
| 25.07.2029 (i)                       | PLN 30.200 | 8.350  | 1,93 |  |
| 5,750 % fällig am                    |            |        |      |  |
| 25.04.2029 (i)                       | 63.700     | 18.251 | 4,22 |  |
| Summe Polen                          |            | 26.601 | 6,15 |  |

|                                       |         |       |      |  |
|---------------------------------------|---------|-------|------|--|
| <b>RUMÄNIEN</b>                       |         |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |         |       |      |  |
| Romania Government International Bond |         |       |      |  |
| 2,000 % fällig am                     |         |       |      |  |
| 28.01.2032                            | € 1.100 | 1.049 | 0,24 |  |
| 2,000 % fällig am                     |         |       |      |  |
| 14.04.2033                            | 1.100   | 991   | 0,23 |  |
| 2,750 % fällig am                     |         |       |      |  |
| 14.04.2041                            | 2.800   | 2.052 | 0,48 |  |
| 5,250 % fällig am                     |         |       |      |  |
| 30.05.2032                            | 1.500   | 1.735 | 0,40 |  |
| 5,625 % fällig am                     |         |       |      |  |
| 30.05.2037 (i)                        | 1.500   | 1.660 | 0,38 |  |
| 6,375 % fällig am                     |         |       |      |  |
| 18.09.2033                            | 1.500   | 1.815 | 0,42 |  |
| Summe Rumänien                        |         | 9.302 | 2,15 |  |

|                                         |          |       |      |  |
|-----------------------------------------|----------|-------|------|--|
| <b>SAUDI-ARABIEN</b>                    |          |       |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |       |      |  |
| Saudi Arabian Oil Co.                   |          |       |      |  |
| 6,375 % fällig am                       |          |       |      |  |
| 02.06.2055                              | \$ 1.000 | 1.001 | 0,23 |  |

|                                       |         |       |      |  |
|---------------------------------------|---------|-------|------|--|
| <b>SENEGAL</b>                        |         |       |      |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |         |       |      |  |
| Senegal Government International Bond |         |       |      |  |
| 4,750 % fällig am                     |         |       |      |  |
| 13.03.2028                            | € 3.400 | 3.166 | 0,73 |  |

|                                         |        |     |      |  |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|--|
| <b>SÜDAFRIKA</b>                        |        |     |      |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |  |
| Eskom Holdings SOC Ltd.                 |        |     |      |  |
| 6,350 % fällig am                       |        |     |      |  |
| 10.08.2028                              | \$ 800 | 810 | 0,19 |  |

|                                           |            |       |      |  |
|-------------------------------------------|------------|-------|------|--|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |            |       |      |  |
| Transnet SOC Ltd.                         |            |       |      |  |
| 11,558 % fällig am                        |            |       |      |  |
| 02.03.2028                                | ZAR 26.829 | 1.497 | 0,34 |  |

|                                            |             |        |      |  |
|--------------------------------------------|-------------|--------|------|--|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |             |        |      |  |
| South Africa Government International Bond |             |        |      |  |
| 5,750 % fällig am                          |             |        |      |  |
| 30.09.2049                                 | \$ 1.400    | 1.056  | 0,24 |  |
| 8,000 % fällig am                          |             |        |      |  |
| 31.01.2030                                 | ZAR 264.100 | 14.614 | 3,38 |  |
| 10,500 % fällig am                         |             |        |      |  |
| 21.12.2026                                 | 107.900     | 6.299  | 1,46 |  |
|                                            |             | 21.969 | 5,08 |  |
| Summe Südafrika                            |             | 24.276 | 5,61 |  |

| SRI LANKA                               |        |     |      |  |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|--|
| STAATSEMISSIONEN                        |        |     |      |  |
| Sri Lanka Government International Bond |        |     |      |  |
| 3,600 % fällig am 15.06.2035            | \$ 370 | 255 | 0,06 |  |
| 3,600 % fällig am 15.05.2036            | 257    | 210 | 0,05 |  |
| 3,600 % fällig am 15.02.2038            | 514    | 419 | 0,09 |  |
| Summe Sri Lanka                         |        | 884 | 0,20 |  |

| BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,001 % fällig am                                            | €              | 1.000                    | \$ 1.178 0,27                     |
| 15.12.2028                                                   |                |                          | 4.459 1,03                        |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S</b>               |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am                                            | \$             | 1.700                    | 1.699 0,39                        |
| 01.09.2030 (a)                                               |                |                          |                                   |
| <b>Turkey Government International Bond</b>                  |                |                          |                                   |
| 49,053 % fällig am                                           | TRY            | 8.200                    | 207 0,05                          |
| 20.05.2026                                                   |                |                          |                                   |
| 49,053 % fällig am                                           |                | 7.400                    | 187 0,04                          |
| 19.08.2026                                                   |                |                          |                                   |
| 49,053 % fällig am                                           |                | 106.400                  | 2.594 0,60                        |
| 17.05.2028                                                   |                |                          | 4.687 1,08                        |
| Summe Türkei                                                 |                |                          | 10.658 2,46                       |
| <b>UGANDA</b>                                                |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>Republic of Uganda Government International Bond</b>      |                |                          |                                   |
| 15,800 % fällig am                                           | UGX            | 8.248.000                | 2.115 0,49                        |
| 23.06.2039                                                   |                |                          |                                   |
| <b>UKRAINE</b>                                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>Ukraine Government International Bond</b>                 |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am                                            | \$             | 1.026                    | 398 0,09                          |
| 01.02.2034                                                   |                |                          |                                   |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b>        |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am                                            |                | 5.500                    | 3.914 0,90                        |
| 05.04.2032 (c)                                               |                |                          |                                   |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                        |                |                          |                                   |
| <b>Canada Square Funding PLC</b>                             |                |                          |                                   |
| 5,161 % fällig am                                            | £              | 214                      | 293 0,07                          |
| 17.01.2059                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Rochester Financing PLC</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,939 % fällig am                                            |                | 156                      | 213 0,05                          |
| 18.12.2044                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,959 % fällig am                                            |                | 64                       | 88 0,02                           |
| 20.12.2063                                                   |                |                          | 594 0,14                          |
| Summe Großbritannien                                         |                |                          | 4.508 1,04                        |
| <b>USA</b>                                                   |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Aames Mortgage Investment Trust</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,739 % fällig am                                            | \$             | 660                      | 587 0,14                          |
| 25.06.2035                                                   |                |                          |                                   |
| <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>           |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am                                            |                | 168                      | 165 0,04                          |
| 25.04.2035                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                   |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am                                            |                | 580                      | 342 0,08                          |
| 25.10.2036                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>     |                |                          |                                   |
| 5,409 % fällig am                                            |                | 37                       | 37 0,01                           |
| 25.12.2035                                                   |                |                          |                                   |
| <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,644 % fällig am                                            |                | 57                       | 56 0,01                           |
| 25.10.2036                                                   |                |                          |                                   |
| 4,704 % fällig am                                            |                | 218                      | 197 0,05                          |
| 25.07.2036                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>                |                |                          |                                   |
| 5,409 % fällig am                                            |                | 19                       | 20 0,00                           |
| 25.07.2034                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b> |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am                                            |                | 900                      | 888 0,20                          |
| 25.07.2036                                                   |                |                          | 2.292 0,53                        |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                    |                |                          |                                   |
| <b>Finance Ministry Angola</b>                               |                |                          |                                   |
| TBD % fällig am                                              |                | 2.900                    | 2.902 0,67                        |
| 11.12.2025                                                   |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Stepstone Group Midco GmbH</b>                       |                |                          |                                   |
| 6,673 % fällig am                                       | €              | 2.500                    | \$ 2.883 0,66                     |
| 26.04.2032                                              |                |                          |                                   |
| <b>Ziraat Bank</b>                                      |                |                          |                                   |
| TBD % fällig am                                         | \$             | 1.900                    | 1.889 0,44                        |
| 15.06.2034                                              |                |                          | 7.674 1,77                        |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| 4,774 % fällig am                                       |                | 555                      | 549 0,13                          |
| 25.11.2036                                              |                |                          |                                   |
| <b>US-SCHATZobligationen</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>U.S. Treasury Bonds</b>                              |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am                                       |                | 41.900                   | 27.832 6,45                       |
| 15.08.2041                                              |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am                                       |                | 10.500                   | 7.642 1,77                        |
| 15.02.2042                                              |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am                                       |                | 5.400                    | 4.949 1,14                        |
| 15.08.2044                                              |                |                          |                                   |
| <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b> |                |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am                                       |                | 16.229                   | 15.144 3,50                       |
| 15.07.2032                                              |                |                          | 55.567 12,86                      |
| Summe USA                                               |                |                          | 66.082 15,29                      |
| <b>USBEKISTAN</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Ipoteka-Bank ATIB</b>                                |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am                                       |                | 700                      | 698 0,16                          |
| 19.11.2025                                              |                |                          |                                   |
| <b>Uzbek Industrial and Construction Bank ATB</b>       |                |                          |                                   |
| 8,950 % fällig am                                       |                | 1.600                    | 1.687 0,39                        |
| 24.07.2029                                              |                |                          | 2.385 0,55                        |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>National Bank of Uzbekistan</b>                      |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am                                       |                | 1.600                    | 1.682 0,39                        |
| 05.07.2029                                              |                |                          |                                   |
| 19,875 % fällig am                                      | UZS            | 22.910.000               | 1.851 0,43                        |
| 05.07.2027                                              |                |                          |                                   |
| <b>Republic of Uzbekistan International Bond</b>        |                |                          |                                   |
| 16,625 % fällig am                                      |                | 3.150.000                | 253 0,06                          |
| 29.05.2027                                              |                |                          | 3.786 0,88                        |
| Summe Usbekistan                                        |                |                          | 6.171 1,43                        |
| <b>VENEZUELA</b>                                        |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Petroleos de Venezuela S.A.</b>                      |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am                                       | \$             | 4.000                    | 592 0,14                          |
| 17.05.2035 ^                                            |                |                          |                                   |
| 12,750 % fällig am                                      |                | 2.200                    | 327 0,07                          |
| 17.02.2022 ^                                            |                |                          | 919 0,21                          |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Venezuela Government International Bond</b>          |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am                                       |                | 5.000                    | 1.019 0,23                        |
| 15.09.2027 ^                                            |                |                          |                                   |
| 12,750 % fällig am                                      |                | 4.900                    | 890 0,21                          |
| 23.08.2022 ^                                            |                |                          | 1.909 0,44                        |
| Summe Venezuela                                         |                |                          | 2.828 0,65                        |
| <b>JUNGFERNINSELN (BRITISCH)</b>                        |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Gerdau Trade, Inc.</b>                               |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am                                       |                | 700                      | 701 0,16                          |
| 09.06.2035                                              |                |                          |                                   |
| <b>Studio City Finance Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am                                       |                | 800                      | 803 0,19                          |
| 15.07.2025                                              |                |                          |                                   |
| Summe Jungferninseln (Britisch)                         |                |                          | 1.504 0,35                        |

| BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SAMBIA</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Zambia Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 11,000 % fällig am                          | ZMW            | 15.000                   | \$ 625 0,14                       |
| 25.01.2026                                  |                |                          |                                   |
| <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>             |                |                          |                                   |
| <b>KURZFRISTIGE SCHULDTITEL</b>             |                |                          |                                   |
| <b>Standard Chartered Bank</b>              |                |                          |                                   |
| 22,238 % fällig am                          | PKR            | 221.900                  | 686 0,16                          |
| 01.12.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 22,242 % fällig am                          |                | 199.300                  | 621 0,14                          |
| 03.11.2025 (c)(d)                           |                |                          | 1.307 0,30                        |
| <b>EGYPT TREASURY BILLS</b>                 |                |                          |                                   |
| 27,448 % fällig am                          | EGP            | 131.525                  | 2.570 0,60                        |
| 12.08.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 27,500 % fällig am                          |                | 132.450                  | 2.508 0,58                        |
| 23.09.2025 (c)(d)                           |                |                          | 5.078 1,18                        |
| <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>               |                |                          |                                   |
| 22,542 % fällig am                          | NGN            | 1.204.834                | 712 0,16                          |
| 25.11.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 23,031 % fällig am                          |                | 864.702                  | 506 0,11                          |
| 09.12.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 26,488 % fällig am                          |                | 2.460.007                | 1.551 0,36                        |
| 19.08.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 26,683 % fällig am                          |                | 1.360.315                | 858 0,20                          |
| 19.08.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 26,691 % fällig am                          |                | 2.387.914                | 1.418 0,33                        |
| 11.11.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 30,612 % fällig am                          |                | 5.339.580                | 2.803 0,65                        |
| 29.06.2026 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 30,864 % fällig am                          |                | 3.724.194                | 1.958 0,45                        |
| 26.06.2026 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 31,337 % fällig am                          |                | 40.700                   | 25 0,01                           |
| 07.10.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 31,577 % fällig am                          |                | 3.061.600                | 1.866 0,43                        |
| 07.10.2025 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 32,855 % fällig am                          |                | 7.089.519                | 3.755 0,87                        |
| 12.06.2026 (c)(d)                           |                |                          |                                   |
| 33,065 % fällig am                          |                | 7.095.994                | 3.761 0,87                        |
| 11.06.2026 (c)(d)                           |                |                          | 19.213 4,44                       |
| Summe kurzfristige Instrumente              |                |                          | 25.598 5,92                       |
| Summe Übertragbare Wertpapiere              | \$             | 430.159                  | 99,48                             |
| <b>AKTIEN</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>INVESTMENTFONDS</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>    |                |                          |                                   |
| <b>PIMCO Select</b>                         |                |                          |                                   |
| Funds plc -                                 |                |                          |                                   |
| PIMCO                                       |                |                          |                                   |
| US Dollar                                   |                |                          |                                   |
| Short-Term                                  |                |                          |                                   |
| Floating NAV                                |                |                          |                                   |
| Fund (g)                                    | 3.400.147      | 33.905                   | 7,84                              |
| <b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>                |                |                          |                                   |
| <b>PIMCO ETFs plc -</b>                     |                |                          |                                   |
| PIMCO                                       |                |                          |                                   |
| US Dollar                                   |                |                          |                                   |
| Short Maturity                              |                |                          |                                   |
| UCITS ETF (g)                               | 300            | 30                       | 0,01                              |
| Summe Investmentfonds                       | \$             | 33.935                   | 7,85                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025          | 437                     | \$ 884                                          | 0,20                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025          | 1                       | (3)                                             | 0,00                    |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures                 | Short | 09.2025          | 5                       | (16)                                            | 0,00                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025          | 226                     | (894)                                           | (0,21)                  |
|                                                                |       |                  |                         | <b>\$ (29)</b>                                  | <b>(0,01)</b>           |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | <b>\$ (29)</b>                                  | <b>(0,01)</b>           |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

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

| Referenzeinheit             | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Petrobras Global Finance BV | (1,000) %                      | 20.12.2029            | \$ 3.300                       | \$ (54)                                         | (0,01)                  |

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

| Referenzeinheit   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Barclays Bank PLC | 1,000 %                        | 20.12.2025            | € 300                          | \$ 0                                            | 0,00                    |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 12.400        | \$ (32)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500              | 19.03.2035            | 7.400           | (45)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS | 6,000              | 17.09.2030            | INR 1.860.700   | (97)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day THB-THOR Compounded-OIS  | 2,000              | 17.09.2030            | THB 376.000     | 35                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 0,750              | 16.06.2031            | \$ 2.500        | 227                                             | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,250              | 16.12.2050            | 1.500           | 732                                             | 0,17                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,250              | 16.06.2051            | 4.500           | 1.341                                           | 0,31                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,500              | 18.12.2029            | 4.100           | 274                                             | 0,06                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,750              | 15.12.2031            | 2.700           | 368                                             | 0,09                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 18.12.2025            | 400             | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 19.03.2029            | 48.400          | (1.094)                                         | (0,25)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 19.03.2030            | 49.700          | 1.462                                           | 0,34                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2026            | 71.600          | 313                                             | 0,07                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2029            | 800             | 10                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2030            | 15.525          | (186)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2030            | 58.700          | 10                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 19.03.2034            | 5.300           | 205                                             | 0,05                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2034            | 1.400           | 21                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 19.03.2035            | 1.300           | (42)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 19.03.2035            | 9.900           | 167                                             | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 20.12.2053            | 8.900           | (112)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 19.03.2055            | 12.600          | 197                                             | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2055            | 15.650          | 361                                             | 0,08                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,319              | 30.05.2033            | 12.400          | (75)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 18.12.2025            | 60.100          | 239                                             | 0,06                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.12.2030            | 17.800          | (154)                                           | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.12.2033            | 1.300           | (28)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 18.12.2054            | 600             | 20                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,600              | 17.01.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,648              | 08.01.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,684              | 03.01.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,735              | 23.01.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,738              | 23.01.2034            | 200             | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2029            | 6.400           | 207                                             | 0,05                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2029            | 31.600          | (682)                                           | (0,16)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2029            | 44.000          | 390                                             | 0,09                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2031            | 4.700           | 90                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 02.01.2034            | 200             | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2034            | 4.100           | (159)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2034            | 18.600          | 496                                             | 0,11                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2034            | 11.500          | (336)                                           | (0,08)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2034            | 3.600           | 111                                             | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2036            | 1.100           | (14)                                            | 0,00                    |



| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,830 %            | 12.10.2053            | \$ 100          | \$ (2)                                          | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,854              | 29.12.2033            | 400             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,860              | 21.02.2034            | 200             | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,880              | 10.07.2034            | 900             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,900              | 30.09.2026            | 90.900          | 369                                             | 0,09                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,920              | 27.02.2026            | 2.300           | 4                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,940              | 22.02.2029            | 900             | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,950              | 19.12.2033            | 300             | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,994              | 02.07.2034            | 400             | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,030              | 04.10.2033            | 100             | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,030              | 15.12.2033            | 300             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,060              | 02.07.2034            | 1.500           | (34)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,078              | 29.04.2034            | 500             | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,080              | 05.06.2034            | 500             | (15)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,086              | 13.01.2055            | 4.800           | (141)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,090              | 30.04.2034            | 900             | 34                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,100              | 31.03.2027            | 92.300          | (127)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,100              | 31.08.2029            | 1.600           | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,130              | 03.05.2034            | 600             | 24                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,132              | 13.01.2030            | 18.200          | 570                                             | 0,13                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,150              | 12.10.2033            | 300             | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,155              | 02.10.2033            | 400             | 16                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,170              | 03.10.2033            | 1.200           | 51                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,175              | 10.10.2033            | 100             | 4                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,220              | 20.10.2033            | 200             | 9                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,230              | 23.10.2033            | 100             | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,250              | 22.11.2033            | 300             | (12)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,393              | 25.10.2033            | 100             | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,435              | 01.11.2033            | 200             | 13                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,450              | 01.11.2033            | 400             | 26                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 6,962              | 04.01.2027            | BRL 8.300       | (277)                                           | (0,06)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 8,589              | 04.01.2027            | 11.900          | 349                                             | 0,08                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 9,650              | 02.01.2026            | 44.500          | 409                                             | 0,09                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 9,795              | 04.01.2027            | 37.100          | (486)                                           | (0,11)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,145             | 04.01.2027            | 2.500           | (49)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,231             | 04.01.2027            | 9.400           | (178)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,472             | 04.01.2027            | 28.200          | (481)                                           | (0,11)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 10,602             | 04.01.2027            | 45.800          | (572)                                           | (0,13)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 10,985             | 02.01.2029            | 2.500           | 17                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,083             | 04.01.2027            | 22.200          | (293)                                           | (0,07)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,439             | 04.01.2027            | 15.500          | (117)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,449             | 04.01.2027            | 15.500          | (116)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,456             | 02.01.2026            | 38.300          | (192)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,523             | 02.01.2029            | 38.700          | (251)                                           | (0,06)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 12,132             | 04.01.2027            | 21.700          | (91)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 12,569             | 02.01.2029            | 88.300          | 166                                             | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 12,981             | 04.01.2027            | 27.000          | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,291             | 02.01.2029            | 75.600          | 141                                             | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,524             | 02.01.2029            | 6.600           | (39)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 3,100              | 26.11.2025            | COP 2.651.000   | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,060              | 26.11.2025            | 14.071.000      | 79                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,110              | 23.03.2026            | 4.493.200       | (24)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,651              | 26.11.2025            | 2.624.800       | (13)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,080              | 02.02.2027            | 1.622.900       | 9                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,090              | 28.04.2028            | 1.750.200       | 15                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,130              | 28.04.2028            | 618.500         | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,140              | 28.04.2028            | 1.855.800       | 16                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,340              | 10.09.2029            | 34.644.500      | (374)                                           | (0,09)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,620              | 26.02.2034            | 3.210.600       | (71)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,020              | 03.11.2027            | 35.000.000      | 73                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,260              | 02.05.2030            | 21.682.500      | (89)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,320              | 31.03.2027            | 2.908.000       | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,560              | 30.03.2027            | 4.424.200       | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,560              | 18.06.2030            | 34.000.000      | 41                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,570              | 20.03.2030            | 18.678.700      | 14                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,830              | 31.03.2028            | 4.898.000       | (12)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,100              | 09.02.2033            | 22.600.000      | (24)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,140              | 28.04.2028            | 3.977.000       | 18                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,800              | 17.01.2028            | 9.809.000       | 82                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 11,640             | 21.10.2025            | 11.114.000      | (39)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 11,930             | 10.11.2025            | 5.929.100       | 23                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 12,000             | 26.11.2025            | 427.000         | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 12,060             | 09.11.2025            | 4.198.000       | 17                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,021              | 07.10.2029            | SEK 150.700     | (93)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,298              | 07.10.2029            | 149.400         | 306                                             | 0,07                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,370              | 26.08.2030            | ZAR 41.700      | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,560              | 22.09.2030            | 40.800          | 18                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,570              | 27.05.2030            | 31.500          | 19                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,650              | 20.06.2030            | 82.312          | (41)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,700              | 18.06.2030            | 164.580         | (99)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,775              | 18.03.2030            | 75.000          | (86)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,810              | 27.03.2030            | 157.400         | (163)                                           | (0,04)                  |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 7,810 %            | 20.06.2030            | ZAR 32.027      | \$ 37                                           | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 7,860              | 18.06.2030            | 75.000          | 96                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,100              | 05.06.2026            | 10.600          | (6)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,599              | 05.06.2029            | 337.200         | 102                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 1,947              | 23.11.2027            | 999.000         | 64                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 1,950              | 05.05.2026            | 1.239.600       | (36)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 1,965              | 24.11.2027            | 851.000         | 54                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 2,020              | 30.04.2026            | 1.300.000       | (37)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 2,183              | 04.12.2027            | 2.661.000       | (153)                                           | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 2,640              | 01.03.2026            | 795.000         | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 3,530              | 06.07.2026            | 1.995.000       | 38                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,000              | 06.07.2028            | 1.019.000       | 19                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,775              | 23.02.2026            | 2.959.500       | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,810              | 01.10.2034            | 5.200.000       | (99)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,935              | 29.01.2034            | 8.000.000       | 31                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,030              | 23.02.2034            | 709.200         | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,050              | 01.04.2033            | 2.200.000       | 20                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,125              | 14.03.2030            | 3.744.100       | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,180              | 01.10.2028            | 790.000         | (18)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,240              | 01.09.2030            | 1.286.000       | (37)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,260              | 01.03.2026            | 620.000         | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,360              | 27.03.2028            | 1.914.900       | (52)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,370              | 01.10.2028            | 3.136.000       | (94)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,470              | 01.09.2030            | 460.000         | (19)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,470              | 23.12.2034            | 3.714.000       | 126                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,548              | 10.04.2028            | 833.000         | 27                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,570              | 01.10.2028            | 245.000         | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,600              | 12.12.2027            | 1.803.000       | (55)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,635              | 12.12.2027            | 3.695.000       | (115)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,700              | 17.05.2028            | 1.602.100       | (60)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,020              | 02.03.2029            | 190.000         | 11                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,070              | 28.02.2028            | 3.391.700       | (165)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,194              | 10.03.2028            | 1.681.200       | 88                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,223              | 13.03.2028            | 680.300         | 36                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,255              | 13.03.2028            | 478.200         | 26                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,270              | 02.03.2027            | 415.700         | 15                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,330              | 09.03.2028            | 526.800         | 30                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,360              | 25.05.2027            | 24.600          | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,386              | 24.05.2027            | 1.861.000       | 75                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,440              | 07.03.2028            | 1.344.000       | 81                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,500              | 12.12.2025            | 2.564.000       | (25)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,535              | 09.01.2026            | 9.540.000       | 168                                             | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,567              | 12.12.2025            | 1.464.000       | (14)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,570              | 22.12.2025            | 1.277.000       | (12)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,590              | 22.12.2025            | 3.565.000       | (34)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,590              | 21.03.2027            | 4.540.300       | 131                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 6,805              | 06.03.2027            | 1.852.000       | 89                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 7,000              | 27.09.2032            | 1.785.800       | 261                                             | 0,06                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 7,265              | 07.03.2026            | 262.400         | 7                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 7,270              | 07.03.2026            | 2.463.000       | 64                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 7,370              | 06.03.2026            | 1.686.000       | 46                                              | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month CZK-PRIBOR      | 1,025              | 29.07.2030            | 147.600         | 146                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 1,224              | 28.01.2031            | 44.500          | (280)                                           | (0,06)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 1,575              | 26.03.2026            | 28.100          | (25)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 1,725              | 22.07.2026            | 23.800          | (21)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 1,815              | 28.01.2031            | 34.200          | 165                                             | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,130              | 09.04.2030            | 196.100         | (172)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,480              | 15.02.2034            | 21.500          | (30)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,490              | 18.01.2032            | 10.600          | 7                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,580              | 25.10.2029            | 150.800         | 123                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,675              | 08.01.2029            | 62.600          | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,680              | 03.03.2027            | 78.400          | (53)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,870              | 15.02.2026            | 120.700         | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,164              | 14.03.2027            | 73.600          | (42)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,220              | 14.03.2027            | 73.500          | (46)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,250              | 18.04.2029            | 108.000         | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,300              | 18.03.2027            | 143.400         | 128                                             | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,310              | 15.03.2027            | 19.100          | (14)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,320              | 15.03.2027            | 7.200           | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,560              | 14.07.2032            | 111.300         | (315)                                           | (0,07)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,638              | 03.10.2033            | 15.200          | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,740              | 28.02.2033            | 91.700          | (79)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,740              | 28.02.2033            | 91.700          | 301                                             | 0,07                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 5,040              | 17.04.2028            | 27.900          | 56                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 5,100              | 18.04.2028            | 11.800          | 25                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 5,110              | 22.03.2026            | 72.500          | (52)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 5,125              | 22.03.2026            | 50.000          | (36)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 5,480              | 15.03.2026            | 216.500         | 192                                             | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 5,606              | 28.06.2027            | 54.800          | 104                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR     | 0,550              | 15.12.2040            | € 300           | 136                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,248              | 30.09.2029            | 4.500           | 69                                              | 0,02                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250              | 17.09.2030            | 6.350           | 10                                              | 0,00                    |



| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250 %            | 17.09.2035            | € 3.860         | \$ 46                                           | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,287              | 25.11.2029            | 5.900           | (100)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,650              | 08.01.2034            | 200             | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,670              | 03.04.2034            | 300             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,760              | 03.01.2029            | 400             | (9)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,760              | 04.03.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,780              | 02.05.2029            | 1.400           | 41                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,818              | 26.06.2029            | 3.900           | (18)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,827              | 06.05.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,880              | 19.12.2028            | 200             | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,890              | 22.12.2033            | 200             | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,910              | 29.12.2033            | 300             | (15)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,920              | 13.12.2028            | 500             | (23)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,950              | 12.06.2029            | 700             | 26                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,970              | 15.12.2033            | 1.500           | (83)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,990              | 08.12.2033            | 600             | (34)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,148              | 20.11.2033            | 100             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,250              | 06.11.2033            | 500             | (41)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,255              | 22.11.2028            | 200             | (12)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,270              | 08.11.2028            | 600             | (37)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 1,760              | 21.01.2030            | HUF 380.000     | 211                                             | 0,05                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 1,958              | 19.03.2026            | 398.600         | (48)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 5,500              | 04.03.2027            | 2.382.600       | 45                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 5,770              | 25.07.2029            | 1.503.600       | (74)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,140              | 15.02.2034            | 218.000         | (22)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 6,220              | 15.02.2026            | 1.126.100       | 22                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,250              | 09.04.2030            | 3.538.600       | 15                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,280              | 18.03.2027            | 2.363.300       | 96                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,363              | 31.01.2030            | 2.555.200       | 72                                              | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 7,000              | 30.04.2029            | 4.338.400       | 241                                             | 0,06                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 1,110              | 12.01.2031            | PLN 9.800       | 472                                             | 0,11                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 1,165              | 28.01.2031            | 4.400           | (58)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month PLN-WIBOR       | 1,215              | 29.07.2030            | 10.300          | 376                                             | 0,09                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 1,855              | 28.01.2031            | 6.000           | (223)                                           | (0,05)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 2,635              | 28.10.2026            | 32.900          | (684)                                           | (0,16)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 3,035              | 09.12.2026            | 42.000          | 66                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,075              | 07.03.2027            | 28.700          | 53                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,180              | 15.05.2029            | 21.800          | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,313              | 25.07.2029            | 4.000           | (13)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,320              | 25.07.2029            | 6.000           | (20)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,328              | 25.07.2029            | 3.900           | (13)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,360              | 25.07.2028            | 12.000          | (42)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,513              | 25.11.2029            | 28.100          | 406                                             | 0,09                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,560              | 02.09.2029            | 8.300           | 58                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,710              | 25.05.2027            | 12.000          | (23)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,735              | 09.10.2028            | 12.100          | (126)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,740              | 25.10.2033            | 7.100           | (88)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,750              | 02.08.2029            | 8.900           | 98                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,794              | 25.10.2029            | 16.100          | (206)                                           | (0,05)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,820              | 25.07.2029            | 16.100          | (145)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,830              | 18.03.2027            | 17.300          | 57                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,895              | 17.03.2027            | 7.200           | 9                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,920              | 17.03.2027            | 15.000          | 20                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,970              | 21.03.2029            | 60.240          | 372                                             | 0,09                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,310              | 21.03.2033            | 7.400           | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 6,300              | 25.04.2028            | 11.900          | (85)                                            | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 6,670              | 28.06.2027            | 6.200           | 76                                              | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 6,725              | 27.06.2027            | 20.700          | (260)                                           | (0,06)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 6,843              | 28.06.2027            | 1.500           | 20                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 7,310              | 30.06.2027            | 11.000          | (172)                                           | (0,04)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 7,750              | 13.06.2029            | MXN 108.900     | (27)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,753              | 16.04.2030            | 151.500         | 26                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 7,790              | 01.04.2030            | 377.600         | (158)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,885              | 29.12.2025            | 390.800         | 79                                              | 0,02                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,885              | 03.09.2029            | 390.800         | 683                                             | 0,16                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,700              | 24.12.2025            | 85.500          | (37)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 28-Day MXN-TIIE         | 9,700              | 31.05.2034            | 85.500          | (350)                                           | (0,08)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                    |                       |                 | \$ 4.054                                        | 0,93                    |
|                                                |                         |                    |                       |                 | \$ 4.000                                        | 0,92                    |

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

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|--------|------------|----------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,650     | 11.03.2026     | 5.083                      | \$ 35  | \$ 37      | 0,01                 |
| JPM        | Put - OTC USD versus ZAR  | ZAR 17,650     | 08.08.2025     | 8.220                      | 119    | 84         | 0,02                 |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,750     | 09.12.2025     | 4.770                      | 28     | 37         | 0,01                 |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,700         | 16.12.2025     | 2.810                      | 18     | 19         | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus BRL  | BRL 5,660      | 27.08.2025     | 9.173                      | 165    | 311        | 0,07                 |
|            | Call - OTC USD versus ILS | ILS 3,880      | 04.09.2025     | 325                        | 38     | 3          | 0,00                 |
|            |                           |                |                |                            | \$ 403 | \$ 491     | 0,11                 |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|--------|------------|----------------------|
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Zahlung                           | 3,850 %        | 10.07.2025     | 19.700                     | \$ 34  | \$ 24      | 0,01                 |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|----------|------------|----------------------|
| JPM        | Put - OTC USD versus ZAR  | ZAR 17,250     | 08.08.2025     | 16.440                     | \$ (103) | \$ (56)    | (0,01)               |
| MYI        | Put - OTC USD versus BRL  | BRL 5,400      | 27.08.2025     | 9.173                      | (47)     | (75)       | (0,02)               |
|            | Call - OTC USD versus BRL | 6,050          | 27.08.2025     | 9.173                      | (120)    | (23)       | (0,01)               |
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750     | 11.08.2025     | 809                        | (25)     | (1)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750         | 11.08.2025     | 809                        | (18)     | (4)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 40,575         | 19.08.2025     | 1.213                      | (43)     | (6)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 52,725         | 19.08.2025     | 1.213                      | (26)     | (6)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600         | 12.11.2025     | 870                        | (33)     | (5)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900         | 12.11.2025     | 870                        | (24)     | (16)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,635         | 07.01.2026     | 3.883                      | (132)    | (34)       | (0,01)               |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 07.01.2026     | 3.883                      | (88)     | (112)      | (0,03)               |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,800         | 08.01.2026     | 5.771                      | (198)    | (56)       | (0,01)               |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 08.01.2026     | 5.771                      | (132)    | (169)      | (0,04)               |
|            |                           |                |                |                            | \$ (989) | \$ (563)   | (0,13)               |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,270 %        | 26.08.2025     | 92.700                     | \$ (22) | \$ (23)    | (0,01)               |
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 04.07.2025     | 38.300                     | (27)    | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 10.07.2025     | 19.700                     | (11)    | (1)        | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,430          | 22.09.2025     | 97.143                     | (30)    | (49)       | (0,01)               |
|            |                                      |                         |                                   |                |                |                            | \$ (90) | \$ (73)    | (0,02)               |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond       | (1,000) %                   | 20.12.2029        | \$ 5.700                   | \$ 171                                | \$ (93)                                  | \$ 78      | 0,02                 |
| BRC        | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.12.2029        | 3.100                      | 98                                    | (55)                                     | 43         | 0,01                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2033        | 5.500                      | (13)                                  | 7                                        | (6)        | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.06.2034        | 3.300                      | (29)                                  | 33                                       | 4          | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2034        | 1.480                      | (5)                                   | 10                                       | 5          | 0,00                 |
|            |                                            |                             |                   |                            | \$ 222                                | \$ (98)                                  | \$ 124     | 0,03                 |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                                  | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| BOA        | Dominican Republic Government International Bond | 1,000 %                        | 20.12.2029            | \$ 7.900                       | \$ (194)                                 | \$ (15)                                         | \$ (209)       | (0,05)                  |
| BPS        | Mexico Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2025            | 1.600                          | 8                                        | (2)                                             | 6              | 0,00                    |
|            | Mexico Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2027            | 1.500                          | 3                                        | 11                                              | 14             | 0,01                    |
|            | Romania Government International Bond            | 1,000                          | 20.12.2025            | 3.825                          | 6                                        | (1)                                             | 5              | 0,00                    |
| BRC        | South Korea Government International Bond        | 1,000                          | 20.12.2025            | 1.400                          | 10                                       | (4)                                             | 6              | 0,00                    |
| CBK        | Israel Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 150                            | (2)                                      | 3                                               | 1              | 0,00                    |
| DUB        | Turkey Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 8.700                          | (745)                                    | 53                                              | (692)          | (0,16)                  |
| GST        | Argentina Government International Bond          | 5,000                          | 20.06.2030            | 3.500                          | (516)                                    | 133                                             | (383)          | (0,09)                  |
|            | Eutelsat S.A.                                    | 5,000                          | 20.12.2025            | € 300                          | (13)                                     | 20                                              | 7              | 0,00                    |
|            | Israel Government International Bond             | 1,000                          | 20.12.2025            | \$ 3.300                       | 4                                        | 6                                               | 10             | 0,00                    |
|            | Israel Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2026            | 500                            | 0                                        | 2                                               | 2              | 0,00                    |
|            | Petroleos Mexicanos                              | 3,750                          | 24.12.2025            | 1.851                          | 0                                        | 3                                               | 3              | 0,00                    |
|            | Petroleos Mexicanos                              | 4,850                          | 07.05.2026            | 3.552                          | 0                                        | 43                                              | 43             | 0,01                    |
| JPM        | Israel Government International Bond             | 1,000                          | 20.06.2030            | 150                            | (2)                                      | 3                                               | 1              | 0,00                    |
|            | South Africa Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2029            | 9.200                          | (386)                                    | 125                                             | (261)          | (0,06)                  |
| MYC        | South Africa Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2029            | 562                            | (19)                                     | 9                                               | (10)           | 0,00                    |
|            |                                                  |                                |                       |                                | \$ (1.846)                               | \$ 389                                          | \$ (1.457)     | (0,34)                  |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| BPS        | Zahlung <sup>(1)</sup>                  | 3-Month CNY-CNREPOFIX  | 1,500 %            | 18.03.2031            | CNY 165.550     | \$ 74                                    | \$ (45)                                         | \$ 29          | 0,01                    |
| GST        | Erhalt                                  | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,500              | 20.03.2029            | MYR 3.310       | 2                                        | (12)                                            | (10)           | (0,01)                  |
| JPM        | Zahlung <sup>(1)</sup>                  | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,500              | 17.09.2030            | 127.500         | 432                                      | 3                                               | 435            | 0,10                    |
|            |                                         |                        |                    |                       |                 | \$ 508                                   | \$ (54)                                         | \$ 454         | 0,10                    |

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

## VOLATILITÄTSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt<br>Volatilität | Referenzeinheit                                              | Volatilität<br>Ausübungskurs | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------------------------|-----------------------|-----------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-------------------------|
| GLM        | Zahlung                       | USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 6,850 %                      | 11.09.2025            | \$ 33           | \$ 0                                         | \$ 87                                           | \$ 87          | 0,02                    |
|            | Zahlung                       | USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 7,000                        | 11.12.2025            | 33              | 0                                            | 82                                              | 82             | 0,02                    |
| JPM        | Erhalt                        | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,600                        | 24.11.2025            | 30              | 0                                            | (41)                                            | (41)           | (0,01)                  |
|            | Erhalt                        | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,725                        | 26.11.2025            | 10              | 0                                            | (12)                                            | (12)           | 0,00                    |
|            |                               |                                                              |                              |                       |                 | \$ 0                                         | \$ 116                                          | \$ 116         | 0,03                    |

<sup>(1)</sup> Varianz-Swap.

## DEWISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD                    | 99                       | \$ 64                            | \$ 0                               | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 128                      | 145                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 50                       | CNH 361                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 493                      | NZD 820                          | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NZD                    | 820                      | \$ 494                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 64                       | AUD 99                           | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 330                      | CNH 2.358                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025               | BRL                    | 9.786                    | \$ 1.709                         | 0                                  | (84)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | CNY                    | 242                      | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | DOP                    | 370.299                  | 6.185                            | 21                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               | €                      | 26.408                   | 30.028                           | 0                                  | (972)                                                | (0,22)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 20.564.320               | 1.260                            | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 700                      | 193                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 8                        | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 4.225                    | IDR 68.834.968                   | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 410                      | KRW 559.249                      | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>Wertabnahme | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 08.2025               | DOP                    | 7.306                    | \$ 122                           | \$ 1                             | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 114                      | 3                                | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.378                    | CNH 9.850                        | 3                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 7                        | SGD 8                            | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 381                      | MXN 7.383                        | 7                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               |                        | 493                      | PEN 1.822                        | 19                               | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2026               |                        | 936                      | EGP 55.427                       | 23                               | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               | €                      | 4                        | \$ 5                             | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 7.780                    | 2.131                            | 0                                | (61)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | TWD                    | 19.691                   | 606                              | 0                                | (72)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.825                    | IDR 46.147.103                   | 17                               | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 13                       | KRW 17.444                       | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 30                       | RON 133                          | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5.422                    | THB 176.030                      | 2                                | (9)                                                  | (0,00)                  |
|            | 08.2025               | TRY                    | 265.971                  | \$ 6.411                         | 0                                | (70)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | TWD                    | 16.149                   | 495                              | 0                                | (66)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.632                    | CNH 11.640                       | 1                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 313                      | CZK 6.963                        | 18                               | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 1.886                    | INR 163.892                      | 21                               | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 124                      | TWD 4.063                        | 17                               | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 901                      | PEN 3.269                        | 18                               | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | €                      | 2.671                    | \$ 2.871                         | 0                                | (287)                                                | (0,07)                  |
|            | 05.2026               | \$                     | 1.737                    | KWD 529                          | 0                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 06.2026               |                        | 621                      | 190                              | 0                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 06.2027               |                        | 772                      | 234                              | 0                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 05.2029               | KWD                    | 3.368                    | \$ 11.579                        | 506                              | 0                                                    | 0,12                    |
|            | 07.2029               |                        | 409                      | 1.407                            | 61                               | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 05.2030               |                        | 498                      | 1.715                            | 68                               | 0                                                    | 0,02                    |
| BRC        | 07.2025               | €                      | 2.136                    | 2.446                            | 0                                | (62)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | ILS                    | 6.064                    | 1.742                            | 0                                | (59)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | NOK                    | 252                      | 25                               | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 2.207                    | 589                              | 0                                | (22)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | TRY                    | 21.205                   | 518                              | 0                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 736                      | £ 541                            | 5                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 333                      | IDR 5.472.555                    | 4                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 864                      | ILS 2.916                        | 2                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 18                       | ¥ 2.566                          | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 19.201                   | MYR 81.188                       | 98                               | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 5.822                    | PLN 21.711                       | 184                              | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 235                      | TRY 9.582                        | 3                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 302                      | ZAR 5.451                        | 4                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | £                      | 541                      | \$ 736                           | 0                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 7.189                    | CNH 52.134                       | 116                              | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 08.2025               |                        | 3.090                    | CZK 68.712                       | 179                              | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 08.2025               |                        | 13.621                   | TRY 566.326                      | 178                              | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 09.2025               |                        | 7.187                    | PHP 422.335                      | 288                              | 0                                                    | 0,07                    |
| BSH        | 12.2025               | PHP                    | 422.335                  | \$ 7.173                         | 0                                | (289)                                                | (0,07)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 5.772                    | PEN 20.839                       | 100                              | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 5.935                    | \$ 1.625                         | 0                                | (44)                                                 | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 283                      | PEN 1.027                        | 6                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | 8.707                    | \$ 2.402                         | 0                                | (42)                                                 | (0,01)                  |
| CBK        | 12.2025               |                        | 11.976                   | 3.300                            | 0                                | (61)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | EGP                    | 205.243                  | 3.720                            | 0                                | (379)                                                | (0,09)                  |
|            | 07.2025               | €                      | 1.815                    | 2.105                            | 0                                | (25)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | PEN                    | 14.573                   | 3.992                            | 0                                | (114)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | THB                    | 208.784                  | 6.342                            | 0                                | (80)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | TWD                    | 237.266                  | 7.880                            | 0                                | (288)                                                | (0,07)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 12.743                   | BRL 75.671                       | 1.122                            | 0                                                    | 0,26                    |
|            | 07.2025               |                        | 12.463                   | CNY 89.348                       | 10                               | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.996                    | € 3.499                          | 111                              | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 07.2025               |                        | 9.851                    | IDR 160.422.290                  | 29                               | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 13.498                   | KRW 18.508.081                   | 187                              | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.165                    | PEN 7.731                        | 12                               | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 12.227                   | THB 400.819                      | 116                              | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 07.2025               |                        | 263                      | TWD 7.803                        | 5                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 10.871                   | \$ 1.517                         | 0                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNY                    | 153                      | 21                               | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | COP                    | 9.410.152                | 2.256                            | 0                                | (35)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | TWD                    | 38.571                   | 1.184                            | 0                                | (157)                                                | (0,04)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 16                       | CNH 115                          | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 83                       | EGP 4.558                        | 7                                | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 08.2025               |                        | 14.675                   | INR 1.265.131                    | 50                               | (9)                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 320                      | KES 44.035                       | 20                               | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 432                      | PEN 1.555                        | 6                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 7.746                    | \$ 2.165                         | 0                                | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 1.258                    | PEN 4.620                        | 41                               | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 12.2025               | PEN                    | 47.373                   | \$ 12.869                        | 0                                | (422)                                                | (0,10)                  |
|            | 02.2026               | GHS                    | 2.274                    | 159                              | 0                                | (34)                                                 | (0,01)                  |
|            | 06.2026               | ARS                    | 650.723                  | 428                              | 0                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ILS                    | 2.945                    | 850                              | 0                                | (25)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | THB                    | 110.320                  | 3.361                            | 0                                | (32)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 34.666                   | € 29.882                         | 411                              | 0                                                    | 0,10                    |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| FAR        | 07.2025               | \$                     | 632                      | KES 86.266                       | \$ 35                              | \$ 0                                                 | \$ 35                   | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 1.690                    | KRW 2.291.640                    | 4                                  | 0                                                    | 4                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 1.085                    | KZT 568.647                      | 2                                  | 0                                                    | 2                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 3.366                    | THB 110.320                      | 34                                 | 0                                                    | 34                      | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 69                       | TWD 2.058                        | 2                                  | 0                                                    | 2                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | €                      | 29.816                   | \$ 34.666                        | 0                                  | (410)                                                | (410)                   | (0,09) |
|            | 08.2025               | KES                    | 44.035                   | 306                              | 0                                  | (34)                                                 | (34)                    | (0,01) |
|            | 08.2025               | \$                     | 6.544                    | INR 564.712                      | 27                                 | (2)                                                  | 25                      | 0,01   |
|            | 09.2025               | PHP                    | 436.882                  | \$ 7.385                         | 0                                  | (348)                                                | (348)                   | (0,08) |
|            | 09.2025               | \$                     | 45                       | KZT 23.897                       | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 09.2025               |                        | 8                        | MXN 147                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 09.2025               |                        | 11.041                   | PHP 643.658                      | 351                                | 0                                                    | 351                     | 0,08   |
|            | 09.2025               |                        | 244                      | RSD 24.708                       | 4                                  | 0                                                    | 4                       | 0,00   |
|            | 10.2025               | EGP                    | 43.655                   | \$ 766                           | 0                                  | (80)                                                 | (80)                    | (0,02) |
|            | 11.2025               | PKR                    | 72.812                   | 246                              | 0                                  | (5)                                                  | (5)                     | 0,00   |
|            | 12.2025               | UGX                    | 2.144.879                | 573                              | 0                                  | (5)                                                  | (5)                     | 0,00   |
|            | 12.2025               | \$                     | 34                       | KZT 18.065                       | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | BRL                    | 78.110                   | \$ 14.127                        | 0                                  | (184)                                                | (184)                   | (0,04) |
|            | 07.2025               | CHF                    | 454                      | 568                              | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | ¥                      | 808.606                  | 5.555                            | 0                                  | (43)                                                 | (43)                    | (0,01) |
|            | 07.2025               | \$                     | 64                       | AUD 99                           | 1                                  | 0                                                    | 1                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 1.886                    | BRL 10.783                       | 90                                 | 0                                                    | 90                      | 0,02   |
|            | 07.2025               |                        | 552                      | CHF 455                          | 19                                 | 0                                                    | 19                      | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 26                       | CNH 183                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 9.870                    | ¥ 1.415.896                      | 0                                  | (67)                                                 | (67)                    | (0,01) |
|            | 07.2025               |                        | 1.112                    | PLN 4.103                        | 22                                 | 0                                                    | 22                      | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 361                      | SEK 3.461                        | 2                                  | 0                                                    | 2                       | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 568                      | CHF 453                          | 3                                  | 0                                                    | 3                       | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 999                      | CNH 7.203                        | 10                                 | 0                                                    | 10                      | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 3.127                    | INR 270.463                      | 19                                 | 0                                                    | 19                      | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 5.555                    | ¥ 805.632                        | 43                                 | 0                                                    | 43                      | 0,01   |
|            | 09.2025               | MXN                    | 122.979                  | \$ 6.316                         | 0                                  | (141)                                                | (141)                   | (0,03) |
|            | 09.2025               | \$                     | 14.127                   | BRL 79.305                       | 184                                | 0                                                    | 184                     | 0,04   |
|            | 09.2025               |                        | 0                        | PEN 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
| GLM        | 07.2025               | BRL                    | 44.100                   | \$ 7.998                         | 0                                  | (83)                                                 | (83)                    | (0,02) |
|            | 07.2025               | THB                    | 256.958                  | 7.877                            | 0                                  | (28)                                                 | (28)                    | (0,01) |
|            | 07.2025               | TWD                    | 3.892                    | 120                              | 0                                  | (14)                                                 | (14)                    | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 435                      | DOP 25.769                       | 0                                  | (5)                                                  | (5)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 2.335                    | IDR 38.052.866                   | 8                                  | 0                                                    | 8                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 7.890                    | THB 256.958                      | 31                                 | 0                                                    | 31                      | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 317                      | ZAR 5.727                        | 5                                  | 0                                                    | 5                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | DOP                    | 251.534                  | \$ 4.162                         | 42                                 | (57)                                                 | (15)                    | 0,00   |
|            | 08.2025               | \$                     | 4.965                    | HUF 1.798.645                    | 303                                | 0                                                    | 303                     | 0,07   |
|            | 09.2025               | DOP                    | 588.319                  | \$ 9.442                         | 84                                 | (320)                                                | (236)                   | (0,05) |
|            | 09.2025               | PHP                    | 1.583.702                | 26.992                           | 21                                 | (1.061)                                              | (1.040)                 | (0,24) |
|            | 09.2025               | \$                     | 7.998                    | BRL 44.782                       | 84                                 | 0                                                    | 84                      | 0,02   |
|            | 09.2025               |                        | 5.113                    | DOP 329.921                      | 314                                | 0                                                    | 314                     | 0,07   |
|            | 09.2025               |                        | 19.648                   | PHP 1.150.004                    | 706                                | 0                                                    | 706                     | 0,16   |
|            | 10.2025               | EGP                    | 65.823                   | \$ 1.160                         | 0                                  | (112)                                                | (112)                   | (0,03) |
| IND        | 11.2025               | DOP                    | 815.918                  | 13.500                           | 334                                | 0                                                    | 334                     | 0,08   |
|            | 12.2025               | PEN                    | 22.346                   | 6.077                            | 0                                  | (192)                                                | (192)                   | (0,04) |
|            | 07.2026               | ARS                    | 323.584                  | 214                              | 2                                  | 0                                                    | 2                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | SEK                    | 3.466                    | 366                              | 3                                  | 0                                                    | 3                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.081                    | PHP 60.314                       | 0                                  | (12)                                                 | (12)                    | 0,00   |
| JPM        | 08.2025               | INR                    | 866.289                  | \$ 10.055                        | 0                                  | (22)                                                 | (22)                    | (0,01) |
|            | 08.2025               | \$                     | 366                      | SEK 3.458                        | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     | 0,00   |
|            | 09.2025               | PHP                    | 596.994                  | \$ 10.672                        | 106                                | 0                                                    | 106                     | 0,03   |
|            | 07.2025               | BRL                    | 20.236                   | 3.386                            | 0                                  | (304)                                                | (304)                   | (0,07) |
|            | 07.2025               | NZD                    | 820                      | 489                              | 0                                  | (9)                                                  | (9)                     | 0,00   |
| MBC        | 07.2025               | PLN                    | 23.718                   | 6.315                            | 0                                  | (247)                                                | (247)                   | (0,06) |
|            | 07.2025               | SGD                    | 5                        | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | TWD                    | 43.811                   | 1.417                            | 0                                  | (91)                                                 | (91)                    | (0,02) |
|            | 07.2025               | \$                     | 3.585                    | BRL 21.398                       | 319                                | 0                                                    | 319                     | 0,07   |
|            | 07.2025               |                        | 48                       | CNH 348                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 821                      | KRW 1.124.938                    | 11                                 | 0                                                    | 11                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 2.002                    | PLN 7.400                        | 45                                 | 0                                                    | 45                      | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 46                       | SGD 58                           | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 87                       | ZAR 1.552                        | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | TWD                    | 22.707                   | \$ 697                           | 0                                  | (93)                                                 | (93)                    | (0,02) |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.690                    | CNH 12.079                       | 3                                  | 0                                                    | 3                       | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 2.108                    | INR 182.791                      | 18                                 | 0                                                    | 18                      | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 4                        | SGD 5                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 5.271                    | TWD 167.191                      | 541                                | 0                                                    | 541                     | 0,13   |
|            | 10.2025               | EGP                    | 27.689                   | \$ 484                           | 0                                  | (52)                                                 | (52)                    | (0,01) |
| 11.2025    | GHS                   | 4.894                  | 346                      | 0                                | (91)                               | (91)                                                 | (0,02)                  |        |
| 11.2025    | PKR                   | 142.376                | 481                      | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |        |
| 07.2026    | EGP                   | 55.427                 | 898                      | 0                                | (61)                               | (61)                                                 | (0,01)                  |        |
| 07.2025    | €                     | 3.430                  | 3.920                    | 0                                | (106)                              | (106)                                                | (0,02)                  |        |
| 07.2025    | PLN                   | 16.956                 | 4.528                    | 0                                | (163)                              | (163)                                                | (0,04)                  |        |
| 07.2025    | SGD                   | 146                    | 113                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    | TWD                   | 9.461                  | 290                      | 0                                | (35)                               | (35)                                                 | (0,01)                  |        |
| 07.2025    | \$                    | 23                     | CNH 167                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MYI        | 07.2025               | \$                     | 12 CNY                   | 89                               | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 613 €                    | 536                              | 0                                  | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.967 IDR                | 31.952.249                       | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 432 ¥                    | 62.108                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 109 SGD                  | 140                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 138 THB                  | 4.602                            | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 1.447 \$                 | 202                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNY                    | 88                       | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 21.790                   | 676                              | 0                                  | (82)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 23 CNH                   | 167                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 97 EGP                   | 5.363                            | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 113 SGD                  | 145                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 27.665 \$                | 484                              | 0                                  | (52)                                                 | (0,01)                  |
|            | 02.2026               | ILS                    | 9.949                    | 2.721                            | 0                                  | (246)                                                | (0,06)                  |
|            | 07.2025               | €                      | 160                      | 188                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 257.613                  | 1.767                            | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2 £                      | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 221 ¥                    | 31.985                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 236 NOK                  | 2.385                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 6 PLN                    | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 297 ZAR                  | 5.369                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 2.385 \$                 | 236                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 266 CNH                  | 1.902                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 1.767 ¥                  | 256.666                          | 17                                 | 17                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 1.695 NGN                | 2.797.138                        | 94                                 | 94                                                   | 0,02                    |
|            | 10.2025               | EGP                    | 33.685 \$                | 592                              | 0                                  | (56)                                                 | (0,01)                  |
|            | 10.2025               | \$                     | 562 EGP                  | 32.095                           | 58                                 | 58                                                   | 0,01                    |
|            | 12.2025               | CZK                    | 17.890 €                 | 709                              | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 10.2026               | \$                     | 898 AZN                  | 1.607                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2027               |                        | 1.796                    | 3.305                            | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | CNY                    | 89.400 \$                | 12.483                           | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | GHS                    | 12.202                   | 930                              | 0                                  | (242)                                                | (0,06)                  |
|            | 07.2025               | ILS                    | 45                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 320                      | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KES                    | 86.266                   | 588                              | 0                                  | (79)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | PEN                    | 8.568                    | 2.362                            | 0                                  | (52)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | PHP                    | 1.391.263                | 24.511                           | 0                                  | (143)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | SGD                    | 29                       | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 59.304                   | 2.037                            | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 10.861 IDR               | 176.971.729                      | 38                                 | 38                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.122 PEN                | 11.188                           | 29                                 | 29                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 24.882 PHP               | 1.391.263                        | 0                                  | (227)                                                | (0,05)                  |
|            | 07.2025               |                        | 6.705 THB                | 218.438                          | 15                                 | 15                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.850 TWD                | 84.744                           | 67                                 | 67                                                   | 0,02                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 22.744 \$                | 3.142                            | 0                                  | (45)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | TWD                    | 5.292                    | 162                              | 0                                  | (22)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.530 CNH                | 11.017                           | 14                                 | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 12.483 CNY               | 89.161                           | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 2.207 INR                | 189.477                          | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 2 ¥                      | 318                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 23 SGD                   | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PHP                    | 1.270.487 \$             | 22.627                           | 270                                | 141                                                  | 0,03                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 34.168 PHP               | 1.999.940                        | 1.230                              | 1.230                                                | 0,28                    |
|            | 10.2025               |                        | 500 NGN                  | 877.403                          | 51                                 | 51                                                   | 0,01                    |
|            | 12.2025               | PHP                    | 1.400.600 \$             | 23.905                           | 0                                  | (840)                                                | (0,19)                  |
|            | 12.2025               | UGX                    | 2.144.886                | 573                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 12.2025               | \$                     | 24.427 PHP               | 1.391.263                        | 153                                | 153                                                  | 0,04                    |
| SOG        | 07.2025               | €                      | 11 \$                    | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | GHS                    | 5.454                    | 404                              | 0                                  | (120)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | ¥                      | 37.371                   | 259                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 25 NOK                   | 248                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.238 RON                | 5.431                            | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 248 \$                   | 25                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 234 HUF                  | 84.893                           | 15                                 | 15                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 13 INR                   | 1.092                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 259 ¥                    | 37.234                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 541 \$                   | 733                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | PEN                    | 7.730                    | 2.098                            | 0                                  | (79)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 8.027 BRL                | 44.297                           | 89                                 | 89                                                   | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.744 €                  | 1.504                            | 21                                 | 21                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 7.133 TWD                | 209.418                          | 146                                | 146                                                  | 0,03                    |
|            | 12.2025               | PEN                    | 5.157 \$                 | 1.394                            | 0                                  | (52)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | CLP                    | 860.745                  | 920                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ILS                    | 446                      | 124                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 2.381                    | 235                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.425 CLP                | 2.276.952                        | 14                                 | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 144 ¥                    | 20.869                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               |                        | 938 RON                  | 4.119                            | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 23.469 \$                | 3.279                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 482 CNH                  | 3.499                            | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 372 TRY                  | 16.552                           | 28                                 | 28                                                   | 0,01                    |
|            | 11.2025               |                        | 148 TRY                  | 6.971                            | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 12.2025               | € 709                  | CZK 17.889               | \$ 13                            | \$ 0                               | \$ 13                                                | 0,00                    |
|            | 12.2025               | \$ 4.354               | MXN 84.296               | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,01                    |
|            | 01.2026               | 1.888                  | TRY 90.004               | 39                               | 0                                  | 39                                                   | 0,01                    |
| WST        | 07.2025               | € 1.504                | \$ 1.763                 | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥ 429.402              | 2.982                    | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 1.767               | € 1.504                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 2.982                  | ¥ 427.821                | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 10.487                        | \$ (10.928)                        | \$ (441)                                             | (0,10)                  |

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CNH 1.181              | \$ 164                   | \$ 0                             | \$ (2)                             | \$ (2)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | € 28.906               | 33.846                   | 0                                | (86)                               | (86)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | \$ 114                 | € 100                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 3.305              | \$ 459                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 33.920              | € 28.906                 | 86                               | 0                                  | 86                                                   | 0,02                    |
| BOA        | 07.2025               | COP 149.814            | \$ 36                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 60.175              | € 52.923                 | 1.948                            | 0                                  | 1.948                                                | 0,45                    |
| BPS        | 07.2025               | € 118                  | \$ 136                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 145                 | € 128                    | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 12.865                 | INR 1.104.406            | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 220                | \$ 31                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | INR 417.030            | 4.821                    | 0                                | (40)                               | (40)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | TRY 1.077              | 27                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 14.839              | € 13.067                 | 500                              | 0                                  | 500                                                  | 0,12                    |
|            | 07.2025               | 7                      | ¥ 1.077                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 91                     | MYR 385                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 64                     | TRY 2.643                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | CNH 676                | \$ 94                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | € 47                   | 54                       | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥ 2                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 3.193               | CNY 22.894               | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 514                    | € 444                    | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 31                     | IDR 504.794              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 87                     | THB 2.850                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HKD 92                 | \$ 12                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | € 55.282               | 64.133                   | 0                                | (760)                              | (760)                                                | (0,18)                  |
|            | 07.2025               | INR 266.649            | 3.098                    | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 64.133              | € 55.161                 | 759                              | 0                                  | 759                                                  | 0,18                    |
| FAR        | 07.2025               | CNH 1.468              | \$ 204                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 233                    | 32                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025               | MYR 910                | 215                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| IND        | 07.2025               | INR 9.531              | 111                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | 230.563                | 2.679                    | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 5.783              | 802                      | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | 0                      | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | € 408                  | 473                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £ 2                    | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | HKD 7.346              | 940                      | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB 2.850              | 87                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 37                  | COP 149.814              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 20.830                 | € 18.242                 | 583                              | 0                                  | 583                                                  | 0,13                    |
|            | 07.2025               | 8                      | PLN 31                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | COP 149.814            | \$ 36                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 87                  | THB 2.843                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | INR 183.614            | \$ 2.119                 | 0                                | (21)                               | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 212                 | MXN 4.038                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 237                | \$ 33                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025               | \$ 8                   | HKD 66                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 124                    | MYR 526                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HKD 66                 | \$ 8                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | MYR 526                | 124                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | CNH 9.576              | 1.336                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNY 22.946             | 3.204                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | HKD 13.274             | 1.699                    | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MXN 4.038              | 210                      | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 408                | 57                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 3.204               | CNY 22.885               | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 209                    | MXN 4.038                | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025               | HKD 40.399             | \$ 5.172                 | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025               | \$ 8.006               | HKD 62.652               | 0                                | (25)                               | (25)                                                 | (0,01)                  |
| SSB        | 07.2025               | 73                     | CNH 522                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 521                | \$ 73                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | 0                      | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025               | HKD                    | 1.792                    | \$ 229                           | \$ 1                               | \$ 1                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 504.794                  | 31                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.358                    | CNH 9.730                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 35                       | INR 2.982                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 6                        | ZAR 99                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 9.706                    | \$ 1.358                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 2.986                    | 35                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 31                       | IDR 504.794                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 3.955                         | \$ (985)                           | \$ 2.970                                             | 0,69                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025               | COP                    | 1.565                    | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1                        | £ 1                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               |                        | 86                       | INR 7.383                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 0                        | CNH 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | £                      | 310                      | \$ 422                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | INR                    | 2.783                    | 32                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 2                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 39                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 139                      | £ 103                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1                        | THB 33                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1                        | TRY 53                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 422                      | £ 310                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 08.2025               |                        | 0                        | TRY 10                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 12                       | \$ 2                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 1                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 34                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 33                       | CNY 238                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | IDR 3.247                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 08.2025               | HKD                    | 2                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 13                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 0                        | BRL 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 0                        | CNH 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               |                        | 78                       | £ 58                             | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 64                       | \$ 9                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 0                        | CNH 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | HKD                    | 51                       | \$ 6                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 0                        | COP 1.565                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | CZK 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | £ 3                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | ILS 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1                        | PLN 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | COP                    | 1.565                    | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CZK                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | PLN                    | 2                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | CZK                    | 4                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | INR                    | 4.637                    | 54                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MXN                    | 9                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2                        | MXN 38                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 0                        | CNH 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025               |                        | 0                        | HKD 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | HKD                    | 2                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | CNH                    | 163                      | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNY                    | 239                      | 33                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | HKD                    | 91                       | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MXN                    | 29                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 0                        | CNH 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 33                       | CNY 238                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 2                        | MXN 29                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025               | HKD                    | 278                      | \$ 36                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 53                       | HKD 416                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | £                      | 173                      | \$ 237                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1                        | CNH 9                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 432                      | £ 319                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 9                        | \$ 1                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 238                      | £ 173                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | HKD                    | 0                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 3.247                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 23                       | CNH 166                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | CZK 4                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | HUF 152                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | INR 37                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 2                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 165                      | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CZK                    | 4                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|                                  | 08.2025               | INR                    | 37                       | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | \$ 0,00                 |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 0                        | IDR 3.247                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 12                            | \$ (4)                             | \$ 8                                                 | 0,00                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 1.653                                             | 0,38                    |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 469.718                                           | 108,62                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (37.259)                                          | (8,62)                  |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 432.459                                           | 100,00                  |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 44.056 USD (31. Dezember 2024: 13.761 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 1.499 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 7.393 USD (31. Dezember 2024: 12.852 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 1.810 USD (31. Dezember 2024: 2.760 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 405.058                                                      | \$ 25.101                                                    | \$ 430.159 |
| Investmentfonds               | 33.935                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 33.935     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | 5.624                                                           | 0                                                            | 5.624      |
| Summen                        | \$ 33.935                                                                   | \$ 410.682                                                      | \$ 25.101                                                    | \$ 469.718 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 287.648                                                      | \$ 17.871                                                    | \$ 305.519 |
| Investmentfonds               | 15.528                                                                      | 30                                                              | 0                                                            | 15.558     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (87)                                                                        | 3.164                                                           | 3                                                            | 3.080      |
| Summen                        | \$ 15.441                                                                   | \$ 290.842                                                      | \$ 17.874                                                    | \$ 324.157 |

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

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

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC                                | 1,500 %         | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (1.047)         | \$ (1.230)                                                      | (0,29)                  |
|                                    | 5,350           | 08.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | PLN (19.511)      | (5.441)                                                         | (1,26)                  |
| MBC                                | 5,450           | 17.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (21.712)          | (6.021)                                                         | (1,39)                  |
| MEI                                | 4,100           | 24.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (955)          | (956)                                                           | (0,22)                  |
| MYI                                | 1,500           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (362)           | (425)                                                           | (0,10)                  |
| SCX                                | 4,800           | 20.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (21.971)       | (22.273)                                                        | (5,15)                  |
| SOG                                | 4,630           | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.418)           | (2.478)                                                         | (0,57)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (38.824)                                                     | (8,98)                  |

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (6)                              | \$ 0                                  | \$ (6)                              | \$ 57                               | \$ 0                                  | \$ 57                               |
| BOA        | 854                                 | (820)                                 | 34                                  | (561)                               | 290                                   | (271)                               |
| BPS        | 213                                 | 0                                     | 213                                 | 656                                 | (420)                                 | 236                                 |
| BRC        | 1.131                               | 80                                    | 1.211                               | 863                                 | (700)                                 | 163                                 |
| BSH        | (41)                                | (20)                                  | (61)                                | 10                                  | 0                                     | 10                                  |
| CBK        | 165                                 | 0                                     | 165                                 | (37)                                | 110                                   | 73                                  |
| DUB        | (753)                               | 610                                   | (143)                               | (1.323)                             | 960                                   | (363)                               |
| FAR        | (46)                                | 290                                   | 244                                 | 5                                   | 10                                    | 15                                  |
| GLM        | 230                                 | 0                                     | 230                                 | (506)                               | 520                                   | 14                                  |
| GST        | (328)                               | 430                                   | 102                                 | 347                                 | (270)                                 | 77                                  |
| IND        | 72                                  | (270)                                 | (198)                               | 31                                  | 0                                     | 31                                  |
| JPM        | 114                                 | (170)                                 | (56)                                | 303                                 | (300)                                 | 3                                   |
| MBC        | (74)                                | 0                                     | (74)                                | 129                                 | 0                                     | 129                                 |
| MYC        | (59)                                | 70                                    | 11                                  | 177                                 | 0                                     | 177                                 |
| MYI        | 335                                 | (230)                                 | 105                                 | (13)                                | 0                                     | (13)                                |
| RBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 307                                 | (260)                                 | 47                                  |
| SCX        | 91                                  | 0                                     | 91                                  | (464)                               | 470                                   | 6                                   |
| SOG        | (88)                                | 0                                     | (88)                                | 36                                  | 0                                     | 36                                  |
| SSB        | 121                                 | 0                                     | 121                                 | 42                                  | (20)                                  | 22                                  |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 3                                   | 0                                     | 3                                   |
| UAG        | (278)                               | 330                                   | 52                                  | (571)                               | 400                                   | (171)                               |
| WST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 |

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

Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 69,81             | 68,33             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 10,91             | 9,74              |
| Investmentfonds                                                        | 6,37              | 3,98              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,17              | 0,02              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 3,24              | 4,98              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,97              | 2,72              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 6,53              | 10,23             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert   | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Angola                  | 0,76              | 1,00              |
| Argentinien             | k. A.             | 1,88              |
| Aserbaidschan           | 0,56              | 0,37              |
| Benin                   | 0,08              | 0,26              |
| Brasilien               | 0,68              | 1,23              |
| Kamerun                 | 0,73              | 0,96              |
| Kaimaninseln            | 1,29              | 1,00              |
| China                   | 0,00              | 0,00              |
| Kolumbien               | 6,14              | 1,62              |
| Tschechische Republik   | 1,80              | 0,61              |
| Dänemark                | 0,00              | 0,00              |
| Dominikanische Republik | 7,99              | 3,57              |
| Ecuador                 | 2,54              | 1,28              |
| Ägypten                 | 1,49              | 0,70              |
| El Salvador             | k. A.             | 1,33              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Frankreich                                                                             | 0,05              | k. A.             |
| Gabun                                                                                  | 0,23              | k. A.             |
| Ghana                                                                                  | 0,93              | 0,80              |
| Guatemala                                                                              | k. A.             | 0,96              |
| Hongkong                                                                               | 0,37              | 1,06              |
| Indien                                                                                 | 0,72              | 0,65              |
| Indonesien                                                                             | 0,28              | k. A.             |
| Irland                                                                                 | 2,68              | 2,41              |
| Israel                                                                                 | 1,03              | 0,42              |
| Elfenbeinküste                                                                         | 2,62              | 2,71              |
| Jordanien                                                                              | 0,25              | k. A.             |
| Kasachstan                                                                             | 0,53              | 0,47              |
| Kenia                                                                                  | 0,36              | 0,45              |
| Libanon                                                                                | k. A.             | 0,40              |
| Luxemburg                                                                              | 1,84              | 0,36              |
| Mauritius                                                                              | k. A.             | 0,25              |
| Mexiko                                                                                 | 8,09              | 2,74              |
| Mongolei                                                                               | k. A.             | 0,59              |
| Marokko                                                                                | 0,39              | 0,51              |
| Niederlande                                                                            | 1,98              | 0,50              |
| Nigeria                                                                                | 1,21              | 1,46              |
| Pakistan                                                                               | k. A.             | 0,70              |
| Panama                                                                                 | 0,26              | k. A.             |
| Paraguay                                                                               | 0,39              | k. A.             |
| Peru                                                                                   | 8,28              | 9,65              |
| Polen                                                                                  | 6,15              | 2,56              |
| Rumänien                                                                               | 2,15              | 1,96              |
| Saudi-Arabien                                                                          | 0,23              | k. A.             |
| Senegal                                                                                | 0,73              | k. A.             |
| Singapur                                                                               | k. A.             | 0,13              |
| Südafrika                                                                              | 5,61              | 6,60              |
| Sri Lanka                                                                              | 0,20              | 0,56              |
| Supranational                                                                          | k. A.             | 0,17              |
| Tunesien                                                                               | k. A.             | 2,00              |
| Türkei                                                                                 | 2,46              | 2,36              |
| Uganda                                                                                 | 0,49              | k. A.             |
| Ukraine                                                                                | 0,09              | 0,16              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | k. A.             | 0,87              |
| Großbritannien                                                                         | 1,04              | 2,08              |
| USA                                                                                    | 15,29             | 19,09             |
| Usbekistan                                                                             | 1,43              | 1,84              |
| Venezuela                                                                              | 0,65              | 0,70              |
| Jungferninseln (Britisch)                                                              | 0,35              | k. A.             |
| Sambia                                                                                 | 0,14              | 0,47              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 5,92              | 8,92              |
| Investmentfonds                                                                        | 7,85              | 4,76              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | (0,01)            | (0,14)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | (0,01)            | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                                  | 0,00              | 0,09              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,93              | 1,15              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,11              | 0,18              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,01              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,13)            | (0,53)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,02)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | 0,03              | 0,61              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | (0,34)            | (0,22)            |
| Zinsswaps                                                                              | 0,10              | 0,04              |
| Varianz-Swaps                                                                          | 0,03              | (0,00)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,10)            | 0,09              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,69              | (0,33)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (8,62)            | 0,93              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                |                |                          |                                   |
| <b>ASERBAIDDSCHAN</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |
| SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC   |                |                          |                                   |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026                   | \$ 300         | \$ 298                   | 2,11                              |
| <b>BRASILIEN</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |
| Banco do Brasil S.A.                           |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 29.07.2026                   | MXN 2.000      | 106                      | 0,75                              |
| Vale S.A.                                      |                |                          |                                   |
| 0,000 % (e)                                    | BRL 1.490      | 94                       | 0,66                              |
|                                                |                | 200                      | 1,41                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>      |                |                          |                                   |
| Oi S.A.                                        |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 30.12.2050                   | \$ 128         | 1                        | 0,01                              |
| Summe Brasilien                                |                | 201                      | 1,42                              |
| <b>KAIMANINSELN</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |
| Interoceania Finance Ltd.                      |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025                   | (b) 2          | 2                        | 0,01                              |
| <b>CHILE</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   |
| Bonos de la Tesorería de la Republica en Pesos |                |                          |                                   |
| 4,700 % fällig am 01.09.2030                   | CLP 30.000     | 31                       | 0,22                              |
| 5,000 % fällig am 01.10.2028                   | 20.000         | 22                       | 0,16                              |
| 5,000 % fällig am 01.03.2035                   | 15.000         | 15                       | 0,11                              |
| 5,800 % fällig am 01.10.2029                   | 275.000        | 300                      | 2,12                              |
| Summe Chile                                    |                | 368                      | 2,61                              |
| <b>CHINA</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |
| Flourish Century                               |                |                          |                                   |
| 6,600 % fällig am                              |                |                          |                                   |
| 04.02.2022 <sup>(h)</sup>                      | \$ 200         | 7                        | 0,05                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   |
| China Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 17.02.2032                   | CNY 30         | 5                        | 0,03                              |
| Summe China                                    |                | 12                       | 0,08                              |
| <b>KOLUMBIEN</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   |
| Colombia Government International Bond         |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 28.04.2028                   | COP 235.700    | 52                       | 0,37                              |
| 1,000 % fällig am 09.02.2033                   | 49.300         | 13                       | 0,09                              |
| Colombian TES                                  |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 30.06.2032                   | 48.900         | 9                        | 0,06                              |
| 7,250 % fällig am 18.10.2034                   | 225.000        | 40                       | 0,28                              |
| 11,000 % fällig am                             |                |                          |                                   |
| 22.08.2029                                     | 175.000        | 43                       | 0,30                              |
| 12,750 % fällig am                             |                |                          |                                   |
| 28.11.2040                                     | 91.600         | 22                       | 0,16                              |
| 13,250 % fällig am                             |                |                          |                                   |
| 09.02.2033                                     | 559.900        | 144                      | 1,02                              |
| Summe Kolumbien                                |                | 323                      | 2,28                              |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   |
| Czech Republic Government International Bond   |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 25.08.2028                   | CZK 800        | 37                       | 0,26                              |
| 5,000 % fällig am 30.09.2030                   | 500            | 25                       | 0,18                              |
| Summe Tschechische Republik                    |                | 62                       | 0,44                              |
| <b>DÄNEMARK</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   |
| Jyske Realkredit A/S                           |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                   | DKK 0          | 0                        | 0,00                              |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab           |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                   | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                   | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Nykredit Realkredit A/S                        |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                   | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053                   | 0              | 0                        | 0,00                              |

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 1,500 % fällig am 01.10.2052                     | DKK 0          | 0                        | 0,00                              |
| Realkredit Danmark A/S                           |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                     | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                     | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Summe Dänemark                                   |                | 0                        | 0,00                              |
| <b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik    |                |                          |                                   |
| 13,000 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 30.01.2026                                       | DOP 2.200      | 37                       | 0,26                              |
| Dominican Republic Government International Bond |                |                          |                                   |
| 10,500 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 15.03.2037                                       | 8.000          | 136                      | 0,96                              |
| 10,750 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 01.06.2036                                       | 16.000         | 277                      | 1,96                              |
| 13,625 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 03.02.2033                                       | 8.000          | 157                      | 1,11                              |
| 13,625 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 10.02.2034                                       | 200            | 4                        | 0,03                              |
| Summe Dominikanische Republik                    |                | 611                      | 4,32                              |
| <b>ECUADOR</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| Ecuador Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am                                |                |                          |                                   |
| 31.07.2030 (b)                                   | \$ 2           | 1                        | 0,01                              |
| 5,500 % fällig am 31.07.2035                     | 18             | 13                       | 0,09                              |
| 6,900 % fällig am 31.07.2030                     | 39             | 34                       | 0,24                              |
| Summe Ecuador                                    |                | 48                       | 0,34                              |
| <b>ÄGYPTEN</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| Egypt Government International Bond              |                |                          |                                   |
| 21,954 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 04.03.2028                                       | EGP 15.600     | 311                      | 2,20                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| Deutsche Bank AG                                 |                |                          |                                   |
| 8,010 % fällig am 18.07.2034                     | INR 18.000     | 218                      | 1,54                              |
| <b>GHANA</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| Ghana Government International Bond              |                |                          |                                   |
| 8,350 % fällig am 16.02.2027                     | GHS 920        | 76                       | 0,54                              |
| <b>UNGARN</b>                                    |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| Hungary Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 21.08.2030                     | HUF 9.400      | 23                       | 0,16                              |
| 4,750 % fällig am 24.11.2032                     | 5.600          | 15                       | 0,11                              |
| Summe Ungarn                                     |                | 38                       | 0,27                              |
| <b>IRLAND</b>                                    |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>          |                |                          |                                   |
| Black Diamond CLO DAC                            |                |                          |                                   |
| 3,096 % fällig am 20.01.2032                     | € 8            | 9                        | 0,06                              |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.   |                |                          |                                   |
| 2,893 % fällig am 15.11.2031                     | 50             | 59                       | 0,42                              |
|                                                  |                | 68                       | 0,48                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| Iridium Capital PLC                              |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 18.06.2029                     | € 250          | 318                      | 2,25                              |
| Summe Irland                                     |                | 386                      | 2,73                              |
| <b>ISRAEL</b>                                    |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                          |                |                          |                                   |
| Israel Government International Bond             |                |                          |                                   |
| 0,500 % fällig am 27.02.2026                     | ILS 100        | 29                       | 0,20                              |
| 1,750 % fällig am 31.08.2025                     | 4.500          | 1.332                    | 9,43                              |
| Summe Israel                                     |                | 1.361                    | 9,63                              |
| <b>LUXEMBURG</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAMMAKTIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| DrillCo Holding Lux S.A. (h)                     |                |                          |                                   |
|                                                  | 787            | 16                       | 0,11                              |
| Foresea Holding S.A. 'A'                         |                |                          |                                   |
|                                                  | 311            | 6                        | 0,05                              |
|                                                  | \$ 22          | 0,16                     |                                   |

| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |                |                          |                                   |
| FORESEA Holding S.A.                         |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 15.06.2030                 | \$ 14          | 13                       | 0,09                              |
| Summe Luxemburg                              |                | 35                       | 0,25                              |
| <b>MALAYSIA</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Malaysia Government International Bond       |                |                          |                                   |
| 3,899 % fällig am 16.11.2027                 | MYR 4.120      | 997                      | 7,06                              |
| <b>MEXIKO</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |                |                          |                                   |
| Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.      |                |                          |                                   |
| 8,790 % fällig am                            |                |                          |                                   |
| 09.12.2014 <sup>^</sup>                      | MXN 5.000      | 0                        | 0,00                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Mexico Government International Bond         |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am                            |                |                          |                                   |
| 03.12.2026 (d)                               | 1.751          | 91                       | 0,64                              |
| 5,850 % fällig am                            |                |                          |                                   |
| 02.07.2032 (a)                               | \$ 200         | 203                      | 1,44                              |
| 6,625 % fällig am                            |                |                          |                                   |
| 29.01.2038 (a)                               | 200            | 203                      | 1,44                              |
| 7,500 % fällig am 26.05.2033                 | MXN 2.000      | 97                       | 0,69                              |
| 8,500 % fällig am 02.03.2028                 | 7.000          | 372                      | 2,64                              |
| 8,500 % fällig am 01.03.2029                 | 2.000          | 106                      | 0,75                              |
| 8,500 % fällig am 18.11.2038                 | 300            | 14                       | 0,10                              |
|                                              |                | 1.086                    | 7,70                              |
| Summe Mexiko                                 |                | 1.086                    | 7,70                              |
| <b>NAMIBIA</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Namibia Government International Bond        |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 29.10.2025                 | \$ 200         | 199                      | 1,41                              |
| <b>PARAGUAY</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Paraguay Government International Bond       |                |                          |                                   |
| 7,900 % fällig am 09.02.2031                 | PYG 402.000    | 49                       | 0,34                              |
| 8,500 % fällig am 04.03.2035                 | 253.000        | 31                       | 0,22                              |
| Summe Paraguay                               |                | 80                       | 0,56                              |
| <b>PERU</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |                |                          |                                   |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |                |                          |                                   |
| 10,100 % fällig am                           |                |                          |                                   |
| 15.12.2043                                   | PEN 700        | 209                      | 1,48                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Peru Government International Bond           |                |                          |                                   |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032                 | 100            | 29                       | 0,21                              |
| 6,850 % fällig am 12.08.2035                 | 200            | 58                       | 0,41                              |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031                 | 240            | 74                       | 0,52                              |
|                                              |                | 161                      | 1,14                              |
| Summe Peru                                   |                | 370                      | 2,62                              |
| <b>PHILIPPINEN</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Philippines Government International Bond    |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 28.02.2029                 | PHP 21.660     | 391                      | 2,77                              |
| 6,375 % fällig am 28.04.2035                 | 5.000          | 89                       | 0,63                              |
| Summe Philippinen                            |                | 480                      | 3,40                              |
| <b>POLEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Poland Government International Bond         |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 25.04.2032                 | PLN 100        | 22                       | 0,15                              |
| 2,750 % fällig am 25.10.2029                 | 500            | 128                      | 0,91                              |
| 6,000 % fällig am 25.10.2033                 | 200            | 58                       | 0,41                              |
| Summe Polen                                  |                | 208                      | 1,47                              |
| <b>SERBIEN</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| Serbia Government International Bond         |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 27.07.2035                 | RSD 7.400      | 74                       | 0,53                              |

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SÜDAFRIKA</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| South Africa Government International Bond           |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 31.03.2036 ZAR                     | 1.100          | \$ 46                    | 0,33                              |
| 7,000 % fällig am 28.02.2031                         | 4.000          | 207                      | 1,47                              |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030                         | 1.900          | 105                      | 0,74                              |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037                         | 400            | 20                       | 0,14                              |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035                         | 1.900          | 100                      | 0,71                              |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026                        | 4.100          | 239                      | 1,69                              |
| Summe Südafrika                                      |                | 717                      | 5,08                              |
| <b>SÜDKOREA</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| South Korea Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 10.03.2027                         | 578.30         |                          |                                   |
|                                                      | KRW 0          | 430                      | 3,04                              |
| <b>SUPRANATIONAL</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Asian Development Bank                               |                |                          |                                   |
| 6,720 % fällig am 08.02.2028 INR                     | 13.240         | 156                      | 1,10                              |
| Asian Infrastructure Investment Bank                 |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 01.03.2029                         | 12.700         | 150                      | 1,06                              |
| 7,200 % fällig am 25.01.2029                         | 4.400          | 52                       | 0,37                              |
| Europäische Investitionsbank                         |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 15.11.2029 PLN                     | 800            | 203                      | 1,44                              |
| 6,950 % fällig am 01.03.2029 INR                     | 1.700          | 20                       | 0,14                              |
| Inter-American Development Bank                      |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 25.01.2029                         | 1.000          | 12                       | 0,09                              |
| Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung |                |                          |                                   |
| 7,050 % fällig am 22.07.2029                         | 3.000          | 36                       | 0,25                              |
| Summe Supranational                                  |                | 629                      | 4,45                              |
| <b>THAILAND</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| Thailand Government International Bond               |                |                          |                                   |
| 3,450 % fällig am 17.06.2043 THB                     | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>TÜRKIE</b>                                        |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| Turkey Government International Bond                 |                |                          |                                   |
| 37,000 % fällig am 18.02.2026 TRY                    | 5.700          | 140                      | 0,99                              |
| 49,053 % fällig am 20.05.2026                        | 270            | 7                        | 0,05                              |
| 49,053 % fällig am 19.08.2026                        | 200            | 5                        | 0,04                              |
| 49,053 % fällig am 17.05.2028                        | 7.100          | 173                      | 1,22                              |
| Summe Türkei                                         |                | 325                      | 2,30                              |
| <b>UGANDA</b>                                        |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| Republic of Uganda Government International Bond     |                |                          |                                   |
| 15,800 % fällig am 23.06.2039                        | UGX 188.400    | 48                       | 0,34                              |
| <b>UKRAINE</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| Ukraine Government International Bond                |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 01.02.2036                         | \$ 43          | 21                       | 0,15                              |
| <b>USA</b>                                           |                |                          |                                   |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>              |                |                          |                                   |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust           |                |                          |                                   |
| 5,620 % fällig am 25.01.2035                         | 34             | 35                       | 0,25                              |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                  |                |                          |                                   |
| 4,494 % fällig am 25.07.2045                         | 6              | 4                        | 0,03                              |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.    |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.02.2037                         | 25             | 24                       | 0,17                              |
| 5,559 % fällig am 25.11.2035                         | 41             | 41                       | 0,29                              |

| BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization LLC</b> |                |                          |                                   |
| 4,554 % fällig am 25.11.2036                                 | \$ 2           | \$ 1                     | 0,01                              |
| Fieldstone Mortgage Investment Trust                         |                |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.05.2036                                 | 62             | 46                       | 0,32                              |
| GSAMP Trust                                                  |                |                          |                                   |
| 4,524 % fällig am 25.01.2037                                 | 42             | 25                       | 0,18                              |
| Home Equity Asset Trust                                      |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.11.2032                                 | 4              | 4                        | 0,03                              |
| HSI Asset Loan Obligation Trust                              |                |                          |                                   |
| 4,554 % fällig am 25.12.2036                                 | 2              | 1                        | 0,01                              |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                       |                |                          |                                   |
| 4,494 % fällig am 25.05.2037                                 | 2              | 2                        | 0,01                              |
| 5,199 % fällig am 25.01.2035                                 | 23             | 23                       | 0,16                              |
| 5,229 % fällig am 25.03.2034                                 | 35             | 37                       | 0,26                              |
| Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust               |                |                          |                                   |
| 5,784 % fällig am 25.02.2033                                 | 9              | 9                        | 0,06                              |
| New Century Home Equity Loan Trust                           |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.05.2036                                 | 4              | 4                        | 0,03                              |
| Saxon Asset Securities Trust                                 |                |                          |                                   |
| 4,744 % fällig am 25.09.2037                                 | 8              | 7                        | 0,05                              |
| Soundview Home Loan Trust                                    |                |                          |                                   |
| 4,514 % fällig am 25.06.2037                                 | 4              | 2                        | 0,01                              |
| 4,604 % fällig am 25.07.2037                                 | 47             | 42                       | 0,30                              |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust        |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.10.2037                                 | 120            | 76                       | 0,54                              |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust                    |                |                          |                                   |
| 4,674 % fällig am 25.05.2037                                 | 43             | 39                       | 0,27                              |
| Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust            |                |                          |                                   |
| 4,129 % fällig am 25.10.2036                                 | 3              | 1                        | 0,01                              |
|                                                              |                | 423                      | 2,99                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                        |                |                          |                                   |
| Banc of America Mortgage Trust                               |                |                          |                                   |
| 5,855 % fällig am 25.07.2034                                 | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                  |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 25.05.2047                                 | 5              | 4                        | 0,03                              |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                     |                |                          |                                   |
| 4,037 % fällig am 25.04.2037                                 | 144            | 100                      | 0,71                              |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust                 |                |                          |                                   |
| 4,120 % fällig am 26.12.2046                                 | 10             | 8                        | 0,06                              |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                          |                |                          |                                   |
| 4,504 % fällig am 25.01.2037                                 | 2              | 1                        | 0,01                              |
| 4,783 % fällig am 25.09.2037                                 | 64             | 59                       | 0,42                              |
| First Horizon Mortgage Pass-Through Trust                    |                |                          |                                   |
| 6,431 % fällig am 25.08.2035                                 | 3              | 2                        | 0,01                              |
| GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates  |                |                          |                                   |
| 7,182 % fällig am 25.10.2033                                 | 1              | 1                        | 0,01                              |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                                  |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 25.11.2037                                 | 53             | 44                       | 0,31                              |
| 4,588 % fällig am 25.12.2034                                 | 2              | 2                        | 0,01                              |
| 5,074 % fällig am 25.07.2045                                 | 24             | 19                       | 0,13                              |
| Lehman XS Trust                                              |                |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.09.2046                                 | 90             | 80                       | 0,57                              |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust                       |                |                          |                                   |
| 5,397 % fällig am 25.10.2037                                 | 40             | 32                       | 0,23                              |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust        |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036                                 | 1              | 1                        | 0,01                              |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                |                |                          |                                   |
| 4,257 % fällig am 25.02.2037                                 | 6              | 5                        | 0,03                              |
|                                                              |                | 358                      | 2,54                              |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| Fannie Mae                                                   |                |                          |                                   |
| 5,355 % fällig am 25.01.2055                                 | 187            | 187                      | 1,32                              |
| Summe USA                                                    |                | 968                      | 6,85                              |

| BESCHREIBUNG                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>VENEZUELA</b>                                              |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                       |                |                          |                                   |
| Venezuela Government International Bond                       |                |                          |                                   |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^                                | \$ 100         | \$ 15                    | 0,11                              |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^                                | 100            | 20                       | 0,14                              |
| Summe Venezuela                                               |                | 35                       | 0,25                              |
| <b>SAMBIA</b>                                                 |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                       |                |                          |                                   |
| Zambia Government International Bond                          |                |                          |                                   |
| 23,000 % fällig am 22.01.2031                                 | ZMW 500        | 26                       | 0,18                              |
| <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>EGYPT TREASURY BILLS</b>                                   |                |                          |                                   |
| 27,448 % fällig am 12.08.2025 (b)(c)                          | EGP 1.500      | 29                       | 0,20                              |
| 27,500 % fällig am 23.09.2025 (b)(c)                          | 1.150          | 22                       | 0,16                              |
|                                                               |                | 51                       | 0,36                              |
| <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>                                 |                |                          |                                   |
| 22,542 % fällig am 25.11.2025 (b)(c)                          | NGN 33.658     | 20                       | 0,14                              |
| 23,031 % fällig am 09.12.2025 (b)(c)                          | 24.157         | 14                       | 0,10                              |
| 26,488 % fällig am 19.08.2025 (b)(c)                          | 63.829         | 40                       | 0,28                              |
| 26,510 % fällig am 11.11.2025 (b)(c)                          | 90.745         | 54                       | 0,38                              |
| 26,691 % fällig am 11.11.2025 (b)(c)                          | 29.573         | 17                       | 0,12                              |
| 30,612 % fällig am 29.06.2026 (b)(c)                          | 201.92         | 106                      | 0,75                              |
| 31,337 % fällig am 07.10.2025 (b)(c)                          | 1.000          | 1                        | 0,01                              |
| 31,577 % fällig am 07.10.2025 (b)(c)                          | 76.600         | 47                       | 0,33                              |
| 33,126 % fällig am 12.06.2026 (b)(c)                          | 72.818         | 38                       | 0,27                              |
| 33,156 % fällig am 11.06.2026 (b)(c)                          | 72.884         | 39                       | 0,28                              |
|                                                               |                | 376                      | 2,66                              |
| <b>U.S. TREASURY BILLS</b>                                    |                |                          |                                   |
| 4,160 % fällig am 01.07.2025 (b)(c)                           | \$ 800         | 800                      | 5,66                              |
| Summe kurzfristige Instrumente                                |                | 1.227                    | 8,68                              |
| Summe Übertragbare Wertpapiere                                | \$ 12.270      |                          | 86,84                             |
| <b>AKTIEN</b>                                                 |                |                          |                                   |
| <b>INVESTMENTFONDS</b>                                        |                |                          |                                   |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                      |                |                          |                                   |
| PIMCO Select Funds                                            |                |                          |                                   |
| plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)        | 1.441          | 15                       | 0,11                              |
| PIMCO Specialty Funds                                         |                |                          |                                   |
| Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)                    | 15.103         | 221                      | 1,56                              |
|                                                               |                | 236                      | 1,67                              |
| <b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>                                 |                |                          |                                   |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f) | 10.900         | 1.091                    | 7,72                              |
| Summe Investmentfonds                                         | \$ 1.327       |                          | 9,39                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025          | 6                       | \$ 12                                           | 0,08                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025          | 1                       | (3)                                             | (0,02)                  |
|                                                                |       |                  |                         | <b>\$ 9</b>                                     | <b>0,06</b>             |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | <b>\$ 9</b>                                     | <b>0,06</b>             |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 5,699 %            | 18.06.2030            | INR 3.100       | \$ 0                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000              | 17.09.2030            | 42.590          | (4)                                             | (0,03)                  |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000              | 17.09.2035            | 1.230           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,008              | 05.12.2029            | 8.750           | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,621              | 20.12.2028            | 7.699           | (2)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750              | 19.03.2030            | SGD 960         | 39                                              | 0,27                    |
| Erhalt                                      | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,000              | 18.09.2026            | 2.890           | (43)                                            | (0,30)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 3,322              | 20.12.2028            | 194             | (8)                                             | (0,05)                  |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day THB-THOR Compounded-OIS     | 2,000              | 17.09.2030            | THB 3.980       | (2)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2030            | \$ 100          | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2030            | 800             | 7                                               | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2034            | 100             | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 20.12.2053            | 65              | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 19.03.2055            | 130             | 2                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2055            | 290             | (5)                                             | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.12.2033            | 70              | (5)                                             | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.06.2054            | 450             | 6                                               | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 18.12.2054            | 430             | (41)                                            | (0,28)                  |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 17.09.2055            | 50              | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 20.06.2031            | 50              | 0                                               | (0,00)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 20.06.2031            | 900             | (27)                                            | (0,19)                  |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 17.09.2035            | 230             | (2)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 18.12.2036            | 50              | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,920              | 27.02.2026            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,086              | 13.01.2055            | 100             | (3)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,100              | 31.03.2027            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 9,783              | 04.01.2027            | BRL 2.300       | 31                                              | 0,22                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,795              | 04.01.2027            | 800             | (11)                                            | (0,07)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,832              | 04.01.2027            | 400             | (5)                                             | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 9,840              | 04.01.2027            | 600             | (8)                                             | (0,06)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 9,840              | 04.01.2027            | 1.600           | 13                                              | 0,09                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 9,842              | 04.01.2027            | 900             | (11)                                            | (0,08)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 9,946              | 04.01.2027            | 400             | 6                                               | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,044             | 02.01.2029            | 800             | (10)                                            | (0,07)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,164             | 02.01.2026            | 300             | 3                                               | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,225             | 04.01.2027            | 300             | (3)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,235             | 04.01.2027            | 300             | (3)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,529             | 02.01.2026            | 1.000           | 7                                               | 0,05                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,565             | 04.01.2027            | 300             | (3)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,671             | 04.01.2027            | 1.600           | 15                                              | 0,10                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,691             | 02.01.2026            | 1.600           | (10)                                            | (0,07)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,768             | 04.01.2027            | 500             | 5                                               | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,792             | 04.01.2027            | 3.900           | (37)                                            | (0,26)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,872             | 04.01.2027            | 800             | 7                                               | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,880             | 04.01.2027            | 1.300           | 11                                              | 0,08                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 10,943             | 04.01.2027            | 700             | 6                                               | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 10,980             | 04.01.2027            | 1.000           | (8)                                             | (0,06)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,133             | 04.01.2027            | 700             | 5                                               | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,280             | 02.01.2026            | 90              | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,490             | 02.01.2029            | 800             | (5)                                             | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,513             | 04.01.2027            | 500             | 3                                               | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,523             | 02.01.2029            | 1.300           | (8)                                             | (0,06)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,560             | 04.01.2027            | 500             | 3                                               | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,575             | 03.01.2028            | 300             | 2                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,590             | 03.01.2028            | 200             | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                    | 11,695             | 03.01.2028            | 900             | (5)                                             | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 11,928             | 02.01.2029            | 1.100           | 5                                               | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 12,243             | 02.01.2029            | 200             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 12,569             | 02.01.2029            | 200             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 12,760             | 02.01.2029            | 1.100           | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                    | 13,270             | 02.01.2029            | 600             | (1)                                             | 0,00                    |



| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) |      | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,291 %           | 02.01.2029            | BRL             | 700                                             | \$ 1 | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,320             | 02.01.2029            |                 | 100                                             | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,405             | 02.01.2029            |                 | 700                                             | 1    | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,425             | 02.01.2029            |                 | 200                                             | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,430             | 02.01.2029            |                 | 400                                             | 1    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,500             | 02.01.2029            |                 | 200                                             | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,518             | 02.01.2029            |                 | 400                                             | (1)  | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,545             | 02.01.2029            |                 | 400                                             | (1)  | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,589             | 02.01.2029            |                 | 900                                             | (2)  | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,844             | 02.01.2029            |                 | 200                                             | (1)  | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,923             | 02.01.2029            |                 | 200                                             | (1)  | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,927             | 04.01.2027            |                 | 2.200                                           | (1)  | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,998             | 02.01.2029            |                 | 800                                             | 3    | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,020             | 04.01.2027            |                 | 1.000                                           | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,026             | 02.01.2029            |                 | 200                                             | (1)  | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,087             | 02.01.2029            |                 | 500                                             | (2)  | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,185             | 02.01.2029            |                 | 700                                             | 3    | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,213             | 02.01.2029            |                 | 300                                             | 1    | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,245             | 02.01.2029            |                 | 400                                             | (2)  | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 14,570             | 02.01.2029            |                 | 300                                             | 2    | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 15,065             | 02.01.2029            |                 | 500                                             | 4    | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 15,130             | 02.01.2029            |                 | 300                                             | 3    | 0,02                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500              | 18.06.2030            | CNY             | 830                                             | 0    | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500              | 17.09.2030            |                 | 760                                             | (1)  | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 2,405              | 20.12.2028            |                 | 2.782                                           | (4)  | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,040              | 13.01.2031            | COP             | 1.002.000                                       | 54   | 0,37                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,200              | 18.09.2030            |                 | 514.560                                         | (11) | (0,08)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,400              | 09.09.2029            |                 | 633.800                                         | (7)  | (0,05)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,410              | 09.08.2028            |                 | 296.600                                         | 2    | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,520              | 13.08.2031            |                 | 81.100                                          | 1    | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,530              | 02.01.2029            |                 | 129.000                                         | (1)  | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,540              | 09.08.2031            |                 | 300.000                                         | 5    | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,580              | 09.08.2031            |                 | 278.300                                         | 4    | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,650              | 12.08.2031            |                 | 72.700                                          | 1    | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,705              | 26.03.2031            |                 | 548.600                                         | 6    | 0,05                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,770              | 18.07.2029            |                 | 1.043.500                                       | (7)  | (0,05)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,800              | 30.06.2032            |                 | 112.500                                         | 2    | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,805              | 22.10.2029            |                 | 775.500                                         | (2)  | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,960              | 01.09.2028            |                 | 540.900                                         | (1)  | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,970              | 28.04.2028            |                 | 234.900                                         | 1    | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,990              | 25.11.2034            |                 | 284.900                                         | 5    | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,020              | 04.12.2030            |                 | 235.500                                         | 2    | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,150              | 28.04.2028            |                 | 208.000                                         | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,190              | 13.06.2029            |                 | 451.760                                         | (1)  | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,215              | 14.11.2028            |                 | 356.300                                         | (2)  | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,250              | 18.06.2030            |                 | 37.000                                          | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,280              | 26.12.2027            |                 | 265.900                                         | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,350              | 18.06.2030            |                 | 164.400                                         | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,430              | 15.05.2030            |                 | 55.800                                          | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,498              | 16.05.2030            |                 | 243.000                                         | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,565              | 30.12.2027            |                 | 166.500                                         | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,620              | 10.04.2026            |                 | 43.240                                          | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,690              | 26.12.2031            |                 | 232.000                                         | (1)  | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,710              | 17.09.2030            |                 | 116.400                                         | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,728              | 10.06.2030            |                 | 65.000                                          | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,755              | 17.09.2030            |                 | 24.200                                          | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,770              | 10.06.2030            |                 | 196.000                                         | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,790              | 10.06.2030            |                 | 130.000                                         | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,800              | 18.06.2030            |                 | 189.000                                         | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,045              | 30.12.2031            |                 | 28.600                                          | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,050              | 02.05.2033            |                 | 35.360                                          | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,055              | 26.08.2026            |                 | 30.730                                          | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,470              | 01.07.2025            |                 | 285.000                                         | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 9,525              | 18.06.2035            |                 | 67.000                                          | 0    | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,368              | 18.06.2030            | KRW             | 33.400                                          | 0    | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,500              | 17.09.2027            |                 | 322.570                                         | 1    | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 3-Month KRW-KORIBOR            | 2,500              | 17.09.2030            |                 | 224.610                                         | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month KRW-KORIBOR            | 3,820              | 20.12.2028            |                 | 61.900                                          | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,021              | 07.10.2029            | SEK             | 2.000                                           | (1)  | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month SEK-STIBOR             | 2,298              | 07.10.2029            |                 | 2.000                                           | 4    | 0,03                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 6,067              | 21.12.2026            | ZAR             | 3.100                                           | 1    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 6,635              | 04.02.2027            |                 | 3.290                                           | (8)  | (0,05)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,205              | 22.04.2027            |                 | 1.200                                           | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,210              | 22.04.2027            |                 | 900                                             | 0    | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,370              | 26.08.2030            |                 | 1.000                                           | 0    | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,560              | 22.09.2030            |                 | 980                                             | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,565              | 22.03.2026            |                 | 2.900                                           | (1)  | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,570              | 27.05.2030            |                 | 500                                             | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,650              | 20.06.2030            |                 | 1.974                                           | (1)  | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,700              | 18.06.2030            |                 | 3.970                                           | (2)  | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,775              | 18.03.2030            |                 | 2.000                                           | (2)  | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,790              | 31.01.2030            |                 | 400                                             | 0    | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR              | 7,810              | 27.03.2030            |                 | 600                                             | (1)  | 0,00                    |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt     | variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 7,810 %            | 20.06.2030            | ZAR 768         | \$ 1                                            | 0,01                    |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 7,860              | 18.06.2030            | 2.000           | 3                                               | 0,02                    |
| Erhalt                 | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,100              | 05.06.2026            | 2.100           | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,185              | 31.07.2026            | 3.500           | (3)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,195              | 21.12.2026            | 3.900           | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                 | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,210              | 21.12.2026            | 1.600           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,355              | 31.01.2030            | 1.500           | (2)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,410              | 13.07.2025            | 1.000           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,440              | 02.11.2028            | 1.600           | (2)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,500              | 17.10.2027            | 8.760           | 16                                              | 0,11                    |
| Erhalt                 | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,650              | 31.01.2030            | 200             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,735              | 31.01.2030            | 3.100           | 5                                               | 0,04                    |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 8,872              | 24.07.2034            | 600             | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                 | 3-Month ZAR-JIBAR     |                        | 9,330              | 09.02.2034            | 1.900           | (3)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,540              | 01.10.2028            | CLP 60.800      | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,555              | 08.10.2029            | 26.700          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,640              | 01.10.2028            | 245.000         | (1)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,690              | 18.06.2030            | 17.700          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,695              | 14.02.2029            | 21.800          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,715              | 18.06.2030            | 24.300          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,730              | 16.10.2029            | 51.000          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,750              | 10.04.2030            | 60.500          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,775              | 23.02.2026            | 298.300         | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,800              | 13.02.2026            | 54.800          | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,920              | 13.02.2034            | 13.100          | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,940              | 01.10.2028            | 40.000          | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,970              | 18.06.2032            | 12.500          | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 4,980              | 01.10.2028            | 40.000          | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,000              | 19.07.2029            | 201.100         | 3                                               | 0,02                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,030              | 23.02.2034            | 70.300          | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,050              | 19.07.2029            | 52.900          | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,070              | 24.06.2031            | 110.600         | 2                                               | 0,01                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,120              | 18.06.2035            | 9.100           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,165              | 01.08.2029            | 39.690          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,240              | 01.09.2030            | 37.210          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,250              | 20.03.2028            | 95.100          | (2)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(1)</sup>  | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,250              | 13.05.2033            | 22.500          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,280              | 28.02.2030            | 76.000          | (2)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,313              | 25.04.2034            | 33.900          | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,350              | 01.09.2030            | 37.500          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,360              | 28.06.2026            | 298.000         | 3                                               | 0,02                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,360              | 26.04.2034            | 21.100          | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,400              | 01.04.2033            | 22.100          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,400              | 16.11.2033            | 17.400          | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,400              | 03.07.2034            | 31.700          | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,440              | 28.02.2035            | 43.000          | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,450              | 28.06.2034            | 73.000          | (3)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,470              | 01.09.2030            | 50.000          | (2)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,500              | 13.11.2028            | 78.200          | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,550              | 05.06.2028            | 81.300          | 2                                               | 0,02                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,631              | 23.08.2028            | 56.700          | (2)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,690              | 01.09.2030            | 2.400           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup> | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,750              | 13.05.2034            | 23.000          | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,780              | 03.10.2028            | 19.400          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,790              | 06.10.2033            | 18.000          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,855              | 05.10.2033            | 46.000          | (3)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,870              | 11.10.2033            | 18.200          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,920              | 02.10.2028            | 36.000          | (2)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,940              | 20.10.2033            | 8.000           | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 5,990              | 20.10.2033            | 76.260          | (6)                                             | (0,04)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 6,146              | 30.10.2032            | 125.400         | (11)                                            | (0,08)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 6,235              | 26.10.2033            | 37.300          | (4)                                             | (0,03)                  |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 6,370              | 29.06.2029            | 39.000          | 3                                               | 0,02                    |
| Zahlung                | 6-Month CLP-CHILIBOR  |                        | 6,380              | 03.06.2027            | 116.000         | 5                                               | 0,04                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,130              | 09.04.2030            | CZK 2.200       | 2                                               | 0,01                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,258              | 05.05.2030            | 400             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,290              | 30.04.2030            | 400             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,315              | 06.05.2030            | 500             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,325              | 06.05.2030            | 1.300           | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,363              | 29.05.2030            | 1.400           | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,410              | 14.05.2030            | 1.000           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,480              | 15.07.2029            | 3.100           | (2)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,534              | 21.03.2029            | 1.900           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,554              | 11.06.2030            | 2.000           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,580              | 25.10.2029            | 6.400           | 4                                               | 0,03                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,605              | 12.07.2029            | 3.400           | (3)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,645              | 01.02.2029            | 4.000           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 3,765              | 09.01.2029            | 1.400           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 4,130              | 03.06.2029            | 500             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 4,388              | 15.11.2028            | 7.400           | 7                                               | 0,05                    |
| Erhalt                 | 6-Month CZK-PRIBOR    |                        | 4,611              | 06.06.2028            | 4.390           | (6)                                             | (0,04)                  |
| Zahlung <sup>(1)</sup> | 6-Month EUR-EURIBOR   |                        | 2,250              | 17.09.2035            | € 80            | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                        | 3,300              | 03.10.2033            | 200             | (6)                                             | (0,04)                  |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 5,890 %            | 09.05.2030            | HUF 17.500      | \$ (1)                                          | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,090              | 21.10.2029            | 30.000          | 4                                               | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 6,210              | 26.06.2030            | 67.300          | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 6,250              | 09.04.2030            | 8.200           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,270              | 16.06.2030            | 17.300          | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,363              | 31.01.2030            | 24.400          | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,392              | 11.03.2030            | 18.200          | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 6,450              | 06.06.2029            | 3.250           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 6,580              | 16.05.2035            | 3.200           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 6,650              | 13.03.2030            | 7.900           | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month HUF-BBR         | 7,330              | 06.11.2028            | 37.800          | 3                                               | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 6-Month HUF-BBR         | 7,840              | 07.02.2033            | 6.600           | (2)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 0,980              | 09.06.2030            | 300             | 12                                              | 0,08                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 2,950              | 13.12.2026            | 1.500           | 3                                               | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,015              | 17.04.2030            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,019              | 18.04.2030            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,049              | 18.04.2030            | 200             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,075              | 07.03.2027            | 800             | 3                                               | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,259              | 08.08.2029            | 500             | (2)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,313              | 25.07.2029            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,320              | 09.03.2027            | 150             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,328              | 25.07.2029            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,388              | 09.08.2029            | 500             | (3)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,415              | 12.08.2029            | 200             | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,560              | 06.11.2028            | 640             | (6)                                             | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,660              | 19.02.2029            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,680              | 25.04.2029            | 600             | 3                                               | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,730              | 16.02.2029            | 200             | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,735              | 09.10.2028            | 300             | (3)                                             | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,750              | 02.08.2029            | 100             | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,794              | 25.10.2029            | 400             | (5)                                             | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,810              | 16.02.2029            | 200             | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,820              | 25.07.2029            | 500             | (5)                                             | (0,03)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,855              | 10.02.2030            | 600             | 3                                               | 0,02                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,865              | 18.07.2029            | 100             | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,923              | 22.03.2029            | 300             | 2                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,000              | 25.04.2029            | 100             | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,010              | 25.07.2029            | 100             | (1)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,105              | 12.07.2029            | 600             | 9                                               | 0,07                    |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,340              | 28.03.2027            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,430              | 16.03.2028            | 570             | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,520              | 20.03.2026            | 500             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 5,620              | 21.03.2026            | 300             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,582              | 02.04.2030            | 1.200           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,720              | 01.04.2030            | 300             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,748              | 02.04.2030            | 200             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,750              | 01.04.2030            | 1.200           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,753              | 16.04.2030            | 1.500           | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,760              | 01.03.2029            | 5.400           | 2                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,775              | 01.04.2030            | 400             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 7,775              | 12.06.2030            | 800             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,790              | 01.04.2030            | 200             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 7,790              | 12.06.2030            | 1.800           | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 7,936              | 12.06.2030            | 2.700           | (2)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,075              | 17.03.2027            | 700             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,250              | 01.03.2029            | 900             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,267              | 28.02.2030            | 3.500           | (5)                                             | (0,03)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,270              | 07.03.2035            | 200             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,280              | 01.03.2029            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,285              | 06.06.2035            | 500             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,330              | 01.03.2029            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,365              | 28.03.2035            | 2.200           | 2                                               | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,480              | 13.03.2030            | 3.100           | (5)                                             | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,545              | 23.11.2034            | 400             | 1                                               | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,550              | 22.02.2035            | 800             | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,595              | 13.03.2030            | 2.100           | (4)                                             | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,640              | 07.03.2035            | 1.000           | (2)                                             | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,650              | 31.01.2030            | 1.900           | 4                                               | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,655              | 07.03.2035            | 1.000           | (2)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,665              | 11.12.2029            | 1.200           | (3)                                             | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,740              | 07.03.2035            | 2.600           | (6)                                             | (0,04)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,800              | 12.12.2029            | 2.200           | 5                                               | 0,03                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,873              | 23.11.2034            | 500             | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,950              | 17.12.2029            | 300             | (1)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,131              | 11.12.2034            | 500             | (2)                                             | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,180              | 08.01.2030            | 2.600           | (7)                                             | (0,05)                  |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 9,295              | 29.12.2025            | 500             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,295              | 30.10.2028            | 500             | 1                                               | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 9,370              | 21.12.2034            | 1.000           | 5                                               | 0,04                    |
|                                                |                         |                    |                       |                 | \$ (60)                                         | (0,42)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                    |                       |                 | \$ (60)                                         | (0,42)                  |

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|--------|------------|----------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,650     | 11.03.2026     | 121                        | \$ 1   | \$ 1       | 0,01                 |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000    | 27.08.2025     | 69                         | 0      | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus COP  | COP 3.825,000  | 29.08.2025     | 8                          | 1      | 1          | 0,00                 |
| GLM        | Put - OTC USD versus JPY  | ¥ 135,000      | 19.08.2025     | 66                         | 6      | 4          | 0,03                 |
|            | Put - OTC USD versus MXN  | MXN 18,500     | 10.07.2025     | 8                          | 2      | 0          | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC USD versus MXN  | 19,250         | 19.11.2025     | 174                        | 3      | 5          | 0,04                 |
|            | Put - OTC USD versus ZAR  | ZAR 17,650     | 08.08.2025     | 141                        | 2      | 1          | 0,01                 |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,750     | 09.12.2025     | 115                        | 1      | 1          | 0,01                 |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,700         | 16.12.2025     | 69                         | 0      | 1          | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000    | 27.08.2025     | 72                         | 0      | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus BRL  | BRL 5,660      | 27.08.2025     | 177                        | 3      | 6          | 0,04                 |
|            | Put - OTC USD versus COP  | COP 3.825,000  | 04.09.2025     | 8                          | 1      | 1          | 0,01                 |
|            | Call - OTC USD versus ILS | ILS 3,880      | 04.09.2025     | 8                          | 1      | 0          | 0,00                 |
|            |                           |                |                |                            | \$ 21  | \$ 21      | 0,15                 |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|--------|------------|----------------------|
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Zahlung                           | 3,850 %        | 10.07.2025     | 400                        | \$ 1   | \$ 1       | 0,01                 |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|----------------------|
| GLM        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 53,500     | 11.12.2025     | 148                        | \$ (5)  | \$ (4)     | (0,03)               |
| JPM        | Put - OTC USD versus MXN  | MXN 18,250     | 19.11.2025     | 174                        | (1)     | (1)        | (0,01)               |
|            | Put - OTC USD versus ZAR  | ZAR 17,250     | 08.08.2025     | 282                        | (2)     | (1)        | (0,01)               |
| MYI        | Put - OTC USD versus BRL  | BRL 5,400      | 27.08.2025     | 177                        | (1)     | (1)        | (0,01)               |
|            | Call - OTC USD versus BRL | 6,050          | 27.08.2025     | 177                        | (2)     | (1)        | 0,00                 |
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750     | 11.08.2025     | 22                         | (1)     | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750         | 11.08.2025     | 22                         | 0       | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 40,575         | 19.08.2025     | 33                         | (1)     | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 52,725         | 19.08.2025     | 33                         | (1)     | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600         | 12.11.2025     | 30                         | (1)     | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900         | 12.11.2025     | 30                         | (1)     | (1)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,635         | 07.01.2026     | 93                         | (3)     | (1)        | (0,01)               |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 07.01.2026     | 93                         | (2)     | (3)        | (0,02)               |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 42,800         | 08.01.2026     | 138                        | (5)     | (1)        | (0,01)               |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,750         | 08.01.2026     | 138                        | (3)     | (4)        | (0,03)               |
|            |                           |                |                |                            | \$ (29) | \$ (18)    | (0,13)               |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,270 %        | 26.08.2025     | 2.200                      | \$ (1)  | \$ (1)     | 0,00                 |
| DUB        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 04.07.2025     | 900                        | (1)     | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ILS-TELBOR      | Erhalt                            | 3,550          | 10.07.2025     | 400                        | 1       | 0          | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month ZAR-JIBAR       | Erhalt                            | 7,430          | 22.09.2025     | 2.330                      | (1)     | (1)        | (0,01)               |
|            |                                      |                         |                                   |                |                |                            | \$ (2)  | \$ (2)     | (0,01)               |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Markt-wert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond       | (1,000) %                   | 20.06.2029        | \$ 200                     | \$ 4                                  | \$ (3)                                   | \$ 1       | 0,01                 |
| BPS        | Brazil Government International Bond       | (1,000)                     | 20.12.2029        | 100                        | 3                                     | (1)                                      | 2          | 0,01                 |
| BRC        | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2033        | 100                        | 0                                     | 0                                        | 0          | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.06.2034        | 100                        | (1)                                   | 1                                        | 0          | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | (1,000)                     | 20.12.2034        | 30                         | 0                                     | 0                                        | 0          | 0,00                 |
|            |                                            |                             |                   |                            | \$ 6                                  | \$ (3)                                   | \$ 3       | 0,02                 |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BPS        | Mexico Government International Bond       | 1,000 %                     | 20.12.2025       | \$ 50                     | \$ 1                                  | \$ (1)                                   | \$ 0      | 0,00                 |
|            | Romania Government International Bond      | 1,000                       | 20.12.2025       | 25                        | 0                                     | 0                                        | 0         | 0,00                 |
| BRC        | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000                       | 20.06.2030       | 300                       | 4                                     | 1                                        | 5         | 0,03                 |
| GST        | Israel Government International Bond       | 1,000                       | 20.12.2025       | 100                       | 0                                     | 0                                        | 0         | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 3,750                       | 24.12.2025       | 100                       | 0                                     | 0                                        | 0         | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 4,850                       | 07.05.2026       | 96                        | 0                                     | 1                                        | 1         | 0,01                 |
|            |                                            |                             |                  |                           | \$ 5                                  | \$ 1                                     | \$ 6      | 0,04                 |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                         | Zahlung                                                                                                          | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| DUB        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day KRW-SOFR abzgl. 0,510 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung                | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2028       | KRW 29.980                    | \$ 22                          | \$ 0                                  | \$ 0                                     | \$ 0      | 0,00                 |
| GLM        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS zzgl. 0,639 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030       | INR 3.500                     | 40                             | 1                                     | 0                                        | 1         | 0,01                 |
|            | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day KRW-SOFR abzgl. 0,500 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung                | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2028       | KRW 69.380                    | 51                             | 0                                     | 0                                        | 0         | 0,00                 |
|            | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung  | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung             | 17.09.2030       | \$ 210                        | PHP 12.071                     | (1)                                   | (2)                                      | (3)       | (0,02)               |
| JPM        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS zzgl. 0,486 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung  | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month PHP-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung             | 17.09.2030       | 4                             | 220                            | 0                                     | 0                                        | 0         | 0,00                 |
|            |                                                                                                                                |                                                                                                                  |                  |                               |                                | \$ 0                                  | \$ (2)                                   | \$ (2)    | (0,01)               |

**ZINSSWAPS**

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------------|------------------------|-----------------|------------------|------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,868 %         | 20.12.2028       | MYR 231    | \$ 0                                  | \$ 2                                     | \$ 2      | 0,01                 |
| BPS        | Erhalt                                      | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,500           | 18.06.2030       | 400        | (1)                                   | 0                                        | (1)       | (0,01)               |
|            | Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,500           | 17.09.2030       | 160        | 0                                     | (1)                                      | (1)       | 0,00                 |
|            | Erhalt                                      | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,750           | 18.09.2034       | 120        | 0                                     | (1)                                      | (1)       | (0,01)               |
| CBK        | Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,500           | 17.09.2030       | 2.060      | (6)                                   | (1)                                      | (7)       | (0,05)               |
| GLM        | Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR   | 3,265           | 14.06.2029       | CLP 11.100 | 0                                     | (1)                                      | (1)       | (0,01)               |
| GST        | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,868           | 20.12.2028       | MYR 900    | 3                                     | 2                                        | 5         | 0,04                 |
| SCX        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX  | 1,500           | 18.03.2031       | CNY 40     | 0                                     | 0                                        | 0         | 0,00                 |
|            |                                             |                        |                 |                  |            | \$ (4)                                | \$ 0                                     | \$ (4)    | (0,03)               |

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

## VOLATILITÄTSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>Volatilität | Referenzeinheit                                              | Volatilität<br>Ausübungskurs | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------------------------|-----------------------|-----------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Zahlung                           | USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 6,850 %                      | 11.09.2025            | \$ 1            | \$ 0                                         | \$ 3                                            | \$ 3           | 0,02                         |
|            | Zahlung                           | USD versus CNH 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 7,000                        | 11.12.2025            | 1               | 0                                            | 2                                               | 2              | 0,02                         |
| JPM        | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,600                        | 24.11.2025            | 1               | 0                                            | (1)                                             | (1)            | (0,01)                       |
|            | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,725                        | 26.11.2025            | 0               | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
| SCX        | Erhalt                            | USD versus INR 1-Year ATM Realized Volatility <sup>(1)</sup> | 3,450                        | 21.11.2025            | 0               | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
|            |                                   |                                                              |                              |                       |                 | \$ 0                                         | \$ 4                                            | \$ 4           | 0,03                         |

<sup>(1)</sup> Varianz-Swap.

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | €                      | 148                      | \$ 173                           | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 5                        | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 14                       | AUD 21                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 8                        | CNH 59                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | AUD                    | 21                       | \$ 14                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 415                      | CNH 2.986                        | 3                                  | 3                                                    | 0,02                    |
|            | 08.2025               |                        | 174                      | € 148                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 3                        | NZD 5                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PHP                    | 5.259                    | \$ 94                            | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 188                      | 33                               | (2)                                | (2)                                                  | (0,01)                  |
| BOA        | 07.2025               | DOP                    | 5.021                    | 84                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 135                      | 153                              | (5)                                | (5)                                                  | (0,04)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 500.928                  | 31                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 58                       | 45                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 16                       | KRW 22.316                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 10                       | MYR 44                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 15                       | PLN 54                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 3.030                    | \$ 171                           | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | CZK                    | 2.506                    | 119                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    | 599                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 08.2025               | HUF                    | 8.491                    | € 21                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 102                      | CNH 734                          | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               |                        | 45                       | SGD 57                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 83.170                   | \$ 20                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 548                      | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 16                       | MXN 305                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 02.2026               | TRY                    | 7.812                    | \$ 158                           | (4)                                | (4)                                                  | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | BRL                    | 9                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 16.600                   | 115                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 10.903                   | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | PEN                    | 91                       | 25                               | (1)                                | (1)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | TRY                    | 3.557                    | 89                               | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 41                       | CNY 295                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 7                        | € 6                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 56                       | IDR 915.091                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | RON 16                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 172                      | THB 5.583                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 127                      | TWD 4.115                        | 15                                 | 15                                                   | 0,11                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 520                      | \$ 71                            | (1)                                | (1)                                                  | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | CZK                    | 315                      | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 08.2025               | TRY                    | 1.884                    | 45                               | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 1.135                    | 38                               | (2)                                | (2)                                                  | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 235                      | CNH 1.681                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 46                       | CZK 1.019                        | 3                                  | 3                                                    | 0,02                    |
|            | 08.2025               |                        | 43                       | INR 3.697                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 238                      | TWD 7.479                        | 23                                 | 23                                                   | 0,16                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 16.521                   | \$ 4                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | ILS                    | 3.280                    | 896                              | (80)                               | (80)                                                 | (0,57)                  |
|            | 10.2025               | €                      | 69                       | 74                               | (7)                                | (7)                                                  | (0,05)                  |
|            | 05.2026               | \$                     | 45                       | KWD 14                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 06.2026               |                        | 138                      | 42                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 06.2027               |                        | 22                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 05.2029               | KWD                    | 93                       | \$ 321                           | 14                                 | 14                                                   | 0,10                    |
|            | 07.2029               |                        | 11                       | 38                               | 2                                  | 2                                                    | 0,01                    |
|            | 05.2030               |                        | 38                       | 130                              | 5                                  | 5                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               | €                      | 22                       | 25                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ILS                    | 270                      | 80                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 3.198                    | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | MYR                    | 68                       | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 106                      | 29                               | (1)                                | (1)                                                  | (0,01)                  |
| BRC        | 07.2025               | SGD                    | 18                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 2.244                    | 55                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 14                       | £ 11                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 161                      | ILS 561                          | 5                                  | 5                                                    | 0,04                    |





# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| GLM        | 07.2025               | \$                     | 96 PLN                   | 355                              | \$ 2                               | \$ 2                                                 | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 12 SGD                   | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 3 CHF                    | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 224 CNH                  | 1.603                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 71 INR                   | 6.102                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 28 ¥                     | 4.052                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 36 SGD                   | 46                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 1.592 \$                 | 84                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 674 BRL                  | 3.780                            | 8                                  | 8                                                    | 0,06                    |
|            | 09.2025               |                        | 655 MXN                  | 12.763                           | 16                                 | 16                                                   | 0,10                    |
|            | 09.2025               |                        | 0 PEN                    | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | 53 \$                    | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 380                      | 68                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | DOP                    | 6.694                    | 113                              | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 18                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 8.530                    | 261                              | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 31 CNY                   | 224                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 47 IDR                   | 763.877                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 262 THB                  | 8.545                            | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 8 TRY                    | 332                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 647 \$                   | 36                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DOP                    | 3.508                    | 59                               | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025               | HUF                    | 17.751                   | 52                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 319 HUF                  | 115.591                          | 20                                 | 20                                                   | 0,14                    |
|            | 08.2025               |                        | 14 SGD                   | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | DOP                    | 21.535 \$                | 346                              | 3                                  | (12)                                                 | (0,06)                  |
|            | 09.2025               | MYR                    | 1.878                    | 444                              | 0                                  | (3)                                                  | (0,02)                  |
|            | 09.2025               | PEN                    | 91                       | 25                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PHP                    | 26.334                   | 451                              | 0                                  | (16)                                                 | (0,11)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 264 DOP                  | 17.035                           | 17                                 | 17                                                   | 0,11                    |
| IND        | 10.2025               | EGP                    | 1.812 \$                 | 32                               | 0                                  | (3)                                                  | (0,02)                  |
|            | 11.2025               | DOP                    | 1.812                    | 30                               | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 12.2025               | TRY                    | 793                      | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2026               | ARS                    | 5.348                    | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 523                      | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | PHP                    | 4.943                    | 88                               | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
| MBC        | 07.2025               | BRL                    | 388                      | 65                               | 0                                  | (6)                                                  | (0,04)                  |
|            | 07.2025               | CNY                    | 272                      | 38                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 358.981                  | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 38                       | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 265                      | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 65 BRL                   | 388                              | 6                                  | 6                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 8 CNH                    | 57                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 66 CNY                   | 471                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 89 KRW                   | 121.698                          | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 3 NZD                    | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 629 PHP                  | 35.147                           | 0                                  | (6)                                                  | (0,05)                  |
|            | 07.2025               |                        | 274 PLN                  | 1.019                            | 8                                  | 8                                                    | 0,05                    |
|            | 07.2025               |                        | 313 SGD                  | 402                              | 3                                  | 3                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 127 TWD                  | 4.146                            | 15                                 | 15                                                   | 0,11                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 774 \$                   | 43                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 123                      | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 620                      | 19                               | 0                                  | (2)                                                  | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 235 CNH                  | 1.678                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 48 INR                   | 4.124                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 29 SGD                   | 38                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 85 TWD                   | 2.774                            | 12                                 | 12                                                   | 0,08                    |
|            | 09.2025               | COP                    | 264.837 \$               | 63                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|            | 10.2025               | EGP                    | 1.521                    | 27                               | 0                                  | (3)                                                  | (0,02)                  |
|            | 11.2025               | GHS                    | 42                       | 3                                | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2026               | EGP                    | 1.494                    | 24                               | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | CAD                    | 17                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 15                       | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 10.300                   | 72                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 1.004                    | 777                              | 0                                  | (13)                                                 | (0,08)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 13 CAD                   | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 113 CLP                  | 105.497                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 4 CNH                    | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 406 €                    | 349                              | 4                                  | 4                                                    | 0,03                    |
|            | 07.2025               |                        | 79 IDR                   | 1.289.450                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 19 ¥                     | 2.730                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 355 PHP                  | 19.842                           | 0                                  | (4)                                                  | (0,03)                  |
|            | 07.2025               |                        | 72 PLN                   | 271                              | 3                                  | 3                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025               |                        | 753 SGD                  | 966                              | 5                                  | 5                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025               |                        | 6 THB                    | 200                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 71 TWD                   | 2.301                            | 9                                  | 9                                                    | 0,06                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 173 \$                   | 24                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 458                      | 14                               | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 13 CAD                   | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 4 CNH                    | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 777 SGD                  | 1.002                            | 12                                 | 12                                                   | 0,09                    |
|            | 08.2025               |                        | 90 TWD                   | 2.948                            | 12                                 | 12                                                   | 0,09                    |

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MYI                              | 09.2025               | MXN                    | 398                      | \$ 21                            | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|                                  | 10.2025               | EGP                    | 1.520                    | 27                               | 0                                  | (3)                                                  | (0,02)                  |
|                                  | 12.2025               | CNH                    | 5.689                    | 788                              | 0                                  | (18)                                                 | (0,12)                  |
|                                  | 02.2026               | ILS                    | 100                      | 27                               | 0                                  | (3)                                                  | (0,02)                  |
|                                  | 07.2025               | CLP                    | 105.497                  | 111                              | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025               | ¥                      | 1.287                    | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | NOK                    | 39                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 93                       | ¥ 13.431                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 1                        | PLN 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | ZAR                    | 1.119                    | \$ 62                            | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 08.2025               | HUF                    | 10.345                   | 30                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 08.2025               | ¥                      | 13.008                   | 90                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 228                      | CNH 1.633                        | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 49                       | CNY 347                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 18                       | HUF 6.266                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 9                        | ¥ 1.283                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 4                        | NOK 39                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | COP                    | 79.173                   | \$ 19                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | MXN                    | 895                      | 47                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | \$                     | 111                      | CLP 105.497                      | 2                                  | 2                                                    | 0,01                    |
|                                  | 09.2025               |                        | 41                       | COP 170.814                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               |                        | 26                       | MXN 499                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 10.2025               | EGP                    | 854                      | \$ 15                            | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 10.2025               | \$                     | 16                       | EGP 891                          | 2                                  | 2                                                    | 0,01                    |
|                                  | 12.2025               | CZK                    | 429                      | € 17                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RYL                              | 10.2026               | \$                     | 23                       | AZN 42                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 10.2027               |                        | 46                       | 85                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 11                       | CNH 82                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | COP                    | 59.554                   | \$ 14                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX                              | 07.2025               | GHS                    | 361                      | 27                               | 0                                  | (7)                                                  | (0,05)                  |
|                                  | 07.2025               | KRW                    | 20.298                   | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | PEN                    | 160                      | 44                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025               | SGD                    | 200                      | 155                              | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                  |
| SOG                              | 07.2025               | TWD                    | 687                      | 24                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 218                      | IDR 3.552.576                    | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 1                        | ILS 4                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 17                       | ¥ 2.473                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 57                       | PEN 204                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 222                      | THB 7.231                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 40                       | TWD 1.198                        | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               | CNH                    | 804                      | \$ 112                           | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 08.2025               | ¥                      | 2.464                    | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 470                      | CNH 3.366                        | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 50                       | INR 4.275                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 155                      | SGD 200                          | 2                                  | 2                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 117                      | TWD 3.667                        | 10                                 | 10                                                   | 0,07                    |
|                                  | 09.2025               | PHP                    | 33.288                   | \$ 597                           | 8                                  | 8                                                    | 0,05                    |
|                                  | 10.2025               | \$                     | 12                       | NGN 21.880                       | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 12.2025               | UGX                    | 37.407                   | \$ 10                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | GHS                    | 217                      | 16                               | 0                                  | (5)                                                  | (0,03)                  |
|                                  | 07.2025               | ¥                      | 4.172                    | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 19                       | € 16                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 152                      | RON 666                          | 2                                  | 2                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               | TWD                    | 4.554                    | \$ 139                           | 0                                  | (20)                                                 | (0,14)                  |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 15                       | HUF 5.456                        | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 0                        | INR 25                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 29                       | ¥ 4.157                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB                              | 07.2025               | £                      | 11                       | \$ 14                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 12.2025               | \$                     | 26                       | PEN 95                           | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
| UAG                              | 07.2025               | CLP                    | 159.327                  | \$ 170                           | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 11                       | ILS 41                           | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 2                        | ¥ 245                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 4                        | NOK 43                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025               |                        | 115                      | RON 506                          | 2                                  | 2                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               | CNH                    | 520                      | \$ 73                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 10                       | TRY 450                          | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  | 08.2025               |                        | 19                       | TWD 626                          | 3                                  | 3                                                    | 0,02                    |
|                                  | 09.2025               | COP                    | 177.375                  | \$ 43                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 09.2025               | MXN                    | 1.291                    | 67                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                  |
|                                  | 09.2025               | \$                     | 130                      | COP 536.316                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 11.2025               |                        | 5                        | TRY 240                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 12.2025               | €                      | 17                       | CZK 429                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 01.2026               | \$                     | 45                       | TRY 2.145                        | 1                                  | 1                                                    | 0,01                    |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 460                           | \$ (364)                           | \$ 96                                                | 0,67                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 105                                               | 0,74                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                |     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|-----------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b>                                  |     |                |                          |                              |
| Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC<br>9,350 % fällig am 06.08.2022 ^   | RUB | 33.000         | \$ 13                    | 0,09                         |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g) | \$  | 200            | 12                       | 0,09                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                   |     |                | \$ 25                    | 0,18                         |
| Summe Anlagen                                                               |     |                | \$ 13.676                | 96,79                        |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                 |     |                | \$ 454                   | 3,21                         |
| Nettvermögen                                                                |     |                | \$ 14.130                | 100,00                       |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 1,45 %):

| Emittentenbeschreibung                       | Kauf-<br>datum | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Nettvermögens |
|----------------------------------------------|----------------|--------|----------------|------------------------|
| DrillCo Holding Lux S.A.                     | 08.06.2023     | \$ 16  | \$ 16          | 0,11                   |
| Florish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022 | 25.08.2021     | 197    | 7              | 0,05                   |
|                                              |                | \$ 213 | \$ 23          | 0,16                   |

Barmittel in Höhe von 219 USD (31. Dezember 2024: 329 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 12.022                                                       | \$ 248                                                       | \$ 12.270 |
| Investmentfonds                     | 1.327                                                                       | 0                                                               | 0                                                            | 1.327     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 0                                                                           | 54                                                              | 0                                                            | 54        |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 0                                                               | 25                                                           | 25        |
| Summen                              | \$ 1.327                                                                    | \$ 12.076                                                       | \$ 273                                                       | \$ 13.676 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 12.009                                                       | \$ 351                                                       | \$ 12.360 |
| Investmentfonds               | 228                                                                         | 1.091                                                           | 0                                                            | 1.319     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (2)                                                                         | (41)                                                            | 0                                                            | (43)      |
| Summen                        | \$ 226                                                                      | \$ 13.059                                                       | \$ 351                                                       | \$ 13.636 |

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

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

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 4                                | \$ 0                                  | \$ 4                                | \$ 6                                | \$ 0                                  | \$ 6                                |
| BOA        | (5)                                 | 0                                     | (5)                                 | 15                                  | 0                                     | 15                                  |
| BPS        | (32)                                | 0                                     | (32)                                | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 |
| BRC        | 44                                  | 0                                     | 44                                  | 6                                   | 0                                     | 6                                   |
| BSH        | 9                                   | 0                                     | 9                                   | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 |
| CBK        | (4)                                 | 0                                     | (4)                                 | (109)                               | 0                                     | (109)                               |
| DUB        | (8)                                 | 0                                     | (8)                                 | (45)                                | 0                                     | (45)                                |
| FAR        | 55                                  | 0                                     | 55                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| GLM        | 9                                   | 0                                     | 9                                   | (49)                                | 0                                     | (49)                                |
| GST        | 6                                   | 0                                     | 6                                   | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 |
| IND        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| JPM        | 28                                  | 0                                     | 28                                  | (8)                                 | 0                                     | (8)                                 |
| MBC        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | 11                                  | 0                                     | 11                                  |
| MYC        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | 5                                   | 0                                     | 5                                   |
| MYI        | 8                                   | 0                                     | 8                                   | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 |
| RBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (2)                                 | 0                                     | (2)                                 |
| SCX        | 14                                  | 0                                     | 14                                  | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 |
| SOG        | (22)                                | 0                                     | (22)                                | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 |
| SSB        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| UAG        | (4)                                 | 0                                     | (4)                                 | (10)                                | 0                                     | (10)                                |

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

**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 62,27             | 61,14             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 14,01             | 8,02              |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,14              | 0,15              |
| Investmentfonds                                                        | 8,26              | 7,40              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,07              | 0,01              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 2,67              | 3,18              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 3,14              | 2,13              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,15              | k. A.             |
| Sonstige Aktiva                                                        | 9,29              | 17,97             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert   | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Aserbaidshan            | 2,11              | 1,91              |
| Brasilien               | 1,42              | 1,15              |
| Kaimaninseln            | 0,01              | 0,02              |
| Chile                   | 2,61              | 2,78              |
| China                   | 0,08              | 0,05              |
| Kolumbien               | 2,28              | 0,59              |
| Tschechische Republik   | 0,44              | 0,29              |
| Dänemark                | 0,00              | 0,00              |
| Dominikanische Republik | 4,32              | 2,69              |
| Ecuador                 | 0,34              | 0,51              |
| Ägypten                 | 2,20              | k. A.             |
| Deutschland             | 1,54              | 0,62              |
| Ghana                   | 0,54              | 0,29              |
| Ungarn                  | 0,27              | k. A.             |
| Indien                  | k. A.             | 0,75              |
| Indonesien              | k. A.             | 1,27              |
| Irland                  | 2,73              | 2,43              |
| Israel                  | 9,63              | 8,45              |
| Elfenbeinküste          | k. A.             | 0,63              |
| Libanon                 | k. A.             | 0,08              |
| Luxemburg               | 0,25              | 0,34              |
| Malaysia                | 7,06              | 0,27              |
| Mexiko                  | 7,70              | 3,43              |
| Mongolei                | k. A.             | 1,30              |
| Namibia                 | 1,41              | 1,26              |
| Oman                    | k. A.             | 1,27              |
| Panama                  | k. A.             | 1,27              |
| Paraguay                | 0,56              | 0,33              |
| Peru                    | 2,62              | 3,00              |
| Philippinen             | 3,40              | 2,98              |
| Polen                   | 1,47              | 1,44              |
| Serbien                 | 0,53              | k. A.             |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

(Forts.)

30. Juni 2025

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Singapur                                                                               | k. A.             | 0,10              |
| Südafrika                                                                              | 5,08              | 5,80              |
| Südkorea                                                                               | 3,04              | 1,29              |
| Supranational                                                                          | 4,45              | 4,44              |
| Thailand                                                                               | 0,00              | 0,02              |
| Türkei                                                                                 | 2,30              | 1,87              |
| Uganda                                                                                 | 0,34              | k. A.             |
| Ukraine                                                                                | 0,15              | 0,47              |
| Großbritannien                                                                         | k. A.             | 1,30              |
| USA                                                                                    | 6,85              | 7,87              |
| Uruguay                                                                                | k. A.             | 0,35              |
| Venezuela                                                                              | 0,25              | 0,19              |
| Sambia                                                                                 | 0,18              | 0,27              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 8,68              | 13,57             |
| Investmentfonds                                                                        | 9,39              | 8,42              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,06              | (0,07)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Zinsswaps                                                                              | (0,42)            | 1,03              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,15              | 0,13              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,01              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,13)            | (0,29)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | 0,02              | 0,19              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,04              | (0,04)            |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | (0,01)            | 0,01              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,03)            | 0,01              |
| Volatilitätsswaps                                                                      | 0,03              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | 0,67              | (1,25)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,18              | k. A.             |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | 3,21              | 12,92             |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                              | PARI   | MARKT-<br>WERT | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI   | MARKT-<br>WERT | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI   | MARKT-<br>WERT | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|--------|----------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|--------|----------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|--------|----------------|-----------------------------------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                  | (000S) | (000S)         |                                   |                                               | (000S) | (000S)         |                                   |                                               | (000S) | (000S)         |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |        |                |                                   |                                               |        |                |                                   |                                               |        |                |                                   |
| Ahlstrom Oyj                              |        |                |                                   | Castellum Helsinki Finance Holding Abp        |        |                |                                   | 5,700 % fällig am 01.07.2034                  | \$     | 350            | 0,07                              |
| TBD % fällig am 23.05.2030                | \$     | 500            | 0,10                              | 0,875 % fällig am 17.09.2029                  | €      | 300            | 0,06                              | Howard Hughes Corp.                           |        |                |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |        |                |                                   |                                               |        |                |                                   | 4,375 % fällig am 01.02.2031 (h)              |        | 700            | 0,12                              |
| <b>BANKEN UND FINANZEN</b>                |        |                |                                   |                                               |        |                |                                   | HSBC Holdings PLC                             |        |                |                                   |
| ABN AMRO Bank NV                          |        |                |                                   | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. |        |                |                                   | 3,973 % fällig am 22.05.2030                  |        | 200            | 0,04                              |
| 2,470 % fällig am 13.12.2029              |        |                |                                   | SICAV-SIF-Pan European Core Fund              |        |                |                                   | 4,583 % fällig am 19.06.2029                  |        | 500            | 0,09                              |
| 6,375 % fällig am 22.09.2034 (e)(f)       | €      | 1.000          | 0,23                              | 0,900 % fällig am 12.10.2029                  |        | 500            | 0,10                              | 6,254 % fällig am 09.03.2034                  |        | 600            | 0,12                              |
| Acef Holding S.C.A.                       |        |                |                                   | Citigroup, Inc.                               |        |                |                                   | Hudson Pacific Properties LP                  |        |                |                                   |
| 0,750 % fällig am 14.06.2028              |        | 100            | 0,02                              | 2,976 % fällig am 05.11.2030                  | \$     | 200            | 0,04                              | 3,950 % fällig am 01.11.2027                  |        | 250            | 0,05                              |
| 1,250 % fällig am 26.04.2030              |        | 300            | 0,06                              | CNP Assurances SACA                           |        |                |                                   | 5,950 % fällig am 15.02.2028                  |        | 150            | 0,03                              |
| AIB Group PLC                             |        |                |                                   | 1,250 % fällig am 27.01.2029                  | €      | 400            | 0,08                              | ING Groep NV                                  |        |                |                                   |
| 2,875 % fällig am 30.05.2031              |        | 400            | 0,09                              | Commerzbank AG                                |        |                |                                   | 4,125 % fällig am 24.08.2033                  | €      | 300            | 0,07                              |
| 5,250 % fällig am 23.10.2031              |        | 500            | 0,12                              | 3,625 % fällig am 14.01.2032                  |        | 900            | 0,20                              | 4,250 % fällig am 16.05.2031 (e)(f)           | \$     | 200            | 0,03                              |
| 6,000 % fällig am 14.07.2031 (e)(f)       |        | 1.100          | 0,24                              | Cooperative Rabobank UA                       |        |                |                                   | 4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(f)           |        | 700            | 0,12                              |
| 6,608 % fällig am 13.09.2029              | \$     | 500            | 0,10                              | 1,004 % fällig am 24.09.2026                  | \$     | 900            | 0,17                              | 5,525 % fällig am 25.03.2036                  |        | 500            | 0,10                              |
| 7,125 % fällig am 30.10.2029 (e)(f)       | €      | 200            | 0,05                              | COPT Defense Properties LP                    |        |                |                                   | Intesa Sanpaolo SpA                           |        |                |                                   |
| Ally Financial, Inc.                      |        |                |                                   | 2,000 % fällig am 15.01.2029                  |        | 100            | 0,02                              | 4,198 % fällig am 01.06.2032                  |        | 200            | 0,03                              |
| 2,200 % fällig am 02.11.2028              | \$     | 600            | 0,10                              | CoStar Group, Inc.                            |        |                |                                   | 6,625 % fällig am 31.05.2033                  | £      | 600            | 0,17                              |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031              |        | 350            | 0,08                              | 2,800 % fällig am 15.07.2030                  |        | 900            | 0,15                              | 6,625 % fällig am 20.06.2033                  | \$     | 1.000          | 0,21                              |
| American Express Co.                      |        |                |                                   | CPI Property Group S.A.                       |        |                |                                   | JAB Holdings BV                               |        |                |                                   |
| 4,050 % fällig am 03.05.2029              |        | 500            | 0,09                              | 1,750 % fällig am 14.01.2030                  | €      | 300            | 0,06                              | 5,000 % fällig am 12.06.2033                  | €      | 200            | 0,05                              |
| American Homes 4 Rent LP                  |        |                |                                   | 4,000 % fällig am 22.01.2028                  | £      | 300            | 0,07                              | Jones Lang LaSalle, Inc.                      |        |                |                                   |
| 5,500 % fällig am 01.02.2034              |        | 550            | 0,11                              | Credit Agricole Assurances S.A.               |        |                |                                   | 6,875 % fällig am 01.12.2028                  | \$     | 1.300          | 0,26                              |
| American Tower Corp.                      |        |                |                                   | 1,500 % fällig am 06.10.2031                  | €      | 200            | 0,04                              | KBC Group NV                                  |        |                |                                   |
| 3,100 % fällig am 15.06.2050              |        | 200            | 0,02                              | Credit Agricole S.A.                          |        |                |                                   | 5,796 % fällig am 19.01.2029                  |        | 1.250          | 0,24                              |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029              |        | 150            | 0,03                              | 5,875 % fällig am 23.03.2035 (e)(f)           |        | 1.100          | 0,24                              | 6,250 % fällig am 17.09.2031 (e)(f)           | €      | 1.000          | 0,23                              |
| Asian Development Bank                    |        |                |                                   | Crown Castle, Inc.                            |        |                |                                   | 8,000 % fällig am 05.09.2028 (e)(f)           |        | 200            | 0,05                              |
| 6,720 % fällig am 08.02.2028              | INR    | 229.100        | 0,51                              | 3,100 % fällig am 15.11.2029                  | \$     | 550            | 0,10                              | Kilroy Realty LP                              |        |                |                                   |
| ASR Nederland NV                          |        |                |                                   | CTP NV                                        |        |                |                                   | 2,500 % fällig am 15.11.2032                  | \$     | 640            | 0,10                              |
| 6,500 % fällig am 02.04.2035 (e)(f)       | €      | 500            | 0,11                              | 1,250 % fällig am 21.06.2029                  | €      | 400            | 0,08                              | 2,650 % fällig am 15.11.2033                  |        | 200            | 0,03                              |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.      |        |                |                                   | 1,500 % fällig am 27.09.2031                  |        | 400            | 0,08                              | Kookmin Bank                                  |        |                |                                   |
| 8,375 % fällig am 21.06.2028 (e)(f)       |        | 1.000          | 0,25                              | Deutsche Bank AG                              |        |                |                                   | 2,500 % fällig am 04.11.2030 (f)              |        | 200            | 0,03                              |
| Banco BTG Pactual S.A.                    |        |                |                                   | 3,035 % fällig am 28.05.2032                  | \$     | 350            | 0,06                              | Lendlease Finance Ltd.                        |        |                |                                   |
| 2,750 % fällig am 11.01.2026              | \$     | 600            | 0,11                              | 3,742 % fällig am 07.01.2033                  |        | 500            | 0,09                              | 3,400 % fällig am 27.10.2027                  | AUD    | 1.100          | 0,13                              |
| Banco de Sabadell S.A.                    |        |                |                                   | 6,720 % fällig am 18.01.2029                  |        | 500            | 0,10                              | Logicor Financing SARL                        |        |                |                                   |
| 0,875 % fällig am 16.06.2028              | €      | 100            | 0,02                              | 7,079 % fällig am 10.02.2034 (h)              |        | 500            | 0,10                              | 2,000 % fällig am 17.01.2034                  | €      | 500            | 0,09                              |
| Banco Mercantil del Norte S.A.            |        |                |                                   | Digital Dutch Finco BV                        |        |                |                                   | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.          |        |                |                                   |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(f)       | \$     | 200            | 0,04                              | 0,625 % fällig am 15.07.2025                  | €      | 600            | 0,13                              | 2,494 % fällig am 13.10.2032                  | \$     | 700            | 0,12                              |
| Banco Santander S.A.                      |        |                |                                   | 1,000 % fällig am 15.01.2032                  |        | 500            | 0,09                              | 5,475 % fällig am 22.02.2031                  |        | 800            | 0,16                              |
| 5,552 % fällig am 14.03.2028              |        | 200            | 0,04                              | EQT AB                                        |        |                |                                   | Mizuho Financial Group, Inc.                  |        |                |                                   |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT               |        |                |                                   | 0,875 % fällig am 14.05.2031                  |        | 600            | 0,12                              | 2,201 % fällig am 10.07.2031                  |        | 800            | 0,13                              |
| 2,000 % fällig am 19.04.2026              |        | 200            | 0,04                              | 2,375 % fällig am 06.04.2028                  |        | 700            | 0,15                              | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG |        |                |                                   |
| Bank of America Corp.                     |        |                |                                   | Equinix, Inc.                                 |        |                |                                   | in Muenchen                                   |        |                |                                   |
| 2,687 % fällig am 22.04.2032              |        | 1.100          | 0,19                              | 2,500 % fällig am 15.05.2031                  | \$     | 50             | 0,01                              | 5,875 % fällig am 23.05.2042                  |        | 400            | 0,08                              |
| 6,204 % fällig am 10.11.2028              |        | 1.700          | 0,34                              | 3,900 % fällig am 15.04.2032                  |        | 260            | 0,05                              | Nationstar Mortgage Holdings, Inc.            |        |                |                                   |
| Bank of Ireland Group PLC                 |        |                |                                   | Equitable Financial Life Global Funding       |        |                |                                   | 5,750 % fällig am 15.11.2031                  |        | 300            | 0,06                              |
| 4,875 % fällig am 16.07.2028              | €      | 500            | 0,12                              | 1,800 % fällig am 08.03.2028                  |        | 700            | 0,12                              | NE Property BV                                |        |                |                                   |
| 7,594 % fällig am 06.12.2032              | £      | 400            | 0,11                              | Erste Group Bank AG                           |        |                |                                   | 2,000 % fällig am 20.01.2030                  | €      | 200            | 0,04                              |
| Banque Ouest Africaine de Developpement   |        |                |                                   | 7,000 % fällig am 15.04.2031 (e)(f)           | €      | 1.000          | 0,24                              | 3,375 % fällig am 14.07.2027                  |        | 300            | 0,07                              |
| 2,750 % fällig am 22.01.2033              | €      | 470            | 0,09                              | First American Financial Corp.                |        |                |                                   | New Immo Holding S.A.                         |        |                |                                   |
| Barclays PLC                              |        |                |                                   | 2,400 % fällig am 15.08.2031                  | \$     | 600            | 0,10                              | 2,750 % fällig am 26.11.2026                  |        | 200            | 0,04                              |
| 5,501 % fällig am 09.08.2028              | \$     | 500            | 0,10                              | Ford Motor Credit Co. LLC                     |        |                |                                   | Nexi SpA                                      |        |                |                                   |
| 9,250 % fällig am 15.09.2028 (e)(f)       | £      | 800            | 0,22                              | 5,918 % fällig am 20.03.2028                  |        | 1.300          | 0,25                              | 1,625 % fällig am 30.04.2026                  |        | 259            | 0,06                              |
| BNP Paribas S.A.                          |        |                |                                   | 6,050 % fällig am 05.03.2031                  |        | 1.700          | 0,32                              | NN Group NV                                   |        |                |                                   |
| 1,675 % fällig am 30.06.2027              | \$     | 400            | 0,07                              | FS KKR Capital Corp.                          |        |                |                                   | 5,750 % fällig am 11.09.2034 (e)(f)           |        | 400            | 0,09                              |
| 4,625 % fällig am 25.02.2031 (e)(f)       |        | 200            | 0,03                              | 3,125 % fällig am 12.10.2028                  |        | 450            | 0,08                              | Nomura Holdings, Inc.                         |        |                |                                   |
| 7,375 % fällig am 11.06.2030 (e)(f)       | €      | 1.000          | 0,25                              | Globalworth Real Estate Investments Ltd.      |        |                |                                   | 2,172 % fällig am 14.07.2028                  | \$     | 600            | 0,11                              |
| 7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(f)       | \$     | 800            | 0,16                              | 6,250 % fällig am 31.03.2030                  | €      | 179            | 0,04                              | Norinchukin Bank                              |        |                |                                   |
| Boston Properties LP                      |        |                |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                     |        |                |                                   | 5,094 % fällig am 16.10.2029                  |        | 1.700          | 0,33                              |
| BPCE S.A.                                 |        |                |                                   | Goodman U.S. Finance Five LLC                 |        |                |                                   | OneMain Finance Corp.                         |        |                |                                   |
| 2,045 % fällig am 19.10.2027              |        | 300            | 0,05                              | 4,625 % fällig am 04.05.2032                  |        | 700            | 0,13                              | 3,500 % fällig am 15.01.2027                  |        | 826            | 0,15                              |
| 5,748 % fällig am 19.07.2033              |        | 600            | 0,12                              | Goodman U.S. Finance Three LLC                |        |                |                                   | 7,125 % fällig am 15.11.2031 (h)              |        | 700            | 0,14                              |
| Brookfield Finance UK PLC                 |        |                |                                   | 3,700 % fällig am 15.03.2028                  |        | 500            | 0,09                              | PennyMac Financial Services, Inc.             |        |                |                                   |
| 2,340 % fällig am 30.01.2032              |        | 550            | 0,09                              | GPT Wholesale Office Fund                     |        |                |                                   | 5,750 % fällig am 15.09.2031                  |        | 700            | 0,13                              |
| Burford Capital Global Finance LLC        |        |                |                                   | 3,222 % fällig am 05.11.2031                  | AUD    | 400            | 0,04                              | Prologis LP                                   |        |                |                                   |
| 9,250 % fällig am 01.07.2031 (h)          |        | 400            | 0,08                              | Grainger PLC                                  |        |                |                                   | 4,200 % fällig am 15.02.2033                  | CAD    | 1.900          | 0,27                              |
| CaixaBank S.A.                            |        |                |                                   | 3,000 % fällig am 03.07.2030                  | £      | 100            | 0,02                              | Protective Life Global Funding                |        |                |                                   |
| 3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(f)       | €      | 200            | 0,04                              | Hanwha Life Insurance Co. Ltd.                |        |                |                                   | 1,737 % fällig am 21.09.2030                  | \$     | 800            | 0,13                              |
| 3,750 % fällig am 07.09.2029              |        | 300            | 0,07                              | 3,379 % fällig am 04.02.2032                  | \$     | 300            | 0,06                              | Rayonier LP                                   |        |                |                                   |
| 5,875 % fällig am 09.10.2027 (e)(f)       |        | 1.000          | 0,23                              | HAT Holdings LLC                              |        |                |                                   | 2,750 % fällig am 17.05.2031                  |        | 600            | 0,10                              |
| 6,208 % fällig am 18.01.2029              | \$     | 500            | 0,10                              | 3,375 % fällig am 15.06.2026                  |        | 610            | 0,11                              | Reinsurance Group of America, Inc.            |        |                |                                   |
|                                           |        |                |                                   | 3,750 % fällig am 15.09.2030                  |        | 230            | 0,04                              | 6,000 % fällig am 15.09.2033                  |        | 200            | 0,04                              |
|                                           |        |                |                                   | 8,000 % fällig am 15.06.2027                  |        | 570            | 0,11                              | Rexford Industrial Realty LP                  |        |                |                                   |
|                                           |        |                |                                   | Host Hotels & Resorts LP                      |        |                |                                   | 2,150 % fällig am 01.09.2031                  |        | 100            | 0,02                              |
|                                           |        |                |                                   | 2,900 % fällig am 15.12.2031                  |        | 100            | 0,02                              | Santander Holdings USA, Inc.                  |        |                |                                   |
|                                           |        |                |                                   | 3,375 % fällig am 15.12.2029                  |        | 800            | 0,14                              | 5,807 % fällig am 09.09.2026                  |        | 800            | 0,15                              |
|                                           |        |                |                                   | 3,500 % fällig am 15.09.2030                  |        | 240            | 0,04                              |                                               |        |                |                                   |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Santander UK Group Holdings PLC</b>     |                |                          |                                   | <b>Hilton Domestic Operating Co., Inc.</b>     |                |                          |                                   | <b>Weir Group, Inc.</b>                          |                |                          |                                   |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028               | \$ 200         | \$ 196                   | 0,04                              | 3,625 % fällig am 15.02.2032                   | \$ 380         | \$ 344                   | 0,06                              | 5,350 % fällig am 06.05.2030                     | \$ 1.000       | \$ 1.014                 | 0,19                              |
| 6,534 % fällig am 10.01.2029               | 400            | 418                      | 0,08                              | 4,000 % fällig am 01.05.2031                   | 200            | 188                      | 0,04                              | <b>Western Digital Corp.</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Segro Capital SARL</b>                  |                |                          |                                   | <b>Hologic, Inc.</b>                           |                |                          |                                   | 3,100 % fällig am 01.02.2032                     | 500            | 443                      | 0,08                              |
| 1,875 % fällig am 23.03.2030               | € 250          | 277                      | 0,05                              | 3,250 % fällig am 15.02.2029                   | 500            | 477                      | 0,09                              | <b>XPLR Infrastructure Operating Partners LP</b> |                |                          |                                   |
| <b>Sirius Real Estate Ltd.</b>             |                |                          |                                   | <b>InterContinental Hotels Group PLC</b>       |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 15.01.2029                     | 1.000          | 1.026                    | 0,19                              |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026               | 400            | 461                      | 0,09                              | 3,375 % fällig am 08.10.2028                   | £ 500          | 657                      | 0,12                              | <b>ZF Europe Finance BV</b>                      |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 24.11.2028               | 200            | 223                      | 0,04                              | <b>International Distribution Services PLC</b> |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 31.01.2029                     | € 400          | 443                      | 0,08                              |
| <b>SLM Corp.</b>                           |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 14.09.2030                   | 600            | 865                      | 0,16                              | <b>ZF North America Capital, Inc.</b>            |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 02.11.2026               | \$ 2.200       | 2.158                    | 0,41                              | <b>JDE Peet's NV</b>                           |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 14.04.2028                     | \$ 150         | 151                      | 0,03                              |
| <b>Sofina S.A.</b>                         |                |                          |                                   | 2,250 % fällig am 24.09.2031                   | \$ 600         | 512                      | 0,10                              |                                                  |                | 36.347                   | 6,88                              |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028               | € 200          | 218                      | 0,04                              | 4,125 % fällig am 23.01.2030                   | € 800          | 978                      | 0,18                              |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Standard Chartered PLC</b>              |                |                          |                                   | <b>Lenovo Group Ltd.</b>                       |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032               | \$ 500         | 441                      | 0,08                              | 3,421 % fällig am 02.11.2030                   | \$ 400         | 373                      | 0,07                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 3,603 % fällig am 12.01.2033               | 200            | 182                      | 0,03                              | <b>Liberty Utilities Finance GP</b>            |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 6,301 % fällig am 09.01.2029               | 700            | 728                      | 0,14                              | 2,050 % fällig am 15.09.2030                   | 300            | 264                      | 0,05                              |                                                  |                |                          |                                   |
| <b>UBS Group AG</b>                        |                |                          |                                   | <b>Lindblad Expeditions LLC</b>                |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(f)        | 200            | 177                      | 0,03                              | 6,750 % fällig am 15.02.2027                   | 300            | 302                      | 0,06                              |                                                  |                |                          |                                   |
| 5,959 % fällig am 12.01.2034               | 400            | 421                      | 0,08                              | <b>Marks &amp; Spencer PLC</b>                 |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 13.11.2028 (e)(f)        | 1.000          | 1.094                    | 0,21                              | 4,500 % fällig am 10.07.2027                   | £ 350          | 466                      | 0,09                              | <b>CenterPoint Energy Houston Electric LLC</b>   |                |                          |                                   |
| <b>UniCredit SpA</b>                       |                |                          |                                   | <b>Metalsa S.A. de C.V.</b>                    |                |                          |                                   | 5,300 % fällig am 01.04.2053                     | 800            | 763                      | 0,14                              |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035               | 300            | 298                      | 0,06                              | 3,750 % fällig am 04.05.2031                   | \$ 550         | 452                      | 0,09                              | <b>Chile Electricity Lux MPC SARL</b>            |                |                          |                                   |
| <b>VIA Outlets BV</b>                      |                |                          |                                   | <b>MSCI, Inc.</b>                              |                |                          |                                   | 5,580 % fällig am 20.10.2035                     | 782            | 783                      | 0,15                              |
| 1,750 % fällig am 15.11.2028               | € 500          | 562                      | 0,11                              | 3,625 % fällig am 01.09.2030                   | 400            | 375                      | 0,07                              | <b>Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.</b> |                |                          |                                   |
| <b>Workspace Group PLC</b>                 |                |                          |                                   | <b>NetApp, Inc.</b>                            |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 25.03.2027                     | 161            | 156                      | 0,03                              |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028               | £ 500          | 633                      | 0,12                              | 5,500 % fällig am 17.03.2032                   | 600            | 618                      | 0,12                              | <b>Edison International</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>ZF Finance GmbH</b>                     |                |                          |                                   | 5,700 % fällig am 17.03.2035                   | 600            | 616                      | 0,12                              | 6,250 % fällig am 15.03.2030                     | 1.200          | 1.219                    | 0,23                              |
| 2,000 % fällig am 06.05.2027               | € 400          | 445                      | 0,08                              | <b>NXP BV</b>                                  |                |                          |                                   | 7,875 % fällig am 15.06.2054                     | 700            | 665                      | 0,13                              |
| 2,250 % fällig am 03.05.2028               | 100            | 107                      | 0,02                              | 2,500 % fällig am 11.05.2031                   | 250            | 221                      | 0,04                              | <b>Electricite de France S.A.</b>                |                |                          |                                   |
|                                            |                | 85.081                   | 16,11                             | 5,000 % fällig am 15.01.2033                   | 1.000          | 998                      | 0,19                              | 4,625 % fällig am 07.05.2045                     | € 1.000        | 1.150                    | 0,22                              |
| <b>INDUSTRIEWERTE</b>                      |                |                          |                                   | <b>Organon &amp; Co.</b>                       |                |                          |                                   | <b>Enel Finance International NV</b>             |                |                          |                                   |
| <b>180 Medical, Inc.</b>                   |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 30.04.2028                   | 1.300          | 1.251                    | 0,24                              | 1,625 % fällig am 12.07.2026                     | \$ 300         | 291                      | 0,05                              |
| 3,875 % fällig am 15.10.2029 (h)           | \$ 900         | 857                      | 0,16                              | <b>Pearson Funding PLC</b>                     |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 12.07.2031                     | 400            | 351                      | 0,07                              |
| <b>Accor S.A.</b>                          |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 04.06.2030                   | £ 100          | 131                      | 0,02                              | <b>EPH Financing International A/S</b>           |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 29.11.2028               | € 900          | 1.042                    | 0,20                              | <b>Pinnacle Bidco PLC</b>                      |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 02.07.2032 (b)                 | € 1.300        | 1.537                    | 0,29                              |
| <b>Amgen, Inc.</b>                         |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 11.10.2028                   | € 250          | 308                      | 0,06                              | <b>Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.</b>      |                |                          |                                   |
| 5,600 % fällig am 02.03.2043               | \$ 900         | 893                      | 0,17                              | <b>RELX Capital, Inc.</b>                      |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 27.09.2028                     | \$ 1.200       | 1.211                    | 0,23                              |
| <b>Arcadis NV</b>                          |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 20.05.2032                   | \$ 800         | 806                      | 0,15                              | <b>Iberdrola International BV</b>                |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 28.02.2028               | € 200          | 246                      | 0,05                              | <b>ReNew Pvt Ltd.</b>                          |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.09.2033                     | 250            | 271                      | 0,05                              |
| <b>B.C. Unlimited Liability Co.</b>        |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 05.03.2027                   | 200            | 199                      | 0,04                              | <b>India Green Power Holdings</b>                |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.01.2028               | \$ 500         | 487                      | 0,09                              | <b>S&amp;P Global, Inc.</b>                    |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 22.02.2027                     | 217            | 211                      | 0,04                              |
| <b>Ball Corp.</b>                          |                |                          |                                   | 2,700 % fällig am 01.03.2029                   | 700            | 664                      | 0,13                              | <b>National Grid PLC</b>                         |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 15.09.2031 (h)           | 580            | 521                      | 0,10                              | <b>Sartorius Finance BV</b>                    |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 01.09.2028                     | € 400          | 436                      | 0,08                              |
| <b>BCP Modular Services Finance PLC</b>    |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 14.09.2035                   | € 400          | 503                      | 0,10                              | <b>NextEra Energy Capital Holdings, Inc.</b>     |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028               | € 100          | 116                      | 0,02                              | <b>Schaeffler AG</b>                           |                |                          |                                   | 1,900 % fällig am 15.06.2028                     | \$ 400         | 374                      | 0,07                              |
| <b>Boise Cascade Co.</b>                   |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 12.10.2028                   | 200            | 231                      | 0,04                              | 2,200 % fällig am 02.12.2026                     | AUD 400        | 256                      | 0,05                              |
| 4,875 % fällig am 01.07.2030 (h)           | \$ 380         | 370                      | 0,07                              | 4,500 % fällig am 28.03.2030                   | 700            | 824                      | 0,16                              | <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>            |                |                          |                                   |
| <b>Builders FirstSource, Inc.</b>          |                |                          |                                   | <b>SK Hynix, Inc.</b>                          |                |                          |                                   | 6,700 % fällig am 01.04.2053                     | \$ 1.300       | 1.305                    | 0,25                              |
| 4,250 % fällig am 01.02.2032               | 500            | 464                      | 0,09                              | 6,375 % fällig am 17.01.2028                   | \$ 600         | 626                      | 0,12                              | <b>PacificCorp</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>Camelot Finance S.A.</b>                |                |                          |                                   | <b>St Marys Cement, Inc. Canada</b>            |                |                          |                                   | 5,350 % fällig am 01.12.2053                     | 700            | 630                      | 0,12                              |
| 4,500 % fällig am 01.11.2026               | 371            | 366                      | 0,07                              | 5,750 % fällig am 02.04.2034                   | 400            | 405                      | 0,08                              | <b>Pattern Energy Operations LP</b>              |                |                          |                                   |
| <b>CDW LLC</b>                             |                |                          |                                   | <b>Standard Industries, Inc.</b>               |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.08.2028                     | 500            | 485                      | 0,09                              |
| 3,569 % fällig am 01.12.2031               | 500            | 461                      | 0,09                              | 2,250 % fällig am 21.11.2026                   | € 600          | 698                      | 0,13                              | <b>Severn Trent Utilities Finance PLC</b>        |                |                          |                                   |
| <b>Cellnex Finance Co. S.A.</b>            |                |                          |                                   | <b>TEGNA, Inc.</b>                             |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 05.12.2031                     | £ 1.100        | 1.319                    | 0,25                              |
| 3,875 % fällig am 07.07.2041               | 200            | 158                      | 0,03                              | 4,625 % fällig am 15.03.2028                   | \$ 700         | 683                      | 0,13                              | 3,875 % fällig am 04.08.2035                     | € 900          | 1.064                    | 0,20                              |
| <b>Centene Corp.</b>                       |                |                          |                                   | <b>TopBuild Corp.</b>                          |                |                          |                                   | <b>Southern California Edison Co.</b>            |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 01.08.2031               | 800            | 686                      | 0,13                              | 3,625 % fällig am 15.03.2029                   | 500            | 473                      | 0,09                              | 2,500 % fällig am 01.06.2031                     | \$ 400         | 348                      | 0,07                              |
| 3,000 % fällig am 15.10.2030               | 600            | 536                      | 0,10                              | <b>Transurban Finance Co. Pty. Ltd.</b>        |                |                          |                                   | 3,650 % fällig am 01.06.2051                     | 200            | 132                      | 0,02                              |
| <b>Chobani LLC</b>                         |                |                          |                                   | 2,450 % fällig am 16.03.2031                   | 500            | 444                      | 0,08                              | <b>Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.</b>  |                |                          |                                   |
| 7,625 % fällig am 01.07.2029               | 700            | 730                      | 0,14                              | <b>Travis Perkins PLC</b>                      |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 24.04.2033                     | 274            | 279                      | 0,05                              |
| <b>Fair Isaac Corp.</b>                    |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 17.02.2026                   | £ 170          | 229                      | 0,04                              | <b>TDC Net A/S</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.06.2028               | 610            | 594                      | 0,11                              | <b>Twilio, Inc.</b>                            |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 09.08.2032                     | € 1.200        | 1.442                    | 0,27                              |
| <b>Flex Ltd.</b>                           |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 15.03.2029                   | \$ 500         | 476                      | 0,09                              | 5,056 % fällig am 31.05.2028                     | 300            | 367                      | 0,07                              |
| 6,000 % fällig am 15.01.2028               | 300            | 310                      | 0,06                              | <b>United Rentals North America, Inc.</b>      |                |                          |                                   | 5,618 % fällig am 06.02.2030                     | 2.700          | 3.378                    | 0,64                              |
| <b>Ford Motor Co.</b>                      |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.02.2031                   | 500            | 470                      | 0,09                              | <b>TerraForm Power Operating LLC</b>             |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 12.02.2032               | 80             | 67                       | 0,01                              | <b>VeriSign, Inc.</b>                          |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 31.01.2028                     | \$ 230         | 228                      | 0,04                              |
| <b>Gap, Inc.</b>                           |                |                          |                                   | 2,700 % fällig am 15.06.2031                   | 650            | 583                      | 0,11                              | <b>United Utilities Water Finance PLC</b>        |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029               | 200            | 186                      | 0,04                              | <b>Vilmorin &amp; Cie S.A.</b>                 |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 23.05.2034                     | € 700          | 823                      | 0,16                              |
| 3,875 % fällig am 01.10.2031               | 300            | 270                      | 0,05                              | 1,375 % fällig am 26.03.2028                   | € 300          | 333                      | 0,06                              | <b>Verizon Communications, Inc.</b>              |                |                          |                                   |
| <b>goeasy Ltd.</b>                         |                |                          |                                   | <b>Vmed O2 UK Financing PLC</b>                |                |                          |                                   | 2,850 % fällig am 03.09.2041                     | \$ 300         | 213                      | 0,04                              |
| 9,250 % fällig am 01.12.2028               | 1.200          | 1.270                    | 0,24                              | 4,500 % fällig am 15.07.2031                   | £ 200          | 246                      | 0,05                              | 5,050 % fällig am 09.05.2033 (h)                 | 1.500          | 1.522                    | 0,29                              |
| <b>Graphic Packaging International LLC</b> |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.07.2031                   | \$ 600         | 555                      | 0,10                              | <b>Vodafone Group PLC</b>                        |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 01.02.2029               | € 400          | 451                      | 0,09                              | <b>Wabtec Transportation Netherlands BV</b>    |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 04.06.2081                     | 113            | 86                       | 0,02                              |
| <b>HCA, Inc.</b>                           |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 03.12.2027                   | € 400          | 455                      | 0,09                              |                                                  |                | 25.225                   | 4,78                              |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027               | \$ 500         | 500                      | 0,09                              | <b>Walgreens Boots Alliance, Inc.</b>          |                |                          |                                   | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel           |                | 146.653                  | 27,77                             |
|                                            |                |                          |                                   | 2,125 % fällig am 20.11.2026                   | 1.200          | 1.390                    | 0,26                              |                                                  |                |                          |                                   |



|                                           |             |                   |                       | % DES NETTO-VERMÖGENS                                                      |             |                   |                       |
|-------------------------------------------|-------------|-------------------|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------|-------------|-------------------|-----------------------|
| BESCHREIBUNG                              | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS | BESCHREIBUNG                                                               | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
| US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                     |             |                   |                       |                                                                            |             |                   |                       |
| Fannie Mae                                |             |                   |                       | EMF-UK PLC                                                                 |             |                   |                       |
| 3,500 % fällig am 01.08.2059              | \$ 2.590    | \$ 2.317          | 0,44                  | Great Hall Mortgages PLC                                                   |             |                   |                       |
| 4,000 % fällig am 01.11.2059              | 111         | 104               | 0,02                  | 4,618 % fällig am 18.06.2038                                               | 1.416       | 1.929             | 0,36                  |
| Ginnie Mae                                |             |                   |                       | MortgageIT Trust                                                           |             |                   |                       |
| 5,500 % fällig am 20.07.2053 - 20.08.2053 | 3.734       | 3.758             | 0,71                  | 5,034 % fällig am 25.08.2035                                               | \$ 222      | 221               | 0,04                  |
| Ginnie Mae, TBA                           |             |                   |                       | Residential Accredit Loans, Inc. Trust                                     |             |                   |                       |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055              | 2.500       | 2.455             | 0,46                  | 4,814 % fällig am 25.12.2036                                               | 56          | 50                | 0,01                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security          |             |                   |                       | Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust                        |             |                   |                       |
| 3,000 % fällig am 01.07.2052              | 433         | 375               | 0,07                  | 5,594 % fällig am 25.04.2037                                               | 39          | 34                | 0,01                  |
| 4,000 % fällig am 01.05.2053 - 01.05.2054 | 23.049      | 21.470            | 4,07                  | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                             |             |                   |                       |
| 4,500 % fällig am 01.07.2052 - 01.05.2054 | 13.602      | 13.033            | 2,47                  | 5,079 % fällig am 25.04.2035                                               | 22          | 22                | 0,00                  |
| 5,000 % fällig am 01.08.2053 - 01.04.2054 | 28.770      | 28.291            | 5,36                  | Trinity Square PLC                                                         |             |                   |                       |
| 5,500 % fällig am 01.06.2053 - 01.12.2053 | 30.232      | 30.299            | 5,74                  | 5,617 % fällig am 15.07.2059                                               | £ 1.900     | 2.602             | 0,49                  |
| 6,000 % fällig am 01.01.2055              | 6.117       | 6.225             | 1,18                  | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                              |             |                   |                       |
| 6,500 % fällig am 01.05.2054              | 3.552       | 3.680             | 0,70                  | 4,179 % fällig am 25.11.2036                                               | \$ 74       | 66                | 0,01                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA     |             |                   |                       | Worldwide Plaza Trust                                                      |             |                   |                       |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055              | 500         | 396               | 0,07                  | 3,715 % fällig am 10.11.2036                                               | 1.795       | 297               | 0,06                  |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055              | 1.200       | 1.081             | 0,20                  |                                                                            |             | 25.232            | 4,78                  |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055              | 3.900       | 3.823             | 0,72                  | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                                           |             |                   |                       |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055              | 4.900       | 4.896             | 0,93                  | HYPOTHEKEN SONSTIGE                                                        |             |                   |                       |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055              | 58.300      | 59.193            | 11,21                 | Ameriquet Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |             |                   |                       |
| 6,500 % fällig am 01.08.2055              | 54.560      | 56.257            | 10,65                 | 5,484 % fällig am 25.05.2035                                               | 1.275       | 1.172             | 0,22                  |
|                                           |             | 237.653           | 45,00                 | Argent Securities Trust                                                    |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,734 % fällig am 25.06.2036                                               | 1.931       | 562               | 0,11                  |
|                                           |             |                   |                       | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                 |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,934 % fällig am 25.08.2036                                               | 1.287       | 1.197             | 0,23                  |
|                                           |             |                   |                       | BNC Mortgage Loan Trust                                                    |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,204 % fällig am 25.10.2036                                               | 93          | 66                | 0,01                  |
|                                           |             |                   |                       | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                          |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,714 % fällig am 25.06.2047                                               | 59          | 53                | 0,01                  |
|                                           |             |                   |                       | 4,954 % fällig am 25.12.2036                                               | 239         | 229               | 0,04                  |
|                                           |             |                   |                       | GSAMP Trust                                                                |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,914 % fällig am 25.06.2036                                               | 1.647       | 908               | 0,17                  |
|                                           |             |                   |                       | 5,334 % fällig am 25.11.2035                                               | 88          | 85                | 0,01                  |
|                                           |             |                   |                       | Long Beach Mortgage Loan Trust                                             |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,734 % fällig am 25.11.2036                                               | 430         | 304               | 0,06                  |
|                                           |             |                   |                       | 4,744 % fällig am 25.08.2036                                               | 2.312       | 1.195             | 0,23                  |
|                                           |             |                   |                       | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                     |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 5,109 % fällig am 25.09.2035                                               | 366         | 351               | 0,07                  |
|                                           |             |                   |                       | Soundview Home Loan Trust                                                  |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,934 % fällig am 25.10.2036                                               | 455         | 437               | 0,08                  |
|                                           |             |                   |                       | Structured Asset Investment Loan Trust                                     |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 5,409 % fällig am 25.05.2035                                               | 1.405       | 1.287             | 0,24                  |
|                                           |             |                   |                       | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                      |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,869 % fällig am 25.07.2036                                               | 1.336       | 1.324             | 0,25                  |
|                                           |             |                   |                       | 6,415 % fällig am 25.05.2031                                               | 54          | 39                | 0,01                  |
|                                           |             |                   |                       | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust                      |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 5,434 % fällig am 25.10.2034                                               | 763         | 781               | 0,15                  |
|                                           |             |                   |                       |                                                                            |             | 9.990             | 1,89                  |
|                                           |             |                   |                       | HYPOTHEKEN SEQUENTIELL                                                     |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                        |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,214 % fällig am 25.01.2037                                               | 3.835       | 1.897             | 0,36                  |
|                                           |             |                   |                       | ABS SONSTIGE                                                               |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | Adagio CLO DAC                                                             |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 3,929 % fällig am 15.04.2032                                               | € 2.100     | 2.471             | 0,47                  |
|                                           |             |                   |                       | Arbour CLO DAC                                                             |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 3,293 % fällig am 15.11.2037                                               | 2.900       | 3.405             | 0,64                  |
|                                           |             |                   |                       | Ares European CLO DAC                                                      |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 3,863 % fällig am 17.04.2032                                               | 1.200       | 1.412             | 0,27                  |
|                                           |             |                   |                       | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.                                   |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 5,699 % fällig am 11.04.2045                                               | \$ 2.200    | 2.199             | 0,42                  |
|                                           |             |                   |                       | 5,781 % fällig am 11.04.2043                                               | 2.851       | 2.848             | 0,54                  |
|                                           |             |                   |                       | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC                              |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 3,952 % fällig am 16.01.2033                                               | € 4.000     | 4.706             | 0,89                  |
|                                           |             |                   |                       | Crosthwaite Park CLO DAC                                                   |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 3,575 % fällig am 15.03.2034                                               | 1.000       | 1.176             | 0,22                  |
|                                           |             |                   |                       | CVC Cordatus Loan Fund DAC                                                 |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 3,699 % fällig am 26.08.2032                                               | 1.300       | 1.530             | 0,29                  |
|                                           |             |                   |                       | SICHERHEITEN FÜR WHOLE LOANS                                               |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | First Franklin Mortgage Loan Trust                                         |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,709 % fällig am 25.03.2036                                               | 1.377       | 1.317             | 0,25                  |
|                                           |             |                   |                       | 5,184 % fällig am 25.12.2035                                               | 767         | 749               | 0,14                  |
|                                           |             |                   |                       | Lehman XS Trust                                                            |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,754 % fällig am 25.02.2037                                               | 373         | 361               | 0,07                  |
|                                           |             |                   |                       |                                                                            |             | 2.427             | 0,46                  |
|                                           |             |                   |                       |                                                                            |             | 58.330            | 11,04                 |
|                                           |             |                   |                       | STAATSEMISSIONEN                                                           |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | Brazil Government International Bond                                       |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 6,125 % fällig am 15.03.2034                                               | 800         | 794               | 0,15                  |
|                                           |             |                   |                       | Chile Government International Bond                                        |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 2,750 % fällig am 31.01.2027                                               | 300         | 292               | 0,06                  |
|                                           |             |                   |                       | 3,500 % fällig am 31.01.2034                                               | 300         | 270               | 0,05                  |
|                                           |             |                   |                       | Fondo MIVIVIENDA S.A.                                                      |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,625 % fällig am 12.04.2027                                               | 300         | 300               | 0,06                  |
|                                           |             |                   |                       | Hungary Government International Bond                                      |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 4,000 % fällig am 25.07.2029                                               | € 1.300     | 1.568             | 0,30                  |
|                                           |             |                   |                       | 4,875 % fällig am 22.03.2040                                               | 700         | 805               | 0,15                  |
|                                           |             |                   |                       | Mexico Government International Bond                                       |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 2,250 % fällig am 12.08.2036                                               | 870         | 794               | 0,15                  |
|                                           |             |                   |                       | 4,000 % fällig am 24.08.2034 (d)                                           | MXN 192.119 | 9.462             | 1,79                  |
|                                           |             |                   |                       | 4,490 % fällig am 25.05.2032                                               | € 1.400     | 1.665             | 0,32                  |
|                                           |             |                   |                       | Peru Government International Bond                                         |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 7,300 % fällig am 12.08.2033                                               | PEN 5.200   | 1.599             | 0,30                  |
|                                           |             |                   |                       | Republic of Uzbekistan International Bond                                  |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 5,375 % fällig am 29.05.2027                                               | € 400       | 481               | 0,09                  |
|                                           |             |                   |                       | Romania Government International Bond                                      |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 1,750 % fällig am 13.07.2030                                               | 600         | 606               | 0,11                  |
|                                           |             |                   |                       | 5,500 % fällig am 18.09.2028                                               | 350         | 429               | 0,08                  |
|                                           |             |                   |                       | 6,375 % fällig am 18.09.2033                                               | 350         | 424               | 0,08                  |
|                                           |             |                   |                       | Serbia Government International Bond                                       |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 1,000 % fällig am 23.09.2028                                               | 400         | 434               | 0,08                  |
|                                           |             |                   |                       | South Africa Government International Bond                                 |             |                   |                       |
|                                           |             |                   |                       | 8,875 % fällig am 28.02.2035                                               | ZAR 145.025 | 7.620             | 1,44                  |
|                                           |             |                   |                       | 10,500 % fällig am 21.12.2026                                              | 8.000       | 467               | 0,09                  |
|                                           |             |                   |                       |                                                                            |             | 28.010            | 5,30                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                     | AKTIEN | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------|--------|---------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAMMAKTIE</b>                |        |                           |                                   |
| <b>FINANZWERT</b>                |        |                           |                                   |
| MNSN Holdings, Inc. (c)(g)       | 681    | 3                         | 0,00                              |
| <b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>        |        |                           |                                   |
| <b>SVB Financial Trust</b>       |        |                           |                                   |
| 11.000 % fällig am<br>07.11.2032 | 776    | 411                       | 0,08                              |
| Summe Übertragbare Wertpapiere   | \$     | 545.825                   | 103,35                            |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                     | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|-----------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                     | 4,480 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 18.200          | U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig<br>am 30.04.2028 | \$ (18.610)                | \$ 18.200                           | \$ 18.202                                                           | 3,45                    |
| BPS                     | 4,430           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 13.700             | U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig<br>am 31.05.2029 | (13.989)                   | 13.700                              | 13.702                                                              | 2,59                    |
| GSC                     | 4,480           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 3.800              | Ginnie Mae 4,000 % fällig am 20.01.2049             | (4.189)                    | 3.800                               | 3.800                                                               | 0,72                    |
| TDM                     | 4,470           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 30.000             | Ginnie Mae 5,500 % fällig am 20.06.2054             | (30.793)                   | 30.000                              | 30.004                                                              | 5,68                    |
|                         | 4,580           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 35.000             | U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig<br>am 31.10.2026 | (35.736)                   | 35.000                              | 35.004                                                              | 6,63                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                                     | \$ (103.317)               | \$ 100.700                          | \$ 100.712                                                          | 19,07                   |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Short | 03.2026          | 4                       | \$ (1)                                          | 0,00                    |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Short | 09.2025          | 2                       | 0                                               | 0,00                    |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Short | 06.2026          | 3                       | (1)                                             | 0,00                    |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Short | 12.2025          | 3                       | 0                                               | 0,00                    |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures  | Long  | 09.2025          | 105                     | 64                                              | 0,01                    |
| Euro-Bobl September Futures                          | Long  | 09.2025          | 1                       | (1)                                             | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                          | Long  | 09.2025          | 7                       | (8)                                             | 0,00                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 645                     | 493                                             | 0,09                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 337                     | 430                                             | 0,08                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025          | 339                     | 771                                             | 0,15                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025          | 10                      | (29)                                            | (0,01)                  |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Long  | 09.2025          | 10                      | 41                                              | 0,01                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025          | 152                     | 690                                             | 0,13                    |
|                                                      |       |                  |                         | \$ 2.449                                        | 0,46                    |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|---------|----------------|-------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500         | 25.07.2025         | 5                       | \$ (2)  | \$ 0           | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000            | 25.07.2025         | 20                      | (9)     | (1)            | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500            | 25.07.2025         | 5                       | (2)     | 0              | 0,00                    |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250            | 25.07.2025         | 6                       | (1)     | (1)            | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000            | 25.07.2025         | 5                       | (2)     | (4)            | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500            | 25.07.2025         | 25                      | (10)    | (13)           | 0,00                    |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750            | 25.07.2025         | 6                       | (2)     | (3)            | 0,00                    |
| Put - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                    | € 117,250          | 25.07.2025         | 2                       | 0       | (1)            | 0,00                    |
| Call - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                   | 118,500            | 25.07.2025         | 2                       | 0       | 0              | 0,00                    |
| Put - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                    | 129,000            | 25.07.2025         | 1                       | 0       | 0              | 0,00                    |
| Call - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                   | 132,500            | 25.07.2025         | 1                       | (1)     | 0              | 0,00                    |
|                                                                |                    |                    |                         | \$ (29) | \$ (23)        | 0,00                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |                    |                    |                         |         | \$ 2.426       | 0,46                    |

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

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

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

| Referenzeinheit                | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|--------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| British Telecommunications PLC | 1,000 %                        | 20.06.2028            | € 200                          | \$ 2                                            | 0,00                    |
| British Telecommunications PLC | 1,000                          | 20.12.2028            | 900                            | 8                                               | 0,00                    |
|                                |                                |                       |                                | \$ 10                                           | 0,00                    |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-43 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.12.2029            | \$ 4.400                       | \$ (28)                                         | (0,01)                  |
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000                          | 20.06.2030            | 5.600                          | 173                                             | 0,04                    |
| CDX.IG-43 5-Year Index | 1,000                          | 20.12.2029            | 2.500                          | 1                                               | 0,00                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030            | 19.800                         | 98                                              | 0,02                    |
|                        |                                |                       |                                | \$ 244                                          | 0,05                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 30.800        | \$ 116                                          | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500              | 19.03.2035            | 3.000           | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,700              | 28.03.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,930              | 06.01.2035            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 4,320              | 20.10.2033            | 100             | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000              | 15.12.2026            | ¥ 330.000       | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000              | 16.06.2028            | 890.000         | 19                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000              | 15.12.2028            | 1.690.000       | 66                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400              | 15.06.2032            | 226.300         | 13                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500              | 15.03.2042            | 101.000         | 31                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,700              | 18.09.2029            | 860.000         | 15                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000              | 18.09.2034            | 440.000         | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,500              | 16.06.2028            | \$ 150          | (8)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,750              | 16.06.2031            | 100             | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 16.06.2051            | 40              | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,350              | 20.01.2027            | 200             | (8)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,360              | 15.02.2027            | 550             | (23)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,420              | 24.02.2027            | 400             | (17)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450              | 17.02.2027            | 500             | (21)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450              | 16.07.2031            | 50              | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500              | 12.01.2029            | 110             | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,600              | 16.01.2026            | 2.700           | (63)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,785              | 12.08.2051            | 50              | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,815              | 24.01.2052            | 50              | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,867              | 26.01.2052            | 50              | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2027            | 2.820           | (60)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2029            | 2.600           | (63)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 15.12.2051            | 200             | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,300              | 17.01.2026            | 2.000           | (34)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,430              | 30.09.2027            | 460             | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,450              | 04.10.2027            | 460             | (6)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,537              | 24.07.2053            | 100             | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,620              | 24.07.2025            | 2.600           | 35                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,750              | 21.06.2053            | 3.200           | 116                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 19.03.2027            | 37.000          | 243                                             | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 19.03.2030            | 64.100          | (1.842)                                         | (0,35)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2030            | 1.570           | (41)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 21.06.2028            | 420             | (8)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 19.03.2035            | 27.100          | 1.022                                           | 0,19                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 19.03.2055            | 800             | 7                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,350              | 14.12.2032            | 100             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,370              | 12.07.2053            | 200             | (10)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,375              | 15.10.2034            | 200             | (5)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,385              | 17.10.2034            | 200             | (5)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,395              | 17.10.2034            | 300             | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,400              | 17.10.2034            | 100             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,446              | 23.10.2034            | 200             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,450              | 11.10.2034            | 200             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,463              | 23.10.2034            | 200             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,465              | 30.10.2034            | 400             | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,481              | 29.10.2034            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,495              | 30.10.2034            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 22.05.2033            | 21.620          | (390)                                           | (0,07)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.12.2033            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500 %            | 17.09.2055            | \$ 9.400        | \$ (61)                                         | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,515              | 06.11.2034            | 1.300           | (17)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,555              | 05.03.2054            | 100             | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,594              | 09.01.2034            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,600              | 17.01.2034            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,610              | 12.12.2032            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620              | 31.01.2034            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,648              | 08.01.2034            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650              | 05.03.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,655              | 24.01.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,665              | 24.01.2034            | 200             | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,670              | 08.01.2034            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,684              | 03.01.2034            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,685              | 24.01.2034            | 200             | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700              | 06.06.2033            | 12.640          | (210)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700              | 05.03.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,710              | 05.03.2034            | 200             | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,725              | 07.02.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735              | 23.01.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,738              | 23.01.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 13.12.2027            | 400             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2028            | 4.800           | (58)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2029            | 17.100          | (334)                                           | (0,06)                  |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 17.09.2030            | 44.500          | 241                                             | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2031            | 9.400           | (350)                                           | (0,07)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 02.01.2034            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2034            | 3.100           | 137                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 07.05.2035            | 600             | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,783              | 07.02.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,810              | 02.01.2034            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,830              | 12.10.2053            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,840              | 08.01.2035            | 200             | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,842              | 04.03.2030            | 600             | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,842              | 26.12.2033            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,850              | 08.01.2035            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,854              | 29.12.2033            | 200             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,860              | 21.02.2034            | 400             | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,865              | 20.11.2034            | 700             | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,866              | 14.11.2034            | 700             | 12                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870              | 05.03.2035            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870              | 17.10.2053            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,874              | 05.03.2035            | 300             | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880              | 16.10.2053            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,884              | 25.03.2035            | 300             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,890              | 03.03.2035            | 150             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,896              | 08.01.2035            | 200             | 4                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 10.04.2034            | 200             | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 15.04.2034            | 100             | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 08.01.2035            | 200             | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,905              | 12.03.2035            | 300             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,908              | 04.03.2035            | 300             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,930              | 24.03.2035            | 600             | (10)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,933              | 06.01.2035            | 200             | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,940              | 22.02.2029            | 600             | 12                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950              | 19.12.2033            | 200             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950              | 16.04.2034            | 200             | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970              | 27.02.2029            | 200             | 4                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970              | 15.01.2035            | 100             | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,975              | 21.03.2035            | 500             | (10)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,000              | 20.06.2026            | 23.900          | 333                                             | 0,06                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,000              | 26.02.2035            | 350             | (8)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,015              | 30.12.2034            | 200             | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030              | 15.12.2033            | 200             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,071              | 15.01.2035            | 200             | 7                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,080              | 17.04.2034            | 200             | 7                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,085              | 22.04.2034            | 200             | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,090              | 30.04.2034            | 600             | 22                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,090              | 22.01.2035            | 200             | 7                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,100              | 21.01.2035            | 100             | 4                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,130              | 03.05.2034            | 200             | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150              | 22.04.2034            | 200             | 9                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 22.11.2033            | 200             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                | 9,832              | 04.01.2027            | BRL 4.000       | (51)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                | 10,256             | 04.01.2027            | 38.700          | (406)                                           | (0,08)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                | 13,354             | 02.01.2029            | 134.275         | 228                                             | 0,04                    |
| Zahlung                                     | 3-Month NZD-BBR               | 4,750              | 19.06.2029            | NZD 1.900       | 44                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW          | 4,500              | 20.03.2034            | AUD 4.000       | 118                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW          | 4,500              | 18.06.2035            | 11.000          | 24                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR           | 1,000              | 13.05.2027            | € 700           | 26                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR           | 1,000              | 18.05.2027            | 400             | 15                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,000              | 17.09.2027            | 2.300           | (17)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,220              | 08.01.2035            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250 %            | 17.09.2030            | € 19.100        | \$ (271)                                        | (0,05)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250              | 17.09.2035            | 9.500           | (106)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250              | 17.09.2055            | 300             | 12                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,280              | 04.03.2030            | 200             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,300              | 25.09.2029            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,350              | 29.04.2030            | 200             | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,360              | 07.10.2029            | 200             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,380              | 31.12.2034            | 100             | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,390              | 01.10.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,400              | 09.04.2030            | 300             | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,400              | 12.02.2035            | 200             | 4                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,410              | 05.11.2034            | 400             | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,420              | 07.03.2035            | 200             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,450              | 05.05.2035            | 200             | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,460              | 01.04.2035            | 200             | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,510              | 09.04.2035            | 200             | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,520              | 27.03.2035            | 200             | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,520              | 09.04.2035            | 200             | 2                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,547              | 09.03.2033            | 400             | 8                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,550              | 16.04.2035            | 200             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,580              | 29.08.2034            | 100             | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,590              | 19.08.2034            | 100             | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,610              | 24.03.2035            | 200             | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,650              | 14.08.2029            | 200             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,650              | 08.01.2034            | 200             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,670              | 03.04.2034            | 100             | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,680              | 07.08.2034            | 100             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,700              | 13.08.2029            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,710              | 06.08.2034            | 200             | (6)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,750              | 05.03.2034            | 100             | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,760              | 03.01.2029            | 200             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,760              | 04.03.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,770              | 16.04.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,770              | 29.04.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,780              | 02.05.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,818              | 26.06.2029            | 200             | (5)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,827              | 06.05.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,860              | 24.04.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,880              | 19.12.2028            | 200             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,890              | 22.12.2033            | 200             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,910              | 29.12.2033            | 100             | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,920              | 13.12.2028            | 300             | (11)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,950              | 29.12.2028            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,950              | 12.06.2029            | 200             | 7                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,970              | 15.12.2033            | 200             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,990              | 08.12.2033            | 200             | (7)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,063              | 06.12.2033            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,128              | 04.12.2033            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,148              | 20.11.2033            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,179              | 29.11.2028            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,250              | 06.11.2033            | 200             | (8)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,255              | 22.11.2028            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,270              | 08.11.2028            | 200             | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,270              | 21.08.2033            | 100             | 4                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,280              | 22.11.2033            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,300              | 03.10.2033            | 400             | 15                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,305              | 27.11.2033            | 100             | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,370              | 09.10.2028            | 200             | 7                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,450              | 20.10.2028            | 200             | 7                                               | 0,00                    |
|                                                |                         |                    |                       |                 | \$ (1.639)                                      | (0,31)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                    |                       |                 | \$ (1.385)                                      | (0,26)                  |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,110 %            | 26.07.2032         | 200                            | \$ 33  | \$ 13          | 0,00                         |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 2,110              | 26.07.2032         | 300                            | 49     | 94             | 0,02                         |
| MYC        | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,400              | 20.07.2027         | 200                            | 26     | 4              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 2,400              | 20.07.2027         | 200                            | 26     | 54             | 0,01                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ 134 | \$ 165         | 0,03                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,555 %            | 24.07.2025         | 300                            | \$ (1)  | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,637              | 18.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,700              | 21.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770              | 09.07.2025         | 300                            | (1)     | (3)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,905              | 24.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,037              | 18.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050              | 21.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120              | 09.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564              | 24.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605              | 23.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914              | 24.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955              | 23.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380              | 03.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640              | 03.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,750              | 03.07.2025         | 600                            | (1)     | (4)            | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,790              | 09.07.2025         | 400                            | (1)     | (4)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,100              | 03.07.2025         | 600                            | (2)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,140              | 09.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525              | 28.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583              | 23.07.2025         | 200                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653              | 14.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680              | 07.07.2025         | 200                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695              | 17.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | (3)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875              | 28.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933              | 23.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030              | 07.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053              | 14.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095              | 17.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772              | 10.07.2025         | 300                            | (1)     | (3)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122              | 10.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664              | 14.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697              | 16.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715              | 02.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725              | 03.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064              | 14.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065              | 02.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075              | 03.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097              | 16.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ (43) | \$ (41)        | (0,01)                       |

#### ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung                                        | Variabler Zinssatzindex       | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettovermö-gens |
|------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|-----------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026 %        | 23.07.2025     | 2.600                      | \$ (22) | \$ (11)    | 0,00                  |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026          | 23.07.2025     | 2.600                      | (23)    | 0          | 0,00                  |
|            |                                                     |                               |                |                |                            | \$ (45) | \$ (11)    | 0,00                  |

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

<sup>(2)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| MYC        | South Africa Government International Bond | 1,000 %                     | 20.12.2026       | \$ 1.000                  | \$ (44)                               | \$ 48                                    | \$ 4      | 0,00                 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                     | 20.12.2029       | € 295                     | \$ 57                                 | \$ 6                                     | \$ 63     | 0,01                 |
| MYC        | CMBX.NA.AAA.14 Index             | 0,500                       | 16.12.2072       | \$ 1.600                  | (39)                                  | 40                                       | 1         | 0,00                 |
|            |                                  |                             |                  |                           | \$ 18                                 | \$ 46                                    | \$ 64     | 0,01                 |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | \$ 4.511            | AUD 6.944             | \$ 40                         | \$ 0                            | \$ 40                                         | 0,01                 |
|            | 07.2025          | 131                 | € 115                 | 4                             | 0                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD 6.944           | \$ 4.513              | 0                             | (40)                            | (40)                                          | (0,01)               |
| BOA        | 07.2025          | 3.407               | \$ 2.206              | 0                             | (26)                            | (26)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | € 69.036            | 78.498                | 0                             | (2.542)                         | (2.542)                                       | (0,48)               |
| BPS        | 07.2025          | BRL 87              | 15                    | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 11               | € 9                   | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 34                  | INR 2.991             | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 05.2026          | 48                  | KWD 15                | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 06.2026          | 34                  | 10                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 06.2027          | 17                  | 5                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 05.2029          | KWD 73              | \$ 250                | 11                            | 0                               | 11                                            | 0,00                 |
|            | 07.2029          | 9                   | 30                    | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 05.2030          | 53                  | 184                   | 7                             | 0                               | 7                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | \$ 17.754           | £ 13.049              | 128                           | 0                               | 128                                           | 0,03                 |
|            | 07.2025          | 18                  | ¥ 2.535               | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR 69.906          | \$ 3.867              | 0                             | (60)                            | (60)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025          | £ 13.049            | 17.757                | 0                             | (128)                           | (128)                                         | (0,02)               |
| CBK        | 08.2025          | \$ 258              | INR 22.207            | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | PEN 4.142           | \$ 1.128              | 0                             | (37)                            | (37)                                          | (0,01)               |
|            | 02.2026          | 1.452               | 395                   | 0                             | (11)                            | (11)                                          | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | \$ 79.955           | € 68.921              | 949                           | 0                               | 949                                           | 0,18                 |
|            | 08.2025          | € 68.770            | \$ 79.955             | 0                             | (947)                           | (947)                                         | (0,18)               |
|            | 08.2025          | \$ 119              | INR 10.305            | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MXN 29              | \$ 2                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | AUD 3.537           | 2.282                 | 0                             | (36)                            | (36)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | BRL 40.517          | 7.335                 | 0                             | (88)                            | (88)                                          | (0,02)               |
|            | 07.2025          | ¥ 798.655           | 5.487                 | 0                             | (42)                            | (42)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 7.083            | BRL 40.499            | 338                           | 0                               | 338                                           | 0,06                 |
|            | 07.2025          | 9.748               | ¥ 1.398.472           | 0                             | (67)                            | (67)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025          | 57                  | INR 4.936             | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 5.487               | ¥ 795.718             | 42                            | 0                               | 42                                            | 0,01                 |
|            | 09.2025          | 7.335               | BRL 41.136            | 89                            | 0                               | 89                                            | 0,02                 |
|            | 09.2025          | 1.260               | MXN 24.543            | 28                            | 0                               | 28                                            | 0,01                 |
| GLM        | 07.2025          | ZAR 291             | \$ 16                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | 19.821              | 1.109                 | 0                             | (4)                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 38               | INR 3.336             | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CAD 1.878           | \$ 1.367              | 0                             | (9)                             | (9)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 1.367            | CAD 1.879             | 10                            | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 665                 | £ 493                 | 10                            | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 427                 | ¥ 61.344              | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD 1.876           | \$ 1.367              | 0                             | (10)                            | (10)                                          | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          | CHF 17              | \$ 21                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | € 44                | 51                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £ 7                 | 10                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥ 254.443           | 1.745                 | 0                             | (17)                            | (17)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK 10              | 1                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD 9               | 7                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 209              | € 178                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 38                  | £ 28                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 219                 | ¥ 31.591              | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 2                   | SGD 3                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 1.745               | ¥ 253.508             | 17                            | 0                               | 17                                            | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MXN 127.680         | \$ 6.677              | 0                             | (27)                            | (27)                                          | (0,01)               |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| SCX        | 07.2025               | ¥ 316                  | \$ 2                     | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 40                  | INR 3.458                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 2                      | ¥ 315                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025               | ¥ 36.911               | \$ 256                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 29                  | € 25                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 0                      | INR 20                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 256                    | ¥ 36.775                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | £ 13.542               | \$ 18.336                | 0                                | (222)                              | (222)                                                | (0,04)                  |
| UAG        | 07.2025               | \$ 142                 | ¥ 20.613                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025               | ¥ 424.118              | \$ 2.945                 | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 2.945               | ¥ 422.557                | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 1.685                         | \$ (4.325)                         | \$ (2.640)                                           | (0,50)                  |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Class R AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD 27.533             | \$ 17.886                | \$ 0                             | \$ (158)                           | \$ (158)                                             | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | \$ 17.896              | AUD 27.533               | 159                              | 0                                  | 159                                                  | 0,03                    |
| BOA        | 07.2025               | AUD 3.295              | \$ 2.136                 | 0                                | (23)                               | (23)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | \$ 18.388              | AUD 28.532               | 311                              | 0                                  | 311                                                  | 0,06                    |
| DUB        | 07.2025               | 16.802                 | 26.092                   | 297                              | 0                                  | 297                                                  | 0,06                    |
| FAR        | 07.2025               | AUD 27.370             | \$ 17.895                | 0                                | (43)                               | (43)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$ 18.386              | AUD 28.497               | 289                              | 0                                  | 289                                                  | 0,05                    |
|            | 08.2025               | 17.906                 | 27.370                   | 43                               | 0                                  | 43                                                   | 0,01                    |
| JPM        | 07.2025               | AUD 24.830             | \$ 16.274                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 16.284              | AUD 24.830               | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | AUD 93                 | \$ 59                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 1.100                         | \$ (226)                           | \$ 874                                               | 0,17                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CHF 406                | \$ 508                   | \$ 0                             | \$ (2)                             | \$ (2)                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 508                 | CHF 404                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025               | CHF 466                | \$ 569                   | 0                                | (17)                               | (17)                                                 | (0,01)                  |
| CBK        | 07.2025               | \$ 79                  | CHF 64                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               | CHF 408                | \$ 510                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 859                 | CHF 707                  | 30                               | 0                                  | 30                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               | 510                    | 407                      | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | 854                    | 702                      | 28                               | 0                                  | 28                                                   | 0,01                    |
| MYI        | 07.2025               | 21                     | 17                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025               | 791                    | 649                      | 24                               | 0                                  | 24                                                   | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025               | CHF 466                | \$ 569                   | 0                                | (17)                               | (17)                                                 | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 89                            | \$ (39)                            | \$ 50                                                | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 44.596               | \$ 52.216                | \$ 0                             | \$ (132)                           | \$ (132)                                             | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | \$ 47.255              | € 41.590                 | 1.565                            | 0                                  | 1.565                                                | 0,30                    |
|            | 08.2025               | 52.331                 | 44.596                   | 132                              | 0                                  | 132                                                  | 0,03                    |
| BOA        | 07.2025               | 51.580                 | 45.357                   | 1.663                            | 0                                  | 1.663                                                | 0,31                    |
| BPS        | 07.2025               | € 337                  | \$ 382                   | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | 887                    | 1.022                    | 0                                | (18)                               | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 50.805              | € 44.737                 | 1.709                            | 0                                  | 1.709                                                | 0,32                    |
| CBK        | 07.2025               | € 928                  | \$ 1.069                 | 0                                | (20)                               | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 658                 | € 573                    | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | € 45.098               | \$ 52.318                | 0                                | (620)                              | (620)                                                | (0,12)                  |
|            | 08.2025               | \$ 52.318              | € 44.999                 | 619                              | 0                                  | 619                                                  | 0,12                    |
| MBC        | 07.2025               | € 183                  | \$ 212                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 786                 | € 679                    | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | € 13                   | \$ 15                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 5.715                         | \$ (807)                           | \$ 4.908                                             | 0,93                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £                      | \$                       | 40                               | 0                                  | 40                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025               | \$                     | £                        | 0                                | (40)                               | (40)                                                 | (0,01)                  |
| BOA        | 07.2025               | £                      | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               |                        |                          | 0                                | (231)                              | (231)                                                | (0,04)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | £                        | 502                              | 0                                  | 502                                                  | 0,09                    |
|            | 08.2025               |                        |                          | 231                              | 0                                  | 231                                                  | 0,04                    |
| CBK        | 07.2025               | £                      | \$                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | £                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               |                        |                          | 473                              | 0                                  | 473                                                  | 0,09                    |
| SSB        | 07.2025               | £                      | \$                       | 20                               | 0                                  | 20                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | £                        | 370                              | 0                                  | 370                                                  | 0,07                    |
|            | 08.2025               |                        |                          | 0                                | (19)                               | (19)                                                 | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 1.636                         | \$ (291)                           | \$ 1.345                                             | 0,25                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025               | \$                     | NOK                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | NOK                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | NOK                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | NOK                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | NOK                      | 182                              | 0                                  | 182                                                  | 0,03                    |
| FAR        | 07.2025               |                        |                          | 92                               | 0                                  | 92                                                   | 0,02                    |
| GLM        | 07.2025               | NOK                    | \$                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | \$                     | NOK                      | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | NOK                    | \$                       | 77                               | 0                                  | 77                                                   | 0,02                    |
|            | 07.2025               | \$                     | NOK                      | 119                              | 0                                  | 119                                                  | 0,02                    |
|            | 08.2025               |                        |                          | 0                                | (77)                               | (77)                                                 | (0,01)                  |
| RYL        | 07.2025               | NOK                    | \$                       | 1                                | (1)                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | NOK                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               |                        |                          | 20                               | 0                                  | 20                                                   | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025               | NOK                    | \$                       | 207                              | 0                                  | 207                                                  | 0,04                    |
|            | 08.2025               | \$                     | NOK                      | 0                                | (207)                              | (207)                                                | (0,04)                  |
|            |                       |                        |                          | \$ 698                           | \$ (297)                           | \$ 401                                               | 0,08                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 115                              | 0                                  | 115                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        |                          | 0                                | (115)                              | (115)                                                | (0,02)                  |
| FAR        | 07.2025               |                        |                          | 102                              | 0                                  | 102                                                  | 0,02                    |
| GLM        | 07.2025               |                        |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               |                        |                          | 154                              | 0                                  | 154                                                  | 0,03                    |
| RYL        | 07.2025               | SEK                    | \$                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SEK                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               |                        |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               |                        |                          | 168                              | 0                                  | 168                                                  | 0,03                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 540                           | \$ (117)                           | \$ 423                                               | 0,08                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025               | SGD                    | \$                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SGD                      | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        |                          | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | SGD                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SGD                      | 42                               | 0                                  | 42                                                   | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | SGD                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SGD                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               |                        |                          | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               | SGD                    | \$                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | SGD                      | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        |                          | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025               | SGD                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | SGD                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO ESG Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MBC        | 07.2025               | SGD 706                | \$ 546                   | \$ 0                             | \$ (8)                             | \$ (8)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 430                 | SGD 552                  | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 538                    | 694                      | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | SGD 11                 | \$ 8                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 23                  | SGD 29                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | SGD 118                | \$ 92                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 92                  | SGD 118                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | SGD 3                  | \$ 2                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | \$ 4                   | SGD 5                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 30                            | \$ (11)                            | \$ 19                                                | 0,00                    |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 5.561 1,05

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>          |                |                          |                                   |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055          | \$ 500         | \$ (433)                 | (0,08)                            |
| 4,000 % fällig am 01.08.2055          | 5.500          | (5.114)                  | (0,97)                            |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055          | 5.200          | (4.972)                  | (0,94)                            |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere       |                | \$ (10.519)              | (1,99)                            |
| Summe Anlagen                         |                | \$ 642.608               | 121,68                            |
| Sonstige Aktiva und Passiva           |                | \$ (114.476)             | (21,68)                           |
| Nettovermögen                         |                | \$ 528.132               | 100,00                            |

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

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

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,00 %):

| Emittentenbeschreibung | Kauf-<br>datum | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|----------------|--------|----------------|-------------------------|
| MNSN Holdings, Inc.    | 13.09.2024     | \$ 11  | \$ 3           | 0,00                    |

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 5.599 USD (31. Dezember 2024: 1.307 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 8.748 USD (31. Dezember 2024: 4.582 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 910 USD (31. Dezember 2024: 5.620 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 540.276                                                      | \$ 5.549                                                     | \$ 545.825 |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 100.700                                                         | 0                                                            | 100.700    |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 54                                                                          | 6.548                                                           | 0                                                            | 6.602      |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (10.519)                                                        | 0                                                            | (10.519)   |
| Summen                        | \$ 54                                                                       | \$ 637.005                                                      | \$ 5.549                                                     | \$ 642.608 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 343.099                                                      | \$ 3.103                                                     | \$ 346.202 |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (7)                                                                         | (6.353)                                                         | 0                                                            | (6.360)    |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (425)                                                           | 0                                                            | (425)      |
| Summen                        | \$ (7)                                                                      | \$ 336.321                                                      | \$ 3.103                                                     | \$ 339.417 |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                | 4,250 %         | 18.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (283)          | \$ (284)                                                        | (0,05)                  |
|                                    | 4,250           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (720)             | (721)                                                           | (0,14)                  |
|                                    | 4,270           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (3.113)           | (3.116)                                                         | (0,59)                  |
|                                    | 4,280           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (490)             | (490)                                                           | (0,09)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (4.611)                                                      | (0,87)                  |

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.570                            | \$ (1.350)                            | \$ 220                              | \$ (4)                              | \$ 0                                  | \$ (4)                              |
| BOA        | (951)                               | 910                                   | (41)                                | (2)                                 | 0                                     | (2)                                 |
| BPS        | 68                                  | (80)                                  | (12)                                | (816)                               | 650                                   | (166)                               |
| BRC        | 2.444                               | (2.330)                               | 114                                 | (824)                               | 750                                   | (74)                                |
| CBK        | 127                                 | (150)                                 | (23)                                | (459)                               | 280                                   | (179)                               |
| DUB        | 302                                 | (290)                                 | 12                                  | (1.809)                             | 1.500                                 | (309)                               |
| FAR        | 775                                 | (960)                                 | (185)                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| GLM        | 96                                  | 0                                     | 96                                  | 117                                 | 0                                     | 117                                 |
| JPM        | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 | (15)                                | 0                                     | (15)                                |
| MBC        | 503                                 | (580)                                 | (77)                                | (831)                               | 830                                   | (1)                                 |
| MYC        | 44                                  | 0                                     | 44                                  | 21                                  | 0                                     | 21                                  |
| MYI        | 245                                 | (470)                                 | (225)                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| RBC        | 24                                  | 0                                     | 24                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| RYL        | (17)                                | 0                                     | (17)                                | (95)                                | 0                                     | (95)                                |
| SCX        | 20                                  | 0                                     | 20                                  | (1.466)                             | 1.350                                 | (116)                               |
| SOG        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SSB        | 149                                 | 0                                     | 149                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| UAG        | 168                                 | (270)                                 | (102)                               | (172)                               | 260                                   | (88)                                |
| WST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (204)                               | 0                                     | (204)                               |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 20,29             | 36,58             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 35,70             | 55,27             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,04              | 0,10              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 10,34             | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,26              | 0,01              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,35              | 0,46              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,20              | 0,36              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 31,82             | 7,22              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,10              | k. A.             |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 27,77             | 32,48             |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 45,00             | 32,94             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 9,28              | 9,54              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 4,78              | 8,42              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 11,04             | 11,65             |
| Staatsemissionen                                                                       | 5,30              | 3,26              |
| Stammaktien                                                                            | 0,00              | 0,00              |
| Vorzugswertpapiere                                                                     | 0,08              | 0,11              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 19,07             | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,46              | (0,05)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                                  | 0,05              | k. A.             |
| Zinsswaps                                                                              | (0,31)            | 0,10              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,03              | 0,05              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Zinsscaps                                                                              | 0,00              | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                                  | 0,01              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,50)            | 0,12              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,52              | (2,01)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (1,99)            | (0,12)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (21,68)           | 3,53              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                     |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                            |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                      |                |                          |                                   |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>6,069 % fällig am 08.11.2030 | \$             | 214                      | 0,01                              | NatWest Group PLC<br>4,771 % fällig am 16.02.2029                    | €              | 4.100                    | 0,26                              | Coca-Cola Co.<br>0,125 % fällig am 15.03.2029                                  | €              | 1.300                    | 0,07                              |
| Telecom Serbia<br>3,399 % fällig am 11.06.2029                      | €              | 5.000                    | 0,30                              | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab<br>1,000 % fällig am 01.04.2026 | DKK            | 75.300                   | 0,61                              | Comcast Corp.<br>0,250 % fällig am 14.09.2029                                  | 1.000          | 903                      | 0,06                              |
|                                                                     |                | 5.150                    | 0,31                              | 1,000 % fällig am 01.10.2050                                         | 0              | 0                        | 0,00                              | Dassault Systemes SE<br>0,375 % fällig am 16.09.2029                           | 1.000          | 911                      | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2053                                         | 866            | 87                       | 0,01                              | Deutsche Bahn Finance GmbH<br>3,375 % fällig am 29.01.2038                     | 2.500          | 2.480                    | 0,15                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2050                                         | 0              | 0                        | 0,00                              | Deutsche Telekom International Finance BV<br>7,500 % fällig am 24.01.2033      | 1.000          | 1.282                    | 0,08                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2047                                         | 0              | 0                        | 0,00                              | Diageo Capital BV<br>1,500 % fällig am 08.06.2029                              | 1.000          | 958                      | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2050                                         | 8.204          | 948                      | 0,06                              | Eli Lilly & Co.<br>0,625 % fällig am 01.11.2031                                | 1.000          | 868                      | 0,05                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.10.2056                                         | 32.641         | 4.324                    | 0,26                              | Gatwick Funding Ltd.<br>3,625 % fällig am 16.10.2035                           | 5.300          | 5.276                    | 0,32                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | Nova Ljubljanska Banka d.d.<br>10,750 % fällig am 28.11.2032         | €              | 5.700                    | 0,40                              | Linde PLC<br>1,375 % fällig am 31.03.2031                                      | 1.400          | 1.287                    | 0,08                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | Nykredit Realkredit A/S<br>0,500 % fällig am 01.10.2043              | DKK            | 0                        | 0,00                              | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE<br>3,250 % fällig am 07.09.2029            | 1.100          | 1.124                    | 0,07                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.04.2026                                         | 81.800         | 10.901                   | 0,67                              | Market Bidco Finco PLC<br>4,750 % fällig am 04.11.2027                         | 4.200          | 4.190                    | 0,26                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050                                         | 9              | 1                        | 0,00                              | McDonald's Corp.<br>4,000 % fällig am 07.03.2030                               | 1.000          | 1.048                    | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2053                                         | 24             | 2                        | 0,00                              | Medtronic Global Holdings S.C.A.<br>2,250 % fällig am 07.03.2039               | 1.600          | 1.338                    | 0,08                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2037                                         | 0              | 0                        | 0,00                              | Mondelez International Holdings Netherlands BV<br>0,250 % fällig am 09.09.2029 | 1.000          | 907                      | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2047                                         | 4              | 0                        | 0,00                              | Motability Operations Group PLC<br>4,000 % fällig am 17.01.2030                | 4.400          | 4.580                    | 0,28                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2050                                         | 0              | 0                        | 0,00                              | Mundys SpA<br>1,875 % fällig am 12.02.2028                                     | 11.150         | 10.784                   | 0,66                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2052                                         | 4.704          | 512                      | 0,03                              | Netflix, Inc.<br>3,625 % fällig am 15.06.2030                                  | 1.000          | 1.036                    | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2047                                         | 0              | 0                        | 0,00                              | PepsiCo, Inc.<br>0,500 % fällig am 06.05.2028                                  | 1.000          | 948                      | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2050                                         | 56.727         | 6.551                    | 0,40                              | Procter & Gamble Co.<br>1,250 % fällig am 25.10.2029                           | 1.000          | 947                      | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2053                                         | 0              | 0                        | 0,00                              | Roche Finance Europe BV<br>3,204 % fällig am 27.08.2029                        | 1.000          | 1.027                    | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.10.2036                                         | 301            | 40                       | 0,00                              | Sage Group PLC<br>3,820 % fällig am 15.02.2028                                 | 1.000          | 1.029                    | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.10.2047                                         | 25             | 3                        | 0,00                              | Siemens Financieringsmaatschappij NV<br>1,000 % fällig am 25.02.2030           | 2.900          | 2.696                    | 0,16                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.10.2053                                         | 4.389          | 553                      | 0,03                              | Stryker Corp.<br>0,750 % fällig am 01.03.2029                                  | 3.500          | 3.265                    | 0,20                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.04.2053                                         | 23.867         | 3.110                    | 0,19                              | Thermo Fisher Scientific Finance BV<br>0,800 % fällig am 18.10.2030            | 2.000          | 1.796                    | 0,11                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.10.2056                                         | 127.426        | 16.887                   | 1,03                              | Universal Music Group NV<br>4,000 % fällig am 13.06.2031                       | 1.000          | 1.043                    | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.10.2053                                         | 16.658         | 2.313                    | 0,14                              | Walmart, Inc.<br>4,875 % fällig am 21.09.2029                                  | 1.000          | 1.096                    | 0,07                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | Realcredit Danmark A/S<br>1,000 % fällig am 01.01.2026               | 55.000         | 7.338                    | 0,45                              |                                                                                |                | 82.181                   | 5,01                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.04.2026                                         | 45.800         | 6.103                    | 0,37                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2056                                         | 0              | 0                        | 0,00                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2047                                         | 59             | 7                        | 0,00                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2053                                         | 0              | 0                        | 0,00                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2047                                         | 0              | 0                        | 0,00                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2050                                         | 14.652         | 1.691                    | 0,10                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.04.2036                                         | 1              | 0                        | 0,00                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.10.2056                                         | 1.589          | 212                      | 0,01                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | SP-Kiinnitysluottopankki Oyj<br>3,250 % fällig am 02.05.2031         | €              | 4.800                    | 0,30                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | Sparebanken Vest Boligkredit A/S<br>0,375 % fällig am 20.01.2032     | 10.000         | 8.543                    | 0,52                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | Sumitomo Mitsui Banking Corp.<br>2,737 % fällig am 18.02.2030        | 4.000          | 4.002                    | 0,24                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | Toronto-Dominion Bank<br>4,838 % fällig am 11.06.2029                | £              | 3.500                    | 0,25                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | UBS Group AG<br>4,194 % fällig am 01.04.2031                         | \$             | 2.500                    | 0,13                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | UBS Switzerland AG<br>3,146 % fällig am 21.06.2031                   | €              | 5.000                    | 0,31                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | UniCredit SpA<br>2,569 % fällig am 22.09.2026                        | \$             | 4.100                    | 0,21                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 3,127 % fällig am 03.06.2032 (i)                                     | 4.400          | 3.397                    | 0,21                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | Westpac Securities NZ Ltd.<br>0,010 % fällig am 08.06.2028           | €              | 4.500                    | 0,26                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | Yorkshire Building Society<br>2,750 % fällig am 28.01.2030           | 4.000          | 4.023                    | 0,25                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 16.04.2031                                         | 8.200          | 8.314                    | 0,51                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   |                                                                      |                | 304.988                  | 18,61                             |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | <b>INDUSTRIEWERTE</b>                                                |                |                          |                                   | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | AbbVie, Inc.<br>2,125 % fällig am 17.11.2028                         | 3.300          | 3.258                    | 0,20                              | BP Capital Markets BV<br>3,360 % fällig am 12.09.2031                          | 4.600          | 4.642                    | 0,28                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | American Medical Systems Europe BV<br>3,000 % fällig am 08.03.2031   | 700            | 699                      | 0,04                              | BP Capital Markets PLC<br>2,822 % fällig am 07.04.2032                         | 1.000          | 972                      | 0,06                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 08.03.2029                                         | 2.000          | 2.045                    | 0,12                              | Electricite de France S.A.<br>2,875 % fällig am 15.12.2026 (f)                 | 4.000          | 3.943                    | 0,24                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | Amprion GmbH<br>0,625 % fällig am 23.09.2033                         | 11.600         | 9.239                    | 0,56                              | 4,000 % fällig am 07.05.2037                                                   | 4.500          | 4.484                    | 0,27                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | 3,971 % fällig am 22.09.2032                                         | 6.000          | 6.199                    | 0,38                              | National Grid PLC<br>2,949 % fällig am 30.03.2030                              | 5.200          | 5.194                    | 0,32                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | Anheuser-Busch InBev S.A.<br>3,450 % fällig am 22.09.2031            | 2.900          | 2.971                    | 0,18                              | TDC Net A/S<br>6,500 % fällig am 01.06.2031                                    | 4.800          | 5.328                    | 0,33                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | Apple, Inc.<br>1,375 % fällig am 24.05.2029                          | 1.000          | 962                      | 0,06                              | United Utilities Water Finance PLC<br>3,500 % fällig am 27.02.2033             | 5.300          | 5.268                    | 0,32                              |
|                                                                     |                |                          |                                   | Autoroutes du Sud de la France S.A.<br>1,375 % fällig am 21.02.2031  | 1.800          | 1.648                    | 0,10                              |                                                                                |                | 29.831                   | 1,82                              |
|                                                                     |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel                                         |                | 417.000                  | 25,44                             |
|                                                                     |                |                          |                                   | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                         |                |                          |                                   | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                                   |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | Fannie Mae<br>4,807 % fällig am 25.07.2037                           | \$             | 3                        | 0,00                              |                                                                                |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   | 4,820 % fällig am 25.06.2036                                         | 22             | 19                       | 0,00                              |                                                                                |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

| US-MARKT                                                                      |                |                          |                                   | EUROPEISCHER MARKT                                         |                                  |                          |                                   | SONSTIGE                                                          |                                                          |                              |                                   |       |      |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|------------------------------|-----------------------------------|-------|------|
| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S)                   | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S)                                           | MARKT-<br>WERT<br>(000S)     | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |       |      |
| <b>Freddie Mac</b>                                                            |                |                          |                                   | <b>Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust</b>       |                                  |                          |                                   | <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>              |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 2,053 % fällig am 15.01.2038 (a)                                              | \$ 303         | € 13                     | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.08.2047                               | \$ 2.818                         | € 2.060                  | 0,13                              | 3,876 % fällig am 25.05.2037                                      | \$ 485                                                   | € 358                        | 0,02                              |       |      |
| 3,500 % fällig am 01.10.2047                                                  | 2.298          | 1.808                    | 0,11                              | <b>Dilosk RMBS DAC</b>                                     |                                  |                          |                                   | <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,814 % fällig am 15.01.2038                                                  | 303            | 254                      | 0,02                              | 3,049 % fällig am 20.10.2062                               | € 2.968                          | 2.980                    | 0,18                              | 5,149 % fällig am 25.02.2047                                      | 2.166                                                    | 1.695                        | 0,10                              |       |      |
| 6,901 % fällig am 01.09.2037                                                  | 549            | 485                      | 0,03                              | <b>Domi BV</b>                                             | 3,008 % fällig am 16.04.2057     | 6.900                    | 6.907                             | 0,42                                                              | <b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>                |                              |                                   |       |      |
| <b>Ginnie Mae</b>                                                             |                |                          |                                   | <b>Dutch Property Finance BV</b>                           | 2,811 % fällig am 28.07.2058     | 1.666                    | 1.666                             | 0,10                                                              | 6,520 % fällig am 25.07.2037                             | 20                           | 16                                | 0,00  |      |
| 4,896 % fällig am 20.08.2066                                                  | 3              | 2                        | 0,00                              | 2,861 % fällig am 28.04.2059                               | 2.655                            | 2.656                    | 0,16                              |                                                                   |                                                          | 130.239                      | 7,95                              |       |      |
| <b>Ginnie Mae, TBA</b>                                                        |                |                          |                                   | 2,911 % fällig am 28.10.2059                               | 901                              | 902                      | 0,06                              |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055                                                  | 66.100         | 51.201                   | 3,12                              | <b>Economic Master Issuer PLC</b>                          |                                  |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                           |                                                          |                              |                                   |       |      |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                                       |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 25.04.2075 (b)                           | € 7.600                          | 8.876                    | 0,54                              | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                                    |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,500 % fällig am 01.10.2029 - 01.08.2041                                     | 501            | 426                      | 0,03                              | <b>EMF-UK PLC</b>                                          | 5,338 % fällig am 13.03.2046     | 2.689                    | 3.138                             | 0,19                                                              | <b>Auto ABS Italian Stella Loans SRL</b>                 |                              |                                   |       |      |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>                                  |                |                          |                                   | <b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b> | 4,649 % fällig am 25.03.2035     | \$ 24                    | 12                                | 0,00                                                              | 2,773 % fällig am 28.12.2040                             | € 7.700                      | 7.724                             | 0,47  |      |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055                                                  | 19.600         | 15.528                   | 0,95                              | <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                             | 4,729 % fällig am 25.01.2036     | 3                        | 2                                 | 0,00                                                              | <b>Autoria Spain</b>                                     |                              |                                   |       |      |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055                                                  | 95.400         | 77.710                   | 4,74                              | <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                      | 5,309 % fällig am 19.05.2033     | 2                        | 2                                 | 0,00                                                              | 2,530 % fällig am 30.04.2043                             | 4.900                        | 4.907                             | 0,30  |      |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                                                  | 101.800        | 88.050                   | 5,37                              | <b>Harbour PLC</b>                                         | 5,332 % fällig am 28.10.2054     | £ 4.522                  | 5.281                             | 0,32                                                              | 2,589 % fällig am 30.09.2041                             | 2.706                        | 2.713                             | 0,17  |      |
|                                                                               |                | 235.499                  | 14,37                             | <b>Holmes Master Issuer PLC</b>                            | 4,847 % fällig am 15.10.2072     | 5.000                    | 5.844                             | 0,36                                                              | <b>Bavarian Sky S.A.</b>                                 |                              |                                   |       |      |
| <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                                                   |                |                          |                                   | <b>Hops Hill PLC</b>                                       | 0,000 % fällig am 21.06.2056 (b) | 7.000                    | 8.178                             | 0,50                                                              | 0,000 % fällig am 20.08.2032 (b)                         | 7.000                        | 7.001                             | 0,43  |      |
| <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b>                       |                |                          |                                   | 5,223 % fällig am 21.12.2055                               | 4.607                            | 5.409                    | 0,33                              | <b>Compartment VCL</b>                                            | 2,431 % fällig am 21.04.2031                             | 7.200                        | 7.205                             | 0,44  |      |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051                                                  | 6.899          | 3.205                    | 0,19                              | 5,524 % fällig am 27.11.2054                               | 2.734                            | 3.216                    | 0,20                              | <b>E-Carat DE</b>                                                 | 0,000 % fällig am 25.05.2034                             | 8.300                        | 8.309                             | 0,51  |      |
| 1,125 % fällig am 15.01.2033                                                  | 20.244         | 16.487                   | 1,01                              | <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                         | 3,961 % fällig am 25.11.2035     | \$ 65                    | 53                                | 0,00                                                              | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>                     | 3,086 % fällig am 22.09.2043 | 3.710                             | 3.734 | 0,23 |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033                                                  | 11.406         | 9.441                    | 0,58                              | 4,814 % fällig am 25.09.2046                               | 469                              | 360                      | 0,02                              | <b>Pulse UK PLC</b>                                               | 4,884 % fällig am 27.05.2036                             | £ 4.100                      | 4.791                             | 0,29  |      |
| 1,625 % fällig am 15.10.2029                                                  | 19.471         | 16.796                   | 1,02                              | <b>Jubilee Place BV</b>                                    | 3,263 % fällig am 17.10.2057     | € 1.166                  | 1.167                             | 0,07                                                              | <b>Red &amp; Black Auto Germany UG</b>                   | 2,482 % fällig am 15.04.2034 | € 7.533                           | 7.547 | 0,46 |
|                                                                               |                | 45.929                   | 2,80                              | <b>Lace Funding PLC</b>                                    | 4,787 % fällig am 21.11.2074     | £ 4.216                  | 4.932                             | 0,30                                                              | <b>Red &amp; Black Auto Italy SRL</b>                    | 2,929 % fällig am 28.07.2034 | 2.199                             | 2.212 | 0,13 |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                         |                |                          |                                   | <b>Lanark Master Issuer PLC</b>                            | 4,737 % fällig am 22.12.2069     | 1.599                    | 1.869                             | 0,11                                                              | <b>RevoCar S.A., Compartment</b>                         | 2,411 % fällig am 25.03.2038 | 7.397                             | 7.403 | 0,45 |
| <b>Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                                         |                |                          |                                   | <b>Mansard Mortgages PLC</b>                               | 5,008 % fällig am 15.12.2049     | 451                      | 523                               | 0,03                                                              | <b>VCL Multi-Compartment S.A.</b>                        | 2,389 % fällig am 21.12.2030 |                                   | 4.150 | 0,25 |
| 4,047 % fällig am 25.01.2036                                                  | 2              | 2                        | 0,00                              | <b>MASTR Asset Securitization Trust</b>                    | 6,000 % fällig am 25.06.2036     | \$ 87                    | 41                                | 0,00                                                              |                                                          |                              | 67.696                            | 4,13  |      |
| <b>Alba PLC</b>                                                               |                |                          |                                   | <b>Newgate Funding PLC</b>                                 | 5,358 % fällig am 15.12.2050     | £ 200                    | 229                               | 0,01                                                              | <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>                               |                              |                                   |       |      |
| 4,528 % fällig am 15.12.2038                                                  | £ 2.275        | 2.612                    | 0,16                              | <b>Pierpont BTL PLC</b>                                    | 5,339 % fällig am 21.09.2054     | 3.633                    | 4.263                             | 0,26                                                              | <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>       | 4,734 % fällig am 25.07.2036 | \$ 511                            | 145   | 0,01 |
| 4,547 % fällig am 25.11.2042                                                  | 104            | 120                      | 0,01                              | <b>Polaris PLC</b>                                         | 5,014 % fällig am 23.12.2058     | 1.270                    | 1.482                             | 0,09                                                              | <b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>           | 5,434 % fällig am 25.06.2037 | 64                                | 46    | 0,00 |
| <b>American Home Mortgage Investment Trust</b>                                |                |                          |                                   | 5,024 % fällig am 23.10.2059                               | 2.954                            | 3.450                    | 0,21                              | <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>                 | 6,234 % fällig am 25.07.2035                             | 375                          | 320                               | 0,02  |      |
| 6,500 % fällig am 25.03.2047                                                  | \$ 353         | 195                      | 0,01                              | <b>Primrose Residential DAC</b>                            | 3,399 % fällig am 24.10.2061     | € 3.594                  | 3.596                             | 0,22                                                              | <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b> | 4,419 % fällig am 25.07.2036 | 34                                | 29    | 0,00 |
| <b>Atlas Funding PLC</b>                                                      |                |                          |                                   | <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>              | 4,754 % fällig am 25.03.2047     | \$ 905                   | 715                               | 0,04                                                              | 4,694 % fällig am 25.11.2037                             | 1.562                        | 1.244                             | 0,08  |      |
| 5,374 % fällig am 20.01.2061                                                  | £ 1.452        | 1.704                    | 0,10                              | 4,794 % fällig am 25.07.2036                               | 1.166                            | 322                      | 0,02                              | 4,714 % fällig am 25.06.2035                                      | 3.458                                                    | 2.681                        | 0,16                              |       |      |
| <b>Avon Finance PLC</b>                                                       |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.06.2046                               | 322                              | 59                       | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.06.2047                                      | 2.267                                                    | 1.864                        | 0,12                              |       |      |
| 5,139 % fällig am 28.12.2049                                                  | 3.448          | 4.031                    | 0,25                              | 6,000 % fällig am 25.05.2037                               | 39                               | 28                       | 0,00                              | 5,274 % fällig am 25.10.2047                                      | 810                                                      | 676                          | 0,04                              |       |      |
| <b>Banc of America Funding Trust</b>                                          |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.06.2037                               | 272                              | 186                      | 0,01                              | <b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>                           | 5,484 % fällig am 25.05.2037                             | 2.098                        | 1.755                             | 0,11  |      |
| 5,032 % fällig am 20.05.2047                                                  | \$ 46          | 37                       | 0,00                              | <b>Residential Asset Securitization Trust</b>              | 5,750 % fällig am 25.02.2036     | 1.211                    | 706                               | 0,04                                                              | <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>               | 4,704 % fällig am 25.07.2036 | 64                                | 49    | 0,00 |
| <b>Barley Hill PLC</b>                                                        |                |                          |                                   | <b>Resloc UK PLC</b>                                       | 2,135 % fällig am 15.12.2043     | € 558                    | 543                               | 0,03                                                              | <b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>                    |                              |                                   |       |      |
| 5,144 % fällig am 27.08.2058                                                  | £ 58           | 68                       | 0,01                              | <b>RMAC PLC</b>                                            | 5,437 % fällig am 15.02.2047     | £ 2.938                  | 3.443                             | 0,21                                                              | 4,734 % fällig am 25.05.2036                             | 1.889                        | 847                               | 0,05  |      |
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                            |                |                          |                                   | <b>RMAC Securities PLC</b>                                 | 4,508 % fällig am 12.06.2044     | 42                       | 48                                | 0,00                                                              | 4,734 % fällig am 25.06.2036                             | 4.495                        | 1.799                             | 0,11  |      |
| 4,967 % fällig am 25.07.2033                                                  | \$ 2           | 1                        | 0,00                              | 4,528 % fällig am 12.06.2044                               | 730                              | 833                      | 0,05                              | <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>                        | 4,734 % fällig am 25.10.2036                             | 2.859                        | 795                               | 0,05  |      |
| 5,036 % fällig am 25.07.2036                                                  | 210            | 137                      | 0,01                              | <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>         | 4,814 % fällig am 25.06.2036     | \$ 34                    | 28                                | 0,00                                                              | <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>            | 4,684 % fällig am 25.07.2036 | 286                               | 221   | 0,01 |
| 7,080 % fällig am 25.10.2035                                                  | 18             | 15                       | 0,00                              | 4,932 % fällig am 19.07.2035                               | 1                                | 1                        | 0,00                              | <b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>                      | 4,574 % fällig am 25.12.2036                             | 2.504                        | 1.021                             | 0,06  |      |
| <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>                           |                |                          |                                   | 5,132 % fällig am 19.12.2034                               | 41                               | 32                       | 0,00                              | <b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>       | 4,734 % fällig am 25.07.2036                             | 371                          | 297                               | 0,02  |      |
| 4,120 % fällig am 26.12.2046                                                  | 49             | 33                       | 0,00                              | 5,132 % fällig am 19.02.2035                               | 48                               | 39                       | 0,00                              | <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                            |                                                          |                              |                                   |       |      |
| <b>Canada Square Funding PLC</b>                                              |                |                          |                                   | 6,226 % fällig am 25.02.2036                               | 145                              | 105                      | 0,01                              | 3,719 % fällig am 25.01.2036                                      | 0                                                        | 0                            | 0,00                              |       |      |
| 5,161 % fällig am 17.01.2059                                                  | £ 3.562        | 4.166                    | 0,26                              | <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                     | 5,074 % fällig am 20.04.2051     | £ 4.142                  | 4.839                             | 0,30                                                              | 4,634 % fällig am 25.09.2037                             | 315                          | 264                               | 0,02  |      |
| <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                                           |                |                          |                                   | <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                            | 5,017 % fällig am 20.11.2063     | 2.193                    | 2.561                             | 0,16                                                              | <b>Soundview Home Loan Trust</b>                         |                              |                                   |       |      |
| 4,918 % fällig am 25.01.2036                                                  | \$ 1.536       | 1.220                    | 0,08                              | <b>Twin Bridges PLC</b>                                    | 4,898 % fällig am 12.09.2055     |                          | 4.934                             | 0,30                                                              | 4,934 % fällig am 25.10.2036                             | 3.765                        | 3.075                             | 0,19  |      |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037                                                  | 89             | 32                       | 0,00                              | 5,089 % fällig am 12.03.2055                               | 3.098                            | 3.621                    | 0,22                              |                                                                   |                                                          | 17.128                       | 1,05                              |       |      |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                                    |                |                          |                                   |                                                            |                                  |                          |                                   | <b>ABS SONSTIGE</b>                                               |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,978 % fällig am 25.08.2035                                                  | 166            | 131                      | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   | <b>Accunia European CLO DAC</b>                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 6,310 % fällig am 25.11.2035                                                  | 12             | 10                       | 0,00                              |                                                            |                                  |                          |                                   | 3,229 % fällig am 15.07.2030                                      | € 1.340                                                  | 1.342                        | 0,08                              |       |      |
| 6,756 % fällig am 25.03.2034                                                  | 1              | 1                        | 0,00                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,841 % fällig am 25.09.2035                                                  | 386            | 296                      | 0,02                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,400 % fällig am 25.06.2037                                                  | 23             | 19                       | 0,00                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,854 % fällig am 25.07.2046                                                  | 98             | 75                       | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,884 % fällig am 25.09.2035                                                  | 1.312          | 680                      | 0,04                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 5,096 % fällig am 20.11.2035                                                  | 217            | 182                      | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035                                                  | 3              | 2                        | 0,00                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 5,399 % fällig am 25.12.2035                                                  | 3              | 2                        | 0,00                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036                                                  | 185            | 71                       | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037                                                  | 284            | 114                      | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>                      |                |                          |                                   |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 3,655 % fällig am 25.04.2035                                                  | 78             | 52                       | 0,00                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 4,048 % fällig am 20.05.2036                                                  | 38             | 30                       | 0,00                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 5,014 % fällig am 25.04.2035                                                  | 83             | 67                       | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                                                  | 117            | 92                       | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 5,174 % fällig am 25.02.2035                                                  | 120            | 95                       | 0,01                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| <b>Curzon Mortgages PLC</b>                                                   |                |                          |                                   |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                                                  | £ 8.319        | 9.741                    | 0,60                              |                                                            |                                  |                          |                                   |                                                                   |                                                          |                              |                                   |       |      |



| BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Adagio CLO DAC</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Lehman XS Trust</b>                            |                |                          |                                   | <b>6,375 % fällig am 30.01.2034</b>               | \$ 6.400       | € 5.350                  | 0,33                              |
| 3,203 % fällig am 10.10.2031                          | € 2.957        | € 2.961                  | 0,18                              | 6,500 % fällig am 25.06.2046                      | \$ 2.038       | € 1.493                  | 0,09                              | <b>Saudi Arabia Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| <b>Anchorage Capital Europe CLO DAC</b>               |                |                          |                                   |                                                   |                | 1.514                    | 0,09                              | 3,250 % fällig am 22.10.2030                      | 3.400          | 2.718                    | 0,17                              |
| 3,499 % fällig am 15.10.2038                          | 4.900          | 4.893                    | 0,30                              |                                                   |                | 210.679                  | 12,86                             | 5,000 % fällig am 16.01.2034                      | 8.600          | 7.347                    | 0,45                              |
| <b>Arcano Euro CLO DAC</b>                            |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 13.01.2028                      | 10.300         | 8.923                    | 0,54                              |
| 0,000 % fällig am 25.07.2039 (b)                      | 2.000          | 2.000                    | 0,12                              | <b>Adif Alta Velocidad</b>                        |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 13.01.2031                      | 2.000          | 1.768                    | 0,11                              |
| <b>Aurium CLO DAC</b>                                 |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 31.01.2030                      | € 1.900        | 1.925                    | 0,12                              | <b>Slovenia Government International Bond</b>     |                |                          |                                   |
| 2,922 % fällig am 16.04.2030                          | 5.575          | 5.577                    | 0,34                              | 3,625 % fällig am 30.04.2035                      | 4.600          | 4.633                    | 0,28                              | 1,175 % fällig am 13.02.2062                      | € 3.310        | 1.611                    | 0,10                              |
| 2,982 % fällig am 16.01.2031                          | 4.405          | 4.400                    | 0,27                              | <b>Austria Government International Bond</b>      |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 10.03.2034                      | 700            | 701                      | 0,04                              |
| <b>Bain Capital Euro CLO DAC</b>                      |                |                          |                                   | 2,100 % fällig am 20.09.2117                      | 3.200          | 1.961                    | 0,12                              | 3,500 % fällig am 14.04.2055                      | 5.900          | 5.588                    | 0,34                              |
| 2,976 % fällig am 20.01.2032                          | 2.655          | 2.649                    | 0,16                              | 2,900 % fällig am 20.02.2033                      | 6.500          | 6.564                    | 0,40                              | <b>Spain Government International Bond</b>        |                |                          |                                   |
| <b>Barings Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   | 2,950 % fällig am 20.02.2035                      | 7.600          | 7.585                    | 0,46                              | 0,100 % fällig am 30.04.2031                      | 300            | 260                      | 0,02                              |
| 3,259 % fällig am 15.10.2034                          | 1.400          | 1.395                    | 0,09                              | 3,800 % fällig am 26.01.2062                      | 6.900          | 7.137                    | 0,44                              | 0,600 % fällig am 31.10.2029                      | 16.600         | 15.389                   | 0,94                              |
| <b>BBVA Consumo FTA</b>                               |                |                          |                                   | 4,150 % fällig am 15.03.2037                      | 15.600         | 17.125                   | 1,04                              | 0,850 % fällig am 30.07.2037                      | 1.100          | 823                      | 0,05                              |
| 2,757 % fällig am 21.08.2038                          | 7.700          | 7.718                    | 0,47                              | <b>Autonomous Community of Catalonia</b>          |                |                          |                                   | 1,900 % fällig am 31.10.2052                      | 20.500         | 13.589                   | 0,83                              |
| <b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>                  |                |                          |                                   | 4,220 % fällig am 26.04.2035                      | 1.600          | 1.647                    | 0,10                              | 3,150 % fällig am 30.04.2033                      | 3.254          | 3.307                    | 0,20                              |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031                          | 50             | 49                       | 0,00                              | <b>Belgium Government International Bond</b>      |                |                          |                                   | 3,150 % fällig am 30.04.2035                      | 2.250          | 2.247                    | 0,14                              |
| 2,999 % fällig am 15.01.2031                          | 2.277          | 2.279                    | 0,14                              | 1,400 % fällig am 22.06.2053                      | 1.800          | 1.038                    | 0,06                              | 3,200 % fällig am 31.10.2035                      | 32.400         | 32.319                   | 1,97                              |
| 3,189 % fällig am 15.01.2033                          | 1.998          | 1.997                    | 0,12                              | 1,600 % fällig am 22.06.2047                      | 7.600          | 5.134                    | 0,31                              | 3,250 % fällig am 30.04.2034                      | 1.475          | 1.497                    | 0,09                              |
| <b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   | 2,850 % fällig am 22.10.2034                      | 3.500          | 3.440                    | 0,21                              | 3,450 % fällig am 30.07.2043                      | 10.100         | 9.680                    | 0,59                              |
| 2,929 % fällig am 15.10.2031                          | 1.031          | 1.029                    | 0,06                              | 3,100 % fällig am 22.06.2035                      | 5.200          | 5.181                    | 0,32                              | 3,450 % fällig am 30.07.2066                      | 10.000         | 8.747                    | 0,53                              |
| <b>Bridgepoint CLO DAC</b>                            |                |                          |                                   | <b>Cassa Depositi e Prestiti SpA</b>              |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 31.01.2041                      | 1.500          | 1.469                    | 0,09                              |
| 3,489 % fällig am 15.01.2034                          | 1.583          | 1.584                    | 0,10                              | 5,875 % fällig am 30.04.2029                      | \$ 1.500       | 1.338                    | 0,08                              | 3,900 % fällig am 30.07.2039                      | 100            | 104                      | 0,01                              |
| <b>Cairn CLO DAC</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Europäische Finanzstabilisierungsfazilität</b> |                |                          |                                   | <b>Treasury Corp. of Victoria</b>                 |                |                          |                                   |
| 2,856 % fällig am 31.01.2030                          | 3.933          | 3.923                    | 0,24                              | 2,875 % fällig am 13.02.2034                      | € 24.300       | 24.343                   | 1,49                              | 2,000 % fällig am 17.09.2035                      | AUD 25.100     | 10.701                   | 0,65                              |
| <b>Carlyle Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   | <b>Europäische Union</b>                          |                |                          |                                   | <b>United Kingdom Gilt</b>                        |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 15.08.2038 (b)                      | 8.000          | 8.000                    | 0,49                              | 0,450 % fällig am 04.07.2041                      | 8.600          | 5.423                    | 0,33                              | 4,375 % fällig am 07.03.2030                      | £ 65.400       | 77.715                   | 4,74                              |
| <b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC</b>  |                |                          |                                   | 0,450 % fällig am 02.05.2046                      | 930            | 507                      | 0,03                              | 4,750 % fällig am 22.10.2043                      | 11.700         | 13.061                   | 0,80                              |
| 2,888 % fällig am 25.01.2032                          | 3.835          | 3.833                    | 0,23                              | 0,750 % fällig am 04.01.2047                      | 1.600          | 931                      | 0,06                              |                                                   |                | 688.730                  | 42,02                             |
| <b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.</b> |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 04.10.2052                      | 2.100          | 1.632                    | 0,10                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,893 % fällig am 15.11.2031                          | 2.317          | 2.319                    | 0,14                              | 2,625 % fällig am 04.02.2048                      | 2.000          | 1.673                    | 0,10                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Contego CLO BV</b>                                 |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 04.02.2050                      | 29.600         | 27.184                   | 1,66                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,049 % fällig am 15.10.2030                          | 644            | 645                      | 0,04                              | 3,375 % fällig am 04.10.2039                      | 15.200         | 15.054                   | 0,92                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Contego CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 04.11.2042                      | 1.550          | 1.509                    | 0,09                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,823 % fällig am 23.01.2030                          | 4.573          | 4.567                    | 0,28                              | 3,375 % fällig am 05.10.2054                      | 500            | 456                      | 0,03                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>CVC Cordatus Loan Fund DAC</b>                     |                |                          |                                   | <b>France Government International Bond</b>       |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,929 % fällig am 15.10.2031                          | 2.171          | 2.172                    | 0,13                              | 0,750 % fällig am 25.05.2052                      | 2.900          | 1.382                    | 0,08                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC</b>         |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 25.05.2050                      | 31.800         | 19.671                   | 1,20                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,983 % fällig am 15.08.2033                          | 4.611          | 4.598                    | 0,28                              | 2,750 % fällig am 25.02.2029                      | 40.800         | 41.381                   | 2,52                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Dillon's Park CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 25.05.2033                      | 18.200         | 18.183                   | 1,11                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,299 % fällig am 15.10.2034                          | 2.000          | 1.997                    | 0,12                              | 3,250 % fällig am 25.05.2055                      | 3.000          | 2.595                    | 0,16                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Dryden Euro CLO DAC</b>                            |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 25.05.2056                      | 1.800          | 1.702                    | 0,10                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,236 % fällig am 18.10.2034                          | 1.400          | 1.396                    | 0,09                              | 4,000 % fällig am 25.10.2038                      | 5.400          | 5.668                    | 0,35                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>FTA Consumo Santander</b>                          |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.04.2029                      | 20.900         | 23.269                   | 1,42                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,860 % fällig am 21.01.2040                          | 7.900          | 7.927                    | 0,48                              | <b>Hungary Government International Bond</b>      |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Ginkgo Sales Finance</b>                           |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 26.03.2036                      | \$ 6.800       | 5.595                    | 0,34                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,589 % fällig am 25.11.2049                          | 2.637          | 2.644                    | 0,16                              | <b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>          |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Harvest CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   | 2,550 % fällig am 15.05.2056 (e)                  | € 2.946        | 3.044                    | 0,19                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,916 % fällig am 20.10.2031                          | 3.081          | 3.080                    | 0,19                              | 2,800 % fällig am 01.03.2067                      | 16.500         | 11.945                   | 0,73                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,919 % fällig am 15.10.2031                          | 3.194          | 3.194                    | 0,19                              | 3,044 % fällig am 15.10.2028                      | 2.000          | 2.035                    | 0,12                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,039 % fällig am 15.07.2031                          | 4.016          | 4.019                    | 0,25                              | 3,150 % fällig am 15.11.2031                      | 42.000         | 42.535                   | 2,60                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,129 % fällig am 15.01.2032                          | 5.074          | 5.071                    | 0,31                              | 3,394 % fällig am 15.10.2031                      | 13.500         | 13.874                   | 0,85                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Invesco Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.11.2030                      | 10.000         | 10.629                   | 0,65                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,929 % fällig am 15.07.2031                          | 1.148          | 1.146                    | 0,07                              | 4,300 % fällig am 01.10.2054                      | 29.400         | 29.491                   | 1,80                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,299 % fällig am 15.01.2034                          | 1.300          | 1.297                    | 0,08                              | 4,400 % fällig am 01.05.2033                      | 13.302         | 14.485                   | 0,88                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>OCP Euro CLO DAC</b>                               |                |                          |                                   | <b>Mexico Government International Bond</b>       |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,116 % fällig am 22.09.2034                          | 4.148          | 4.147                    | 0,25                              | 6,625 % fällig am 29.01.2038 (b)                  | \$ 9.500       | 8.227                    | 0,50                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>        |                |                          |                                   | <b>Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap</b>     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,999 % fällig am 15.10.2031                          | 1.345          | 1.342                    | 0,08                              | 3,500 % fällig am 22.06.2045                      | € 4.800        | 4.547                    | 0,28                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,113 % fällig am 15.08.2033                          | 4.254          | 4.255                    | 0,26                              | <b>Netherlands Government International Bond</b>  |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,203 % fällig am 15.02.2035                          | 1.600          | 1.600                    | 0,10                              | 0,000 % fällig am 15.01.2038 (c)                  | 18.600         | 12.830                   | 0,78                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>SC Germany S.A., Compartement Consumer</b>         |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 15.01.2054                      | 5.700          | 4.432                    | 0,27                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,612 % fällig am 15.09.2037                          | 3.241          | 3.250                    | 0,20                              | 2,750 % fällig am 15.01.2047                      | 9.400          | 8.836                    | 0,54                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Sculptor European CLO DAC</b>                      |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 15.01.2044                      | 10.000         | 10.198                   | 0,62                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,055 % fällig am 14.01.2032                          | 3.708          | 3.704                    | 0,23                              | <b>New South Wales Treasury Corp.</b>             |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>SLM Student Loan Trust</b>                         |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 20.09.2035 AUD                  | 6.100          | 3.386                    | 0,21                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 2,558 % fällig am 25.10.2039                          | 680            | 634                      | 0,04                              | <b>Poland Government International Bond</b>       |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Toro European CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 18.09.2034                      | \$ 8.800       | 7.543                    | 0,46                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,185 % fällig am 12.01.2032                          | 3.711          | 3.708                    | 0,23                              | <b>Queensland Treasury Corp.</b>                  |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                       | 124.341        | 7,59                     |                                   | 2,000 % fällig am 22.08.2033 AUD                  | 4.000          | 1.839                    | 0,11                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>SICHERHEITEN FÜR WHOLE LOANS</b>                   |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 22.08.2035                      | 5.000          | 2.698                    | 0,16                              |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>             |                |                          |                                   | <b>Bundesrepublik Deutschland</b>                 |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 4,594 % fällig am 25.11.2036                          | \$ 24          | 21                       | 0,00                              | 0,000 % fällig am 15.08.2050 (c)(j)               | € 700          | 332                      | 0,02                              |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | <b>Romania Government International Bond</b>      |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 28.01.2032                      | 7.700          | 6.253                    | 0,38                              |                                                   |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 30.05.2037 (i)                  | 1.900          | 1.791                    | 0,11                              |                                                   |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                             | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|---------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS                     | 1,970 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | € 23.300           | European Union 2,875 % fällig am 06.12.2027 | € (23.779)                 | € 23.300                            | € 23.301                                                            | 1,42                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                             | € (23.779)                 | € 23.300                            | € 23.301                                                            | 1,42                    |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month EURIBOR December Futures                     | Short | 12.2025          | 664                     | € (616)                                         | (0,04)                  |
| 3-Month EURIBOR December Futures                     | Long  | 12.2026          | 664                     | 477                                             | 0,03                    |
| 3-Month EURIBOR September Futures                    | Short | 09.2025          | 664                     | (55)                                            | 0,00                    |
| 3-Month EURIBOR September Futures                    | Long  | 09.2026          | 664                     | 284                                             | 0,02                    |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures  | Long  | 09.2025          | 12                      | 6                                               | 0,00                    |
| Euro-Bobl September Futures                          | Long  | 09.2025          | 2.226                   | (713)                                           | (0,04)                  |
| Euro-BTP September Futures                           | Long  | 09.2025          | 718                     | 276                                             | 0,02                    |
| Euro-Bund September Futures                          | Long  | 09.2025          | 500                     | (498)                                           | (0,03)                  |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures             | Short | 09.2025          | 189                     | 425                                             | 0,03                    |
| Euro-Oat September Futures                           | Long  | 09.2025          | 158                     | (149)                                           | (0,01)                  |
| Euro-Schatz September Futures                        | Long  | 09.2025          | 3.281                   | (581)                                           | (0,04)                  |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 11                      | 8                                               | 0,00                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Short | 09.2025          | 862                     | (885)                                           | (0,05)                  |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025          | 1.255                   | 2.013                                           | 0,12                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025          | 919                     | (1.731)                                         | (0,11)                  |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025          | 86                      | (363)                                           | (0,02)                  |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2025          | 67                      | (122)                                           | (0,01)                  |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025          | 33                      | 76                                              | 0,00                    |
|                                                      |       |                  |                         | € (2.148)                                       | (0,13)                  |

### OPTIONSKAUF

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Anzahl der<br>Kontrakte | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|--------|----------------|-------------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,938           | 15.12.2025         | 447                     | € 214  | € 17           | 0,00                    |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|---------|----------------|-------------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures                        | € 97,813           | 12.12.2025         | 447                     | € (285) | € (73)         | (0,01)                  |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |                    |                    |                         |         | € (2.204)      | (0,14)                  |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

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

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000 %                        | 20.06.2030            | € 88.900                       | € 79                                            | 0,01                    |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt    | variabler<br>Zinssatz          | variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------|--------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung               | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS |                         | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 40.700        | € 228                                           | 0,01                    |
| Erhalt                | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS |                         | 3,750              | 19.03.2027            | 5.309           | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  |                         | 2,865              | 13.02.2054            | \$ 8.900        | 1.235                                           | 0,08                    |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  |                         | 3,000              | 19.03.2027            | 36.600          | (387)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  |                         | 3,500              | 20.06.2054            | 16.600          | 11                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  |                         | 3,620              | 30.11.2029            | 165.390         | (1.304)                                         | (0,08)                  |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex       | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,686 %            | 15.11.2034            | \$ 2.600        | € 5                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,701              | 15.11.2034            | 50.500          | 145                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 15.02.2035            | 9.566           | (148)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,100              | 15.11.2052            | 29.420          | (530)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 20.12.2025            | 25.400          | 115                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,750              | 18.01.2026            | 31.400          | 8                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,827              | 15.12.2025            | 31.400          | (23)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR           | 1,700              | 15.03.2073            | € 4.900         | 1.131                                           | 0,07                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 1,830              | 17.09.2027            | 20.300          | 64                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 1,895              | 08.10.2027            | 24.800          | 49                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,000              | 17.09.2027            | 86.900          | 209                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,112              | 02.09.2027            | 11.400          | (26)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,120              | 03.09.2027            | 24.000          | (60)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250              | 17.09.2035            | 128.640         | 226                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250              | 21.09.2042            | 9.900           | (264)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250              | 17.09.2055            | 48.240          | 2.828                                           | 0,17                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,500              | 19.03.2040            | 6.400           | (287)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                       | 2,125              | 15.03.2035            | 15.500          | (181)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | CPURNSA                       | 2,364              | 10.05.2028            | \$ 20.400       | (221)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | CPURNSA                       | 3,043              | 21.02.2026            | 32.900          | (148)                                           | (0,01)                  |
|                                                |                               |                    |                       |                 | € 2.677                                         | 0,16                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                               |                    |                       |                 | € 2.756                                         | 0,17                    |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|-------------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                                 | 3,650 %            | 04.12.2025         | 202.300                        | € 398  | € 552          | 0,03                    |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld   | Markt-<br>wert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|-----------|----------------|-------------------------|
| BRC        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,440 %            | 25.01.2027         | 6.200                          | € (52)    | € (52)         | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,440              | 25.01.2027         | 6.200                          | (52)      | (33)           | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,740              | 08.09.2025         | 6.200                          | (133)     | (103)          | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,740              | 08.09.2025         | 6.200                          | (133)     | (35)           | 0,00                    |
| GLM        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,350              | 07.01.2027         | 22.100                         | (194)     | (169)          | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,350              | 07.01.2027         | 22.100                         | (194)     | (132)          | (0,01)                  |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,500              | 14.01.2027         | 40.200                         | (358)     | (376)          | (0,02)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,500              | 14.01.2027         | 40.200                         | (358)     | (198)          | (0,01)                  |
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 6-Month GBP-SONIA       | Erhalt                                  | 3,150              | 04.12.2025         | 202.300                        | (130)     | (151)          | (0,01)                  |
| MYI        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                                 | 4,000              | 15.08.2025         | 53.100                         | (347)     | (41)           | 0,00                    |
|            |                                       |                         |                                         |                    |                    |                                | € (1.951) | € (1.290)      | (0,08)                  |

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

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD 1.820              | € 1.016                  | € 0                              | € 0                                | € 0                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CHF 487                | \$ 610                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH 9.260              | 1.285                    | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 11                  | AUD 17                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 3.667                  | € 3.227                  | 103                              | 0                                  | 103                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025               | 638                    | NZD 1.061                | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | AUD 17                 | \$ 11                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 24.237             | 3.381                    | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 08.2025               | NZD                    | 1.061                    | \$ 639                           | € 0                                | € (5)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 610                      | CHF 485                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CHF                    | 3.207                    | € 3.425                          | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 2.237                    | \$ 2.526                         | 0                                  | (85)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | KRW                    | 1.482.716                | 1.088                            | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 112                      | 87                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 158.882                  | € 139.732                        | 4.381                              | 0                                                    | 0,27                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.016                    | IDR 16.570.067                   | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 475                      | SGD 609                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 607                      | \$ 475                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 08.2025               | TWD                    | 373                      | 11                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 221                      | 39                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CHF                    | 197                      | € 210                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | DKK                    | 27.511                   | 3.689                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 2.715                    | 235                              | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 1.246                    | \$ 38                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 70.037                   | 2.155                            | 0                                  | (218)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.130                    | BRL 6.290                        | 19                                 | 19                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.164                    | IDR 35.308.251                   | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 160                      | THB 5.240                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               |                        | 635                      | TWD 18.899                       | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 21.349                   | \$ 2.988                         | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 89.035                   | 2.828                            | 0                                  | (227)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.746                    | INR 151.743                      | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 2.014                    | TWD 58.384                       | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 01.2026               | DKK                    | 138.500                  | € 18.634                         | 41                                 | 41                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | AUD                    | 17                       | \$ 11                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 2.048                    | ¥ 334.929                        | 0                                  | (73)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.202                    | \$ 3.718                         | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 8.322                    | € 9.794                          | 79                                 | 79                                                   | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | ILS                    | 9.257                    | € 2.659                          | 0                                  | (77)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | ¥                      | 273.143                  | € 1.615                          | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 187.077                  | \$ 137                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 981                      | € 85                             | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 199                      | \$ 20                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 297                      | 79                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 2.131                    | 53                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.318                    | ILS 4.451                        | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 28                       | KRW 38.199                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.824                    | ZAR 32.975                       | 24                                 | 24                                                   | 0,00                    |
| DUB        | 08.2025               | €                      | 1.615                    | ¥ 272.736                        | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | AUD                    | 246                      | € 139                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CAD                    | 19.033                   | 12.180                           | 297                                | 297                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025               | CNY                    | 9.858                    | \$ 1.378                         | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 3.701                    | £ 3.153                          | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 301                      | NOK 3.566                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 12.116.300               | \$ 8.840                         | 0                                  | (101)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | THB                    | 65.203                   | 1.961                            | 0                                  | (40)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 122.287                  | 3.759                            | 0                                  | (384)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 14.899                   | BRL 85.219                       | 609                                | 609                                                  | 0,04                    |
| GLM        | 07.2025               |                        | 1.167                    | CNY 8.369                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.834                    | IDR 29.858.315                   | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.053                    | TWD 31.212                       | 18                                 | 18                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 3.142                    | \$ 437                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 3.573                    | € 301                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 135.479                  | \$ 4.158                         | 0                                  | (468)                                                | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 10.473                   | INR 903.016                      | 32                                 | 27                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 4.764                    | \$ 248                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 136.187                  | 157.990                          | 0                                  | (1.595)                                              | (0,10)                  |
|            | 07.2025               | ILS                    | 4.495                    | 1.297                            | 0                                  | (32)                                                 | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | KRW                    | 190.907                  | 140                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 109                      | 84                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 139                      | IDR 2.263.425                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 242                      | TWD 7.211                        | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 10.277                   | \$ 1.423                         | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 157.990                  | € 135.888                        | 1.590                              | 0                                                    | 0,10                    |
|            | 08.2025               |                        | 5.022                    | INR 433.689                      | 21                                 | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 2                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 97.333                   | 17.656                           | 0                                  | (151)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | DKK                    | 285                      | € 38                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025               | €                      | 12.180                   | CAD 19.413                       | 0                                  | (60)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 3.310                    | ¥ 539.277                        | 0                                  | (130)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | TWD                    | 12.738                   | \$ 392                           | 0                                  | (40)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 435                      | IDR 7.082.524                    | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 217                      | SGD 277                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 72                       | TWD 2.345                        | 7                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CAD                    | 19.424                   | € 12.180                         | 59                                 | 59                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 5.791                    | \$ 808                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 276                      | 217                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 1.065                    | BRL 5.962                        | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               |                        | 16.592                   | 93.555                           | 135                                | 135                                                  | 0,01                    |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| JPM        | 07.2025               | CNH                    | 8.348                    | \$ 1.157                         | € 0                                | € (9)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 294                      | DKK 2.197                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 631.953                  | € 3.743                          | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 1.085.319                | \$ 793                           | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 493                      | € 260                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.061                    | \$ 633                           | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 3.188                    | 849                              | 0                                  | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 4.196                    | 3.266                            | 0                                  | (24)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 73.499                   | 2.260                            | 0                                  | (230)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.096                    | BRL 6.033                        | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 10.376                   | PLN 38.352                       | 198                                | 198                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 311                      | SGD 399                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 523                      | ZAR 9.350                        | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 22.641                   | \$ 3.156                         | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DKK                    | 2.196                    | € 294                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | €                      | 3.743                    | ¥ 630.975                        | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 398                      | \$ 311                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 109.473                  | 3.499                            | 0                                  | (260)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.952                    | INR 169.241                      | 14                                 | 14                                                   | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | AUD                    | 965                      | € 550                            | 11                                 | 11                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CHF                    | 1.513                    | 1.622                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 4.559                    | \$ 633                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | DKK                    | 18.701                   | € 2.508                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 925                      | £ 776                            | 0                                  | (19)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 101                      | NOK 1.187                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 712                      | SEK 7.885                        | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NZD                    | 314                      | € 166                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PLN                    | 2.279                    | \$ 609                           | 0                                  | (19)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SEK                    | 3.380                    | € 311                            | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 10.079                   | \$ 7.857                         | 0                                  | (48)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB                    | 32.731                   | 989                              | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 33.871                   | 1.039                            | 0                                  | (108)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 593                      | CHF 487                          | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 444                      | IDR 7.223.261                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 8.214                    | SGD 10.622                       | 107                                | 107                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 46                       | TWD 1.375                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 4.572                    | \$ 633                           | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 1.189                    | € 101                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SEK                    | 7.885                    | 712                              | 7                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 10.597                   | \$ 8.214                         | 0                                  | (109)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | TWD                    | 51.196                   | 1.580                            | 0                                  | (170)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.072                    | CNH 14.825                       | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 01.2026               | DKK                    | 54.977                   | € 7.382                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 04.2026               |                        | 201.335                  | 27.070                           | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | €                      | 1.333                    | \$ 1.544                         | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 187                      | NOK 1.882                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 30                       | PLN 111                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 18.612                   | \$ 2.600                         | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 1.882                    | 187                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 04.2026               | DKK                    | 97.000                   | € 13.053                         | 17                                 | 17                                                   | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025               | SEK                    | 2.490                    | 227                              | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025               | KRW                    | 13.575                   | \$ 10                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | NOK                    | 1.925                    | € 167                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | SEK                    | 2.015                    | 185                              | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 2.630.000                | 16.079                           | 544                                | 544                                                  | 0,03                    |
| SCX        | 07.2025               | AUD                    | 50.463                   | 28.644                           | 472                                | 472                                                  | 0,03                    |
|            | 07.2025               | €                      | 29.826                   | AUD 53.494                       | 39                                 | 39                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 5.841                    | DKK 43.575                       | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £                      | 148.373                  | € 176.453                        | 3.244                              | 3.244                                                | 0,20                    |
|            | 07.2025               | ILS                    | 68                       | \$ 20                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 4.440                    | 152                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 208                      | CNY 1.492                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 2.021                    | IDR 32.938.550                   | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 1.640                    | SGD 2.116                        | 18                                 | 18                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 408                      | TWD 12.125                       | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | AUD                    | 53.494                   | € 29.778                         | 0                                  | (41)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 37.881                   | \$ 5.301                         | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNY                    | 1.488                    | 208                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DKK                    | 43.564                   | € 5.841                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | ¥                      | 4.420.000                | 27.302                           | 1.171                              | 1.171                                                | 0,07                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 2.111                    | \$ 1.640                         | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 19.011                   | 583                              | 0                                  | (66)                                                 | 0,00                    |
| SOG        | 08.2025               | \$                     | 1.525                    | INR 130.958                      | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 561                      | CHF 525                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 20                       | NOK 196                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CHF                    | 524                      | € 561                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | NOK                    | 196                      | \$ 20                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 08.2025               | \$                     | 12                       | INR 1.011                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 181.620                  | £ 154.988                        | 0                                  | (688)                                                | (0,04)                  |
|            | 08.2025               | £                      | 155.307                  | € 181.620                        | 684                                | 684                                                  | 0,04                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.371                    | INR 118.046                      | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |         |   |       |      |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|---------|---|-------|------|
| UAG        | 07.2025               | €                      | 4.600                    | CHF                              | 4.313                              | €                                                    | 16                      | 0,00    |   |       |      |
|            | 07.2025               | ILS                    | 680                      | \$                               | 190                                | (11)                                                 | (11)                    | 0,00    |   |       |      |
|            | 07.2025               | KRW                    | 168.865                  |                                  | 125                                | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |      |
|            | 07.2025               | NOK                    | 1.879                    |                                  | 185                                | (1)                                                  | (1)                     | 0,00    |   |       |      |
|            | 07.2025               | THB                    | 5.197                    |                                  | 156                                | (3)                                                  | (3)                     | 0,00    |   |       |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 125                      | KRW                              | 168.946                            | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |      |
|            | 08.2025               | CHF                    | 4.304                    | €                                | 4.600                              | (16)                                                 | (16)                    | 0,00    |   |       |      |
|            | 09.2025               | \$                     | 3.585                    | MXN                              | 69.495                             | 0                                                    | 54                      | 0,00    |   |       |      |
|            |                       |                        |                          |                                  | €                                  | 14.239                                               | €                       | (5.814) | € | 8.425 | 0,52 |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |   |       |        |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|---|-------|--------|
| BOA                              | 07.2025               | €                      | 95.962                   | CHF                              | 89.610                             | €                                                    | 0                       | € | (60)  | (0,01) |
| BRC                              | 07.2025               |                        | 75.401                   |                                  | 70.427                             |                                                      | 0                       |   | (28)  | 0,00   |
| GLM                              | 07.2025               |                        | 2.141                    |                                  | 2.000                              |                                                      | 0                       |   | (1)   | 0,00   |
| JPM                              | 07.2025               |                        | 11.214                   |                                  | 10.477                             |                                                      | 0                       |   | (2)   | 0,00   |
| MBC                              | 07.2025               | CHF                    | 72                       | €                                | 77                                 |                                                      | 0                       |   | 0     | 0,00   |
|                                  | 07.2025               | €                      | 5.632                    | CHF                              | 5.249                              |                                                      | 0                       |   | (15)  | 0,00   |
| RBC                              | 07.2025               |                        | 90.995                   |                                  | 85.000                             |                                                      | 0                       |   | (25)  | 0,00   |
| RYL                              | 07.2025               | CHF                    | 35                       | €                                | 37                                 |                                                      | 0                       |   | 0     | 0,00   |
|                                  | 07.2025               | €                      | 15                       | CHF                              | 14                                 |                                                      | 0                       |   | 0     | 0,00   |
| SOG                              | 07.2025               | CHF                    | 77.779                   | €                                | 83.181                             |                                                      | 0                       |   | (60)  | 0,00   |
|                                  | 08.2025               | €                      | 83.181                   | CHF                              | 77.628                             |                                                      | 62                      |   | 0     | 0,00   |
| UAG                              | 07.2025               | CHF                    | 78.255                   | €                                | 83.467                             |                                                      | 0                       |   | (283) | (0,02) |
|                                  | 08.2025               | €                      | 83.467                   | CHF                              | 78.102                             |                                                      | 285                     |   | 0     | 0,02   |
|                                  |                       |                        |                          | €                                | 347                                | €                                                    | (474)                   | € | (127) | (0,01) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         | € | 7.560 | 0,46   |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                          |                                   |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 9.500       | € 971                    | 0,06                              |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | € 971                    | 0,06                              |
| Summe Anlagen                              |                | € 1.876.596              | 114,50                            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |                | € (237.698)              | (14,50)                           |
| Nettovermögen                              |                | € 1.638.898              | 100,00                            |

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

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

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 2.358 EUR (31. Dezember 2024: 617 EUR) als Sicherheiten verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 332 EUR (31. Dezember 2024: 1.158 EUR) und Barmittel in Höhe von 1.353 EUR (31. Dezember 2024: 5.854 EUR) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 37 EUR (31. Dezember 2024: 42 EUR) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 23.352 EUR (31. Dezember 2024: 32.651 EUR) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert          |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | € 0                                                                         | € 1.760.353                                                     | € 14.566                                                     | € 1.774.919        |
| Investmentfonds                     | 69.294                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 69.294             |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 23.300                                                          | 0                                                            | 23.300             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (1.124)                                                                     | 9.236                                                           | 0                                                            | 8.112              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 971                                                             | 0                                                            | 971                |
| <b>Summen</b>                       | <b>€ 68.170</b>                                                             | <b>€ 1.793.860</b>                                              | <b>€ 14.566</b>                                              | <b>€ 1.876.596</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert          |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | € 0                                                                         | € 1.705.987                                                     | € 5.051                                                      | € 1.711.038        |
| Investmentfonds                     | 0                                                                           | 148.602                                                         | 0                                                            | 148.602            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (6.711)                                                                     | (7.868)                                                         | 0                                                            | (14.579)           |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 1.147                                                           | 0                                                            | 1.147              |
| <b>Summen</b>                       | <b>€ (6.711)</b>                                                            | <b>€ 1.847.868</b>                                              | <b>€ 5.051</b>                                               | <b>€ 1.846.208</b> |

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

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:**

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC                                       | 1,500 %         | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (1.428)         | € (1.429)                                                       | (0,09)                  |
|                                           |                 | 20.12.2024            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (640)          | (552)                                                           | (0,03)                  |
| MYI                                       | 1,500           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (362)           | (362)                                                           | (0,02)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                   | <b>€ (2.343)</b>                                                | <b>(0,14)</b>           |

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | € 83                                | € 0                                   | € 83                                | € 30                                | € 0                                   | € 30                                |
| BOA        | 4.224                               | (3.830)                               | 394                                 | (127)                               | 0                                     | (127)                               |
| BPS        | (331)                               | 370                                   | 39                                  | (209)                               | 280                                   | 71                                  |
| BRC        | (331)                               | 140                                   | (191)                               | (1.298)                             | 1.153                                 | (145)                               |
| CBK        | (59)                                | 233                                   | 174                                 | (179)                               | (250)                                 | (429)                               |
| DUB        | (28)                                | 0                                     | (28)                                | 320                                 | (430)                                 | (110)                               |
| GLM        | (1.049)                             | 0                                     | (1.049)                             | (1.013)                             | 1.160                                 | 147                                 |
| GST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (443)                               | 440                                   | (3)                                 |
| JPM        | (359)                               | 308                                   | (51)                                | 362                                 | (291)                                 | 71                                  |
| MBC        | (344)                               | 290                                   | (54)                                | (2.742)                             | 1.516                                 | (1.226)                             |
| MYC        | 401                                 | (360)                                 | 41                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MYI        | (47)                                | 0                                     | (47)                                | (34)                                | 24                                    | (10)                                |
| RBC        | (20)                                | 344                                   | 324                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| RYL        | 554                                 | (550)                                 | 4                                   | (498)                               | 300                                   | (198)                               |
| SCX        | 4.825                               | (4.479)                               | 346                                 | (2.236)                             | 2.139                                 | (97)                                |
| SOG        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | (25)                                | 0                                     | (25)                                |
| SSB        | (2)                                 | 0                                     | (2)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| UAG        | 41                                  | 0                                     | 41                                  | (70)                                | (370)                                 | (440)                               |

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



## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 59,54             | 53,28             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 20,18             | 23,92             |
| Investmentfonds                                                        | 3,11              | 6,71              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 1,05              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,16              | 0,25              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,28              | 0,23              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,68              | 0,04              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,04              | 0,05              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 14,96             | 15,52             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                      | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                         | 0,31              | 0,31              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                           | 25,44             | 26,06             |
| US-Regierungsbehörden                                      | 14,37             | 14,70             |
| US-Schatzobligationen                                      | 2,80              | 3,43              |
| Non-Agency-MBS                                             | 7,95              | 6,02              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                           | 12,86             | 9,01              |
| Staatsemissionen                                           | 42,02             | 35,17             |
| Vorzugswertpapiere                                         | 0,01              | 0,01              |
| Kurzfristige Instrumente                                   | 2,54              | 7,40              |
| Investmentfonds                                            | 4,23              | 8,87              |
| Pensionsgeschäfte                                          | 1,42              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                   |                   |
| Futures                                                    | (0,13)            | (0,19)            |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01)            | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                        |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf     | 0,01              | (0,01)            |
| Zinsswaps                                                  | 0,16              | (0,18)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                 |                   |                   |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | 0,03              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | (0,08)            | (0,10)            |
| Devisenterminkontrakte                                     | 0,52              | (0,20)            |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                        | (0,01)            | (0,19)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                        | 0,06              | 0,07              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                | (14,50)           | (10,18)           |
| Nettovermögen                                              | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                                       |                |                          |                                   |                                                                  |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                               |                |                          |                                   |                                                                  |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| <b>BANKEN UND FINANZEN</b>                                                            |                |                          |                                   |                                                                  |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| <b>ABN AMRO Bank NV</b>                                                               |                |                          |                                   | <b>Clydesdale Bank PLC</b>                                       |                |                          |                                   | <b>Jyske Realkredit A/S</b>                        |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am                                                                     |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 22.08.2028                                     | € 500          | € 519                    | 0,11                              | 0,500 % fällig am 01.10.2043 DKK                   | 0              | € 0                      | 0,00                              |
| 22.09.2025 (e)(f)                                                                     | € 1.000        | € 1.003                  | 0,20                              |                                                                  |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 4,375 % fällig am 20.10.2028                                                          | 1.100          | 1.156                    | 0,24                              | <b>Commerzbank AG</b>                                            | 2.300          | 2.291                    | 0,47                              | 1,000 % fällig am 01.10.2053                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>Acef Holding S.C.A.</b>                                                            |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 17.09.2030                                     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2037                       | 220            | 27                       | 0,01                              |
| 0,750 % fällig am 14.06.2028                                                          | 700            | 660                      | 0,13                              | 6,125 % fällig am                                                | 1.000          | 1.009                    | 0,21                              | 1,500 % fällig am 01.10.2050                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>American Tower Corp.</b>                                                           |                |                          |                                   | 09.10.2025 (e)(f)                                                |                |                          |                                   | <b>KEB Hana Bank</b>                               |                |                          |                                   |
| 0,875 % fällig am 21.05.2029                                                          | 1.100          | 1.020                    | 0,21                              | <b>Cooperative Rabobank UA</b>                                   | 2.000          | 1.967                    | 0,40                              | 2,875 % fällig am 23.01.2028                       | € 900          | 908                      | 0,19                              |
| <b>Amvest RCF Custodian BV</b>                                                        |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am                                                |                |                          |                                   | <b>Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.</b>      |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 11.06.2031                                                          | 600            | 598                      | 0,12                              | 29.12.2026 (e)(f)                                                | 1.900          | 1.928                    | 0,39                              | 3,250 % fällig am 12.11.2025                       | 695            | 690                      | 0,14                              |
| <b>Athene Global Funding</b>                                                          |                |                          |                                   | <b>Credit Agricole Home Loan SFH S.A.</b>                        |                |                          |                                   | <b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>             |                |                          |                                   |
| 3,410 % fällig am 25.02.2030                                                          | 1.100          | 1.106                    | 0,23                              | <b>Credit Agricole S.A.</b>                                      | 900            | 926                      | 0,19                              | 0,000 % fällig am                                  |                |                          |                                   |
| <b>Aviva PLC</b>                                                                      |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 23.01.2031                                     | 1.500          | 1.565                    | 0,32                              | 15.09.2028 (c)                                     | 1.300          | 1.215                    | 0,25                              |
| 7,750 % fällig am                                                                     |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 11.07.2029                                     | 1.100          | 1.092                    | 0,22                              | 0,000 % fällig am                                  |                |                          |                                   |
| 30.09.2032 (e)(f)                                                                     | £ 600          | 714                      | 0,15                              | 5,875 % fällig am                                                |                |                          |                                   | 09.11.2028 (c)                                     | 1.700          | 1.581                    | 0,32                              |
| <b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b>                                                   |                |                          |                                   | 23.03.2035 (e)(f)                                                |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 15.01.2029                       | 8.200          | 7.797                    | 1,58                              |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027                                                          | \$ 172         | 139                      | 0,03                              | <b>Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.</b>                          | 1.100          | 1.099                    | 0,22                              | 2,500 % fällig am 09.10.2030                       | 600            | 602                      | 0,12                              |
| <b>Balder Finland Oyj</b>                                                             |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 06.06.2030                                     |                |                          |                                   | <b>Lloyds Banking Group PLC</b>                    |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 18.01.2027                                                          | € 800          | 779                      | 0,16                              | <b>CTP NV</b>                                                    | 387            | 384                      | 0,08                              | 2,609 % fällig am 04.03.2028                       | 1.100          | 1.102                    | 0,22                              |
| <b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b>                                            |                |                          |                                   | 0,875 % fällig am 20.01.2026                                     |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am                                  |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 27.11.2030                                                          | 1.400          | 1.414                    | 0,29                              | <b>DBS Bank Ltd.</b>                                             |                |                          |                                   | 27.06.2026 (e)(f)                                  | \$ 1.000       | 857                      | 0,17                              |
| <b>Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.</b>                                           |                |                          |                                   | 2,429 % fällig am                                                |                |                          |                                   | <b>Logicor Financing SARL</b>                      |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 13.01.2031                                                          | 1.600          | 1.705                    | 0,35                              | 03.01.2029 (a)                                                   | 1.400          | 1.400                    | 0,29                              | 4,250 % fällig am 18.07.2029                       | € 1.000        | 1.030                    | 0,21                              |
| <b>Banco BPM SpA</b>                                                                  |                |                          |                                   | <b>Deutsche Bank AG</b>                                          |                |                          |                                   | <b>Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA</b> |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 06.09.2030                                                          | 600            | 600                      | 0,12                              | 3,000 % fällig am 16.06.2029                                     | 1.700          | 1.701                    | 0,35                              | 3,250 % fällig am 30.11.2028                       | 1.700          | 1.739                    | 0,36                              |
| 3,250 % fällig am 28.05.2031                                                          | 3.900          | 3.978                    | 0,81                              | 5,000 % fällig am 05.09.2030                                     | 800            | 854                      | 0,17                              | <b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>        |                |                          |                                   |
| <b>Banco di Desio e della Brianza SpA</b>                                             |                |                          |                                   | <b>Digital Dutch Finco BV</b>                                    |                |                          |                                   | 0,848 % fällig am 19.07.2029                       | 700            | 648                      | 0,13                              |
| 4,000 % fällig am 13.03.2028                                                          | 1.400          | 1.457                    | 0,30                              | 3,875 % fällig am 13.09.2033                                     | 800            | 801                      | 0,16                              | <b>Morgan Stanley</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Banco Santander S.A.</b>                                                           |                |                          |                                   | <b>DVI Deutsche Vermoegens- &amp; Immobilienverwaltungs GmbH</b> |                |                          |                                   | 5,192 % fällig am 17.04.2031                       | \$ 2.300       | 2.009                    | 0,41                              |
| 3,875 % fällig am 22.04.2029                                                          | 1.900          | 1.969                    | 0,40                              | 4,875 % fällig am 21.08.2030                                     | 1.100          | 1.118                    | 0,23                              | <b>NatWest Group PLC</b>                           |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 18.10.2031                                                          | 1.000          | 1.085                    | 0,22                              | <b>Eika Boligkredit A/S</b>                                      |                |                          |                                   | 3,575 % fällig am 12.09.2032                       | € 800          | 810                      | 0,17                              |
| 5,750 % fällig am 23.08.2033                                                          | 600            | 641                      | 0,13                              | 2,750 % fällig am 26.05.2032                                     | 1.000          | 997                      | 0,20                              | 7,300 % fällig am                                  |                |                          |                                   |
| <b>Bank of Ireland Group PLC</b>                                                      |                |                          |                                   | <b>Equinix Europe Financing Corp. LLC</b>                        |                |                          |                                   | 19.11.2034 (e)(f)                                  | \$ 1.000       | 848                      | 0,17                              |
| 6,750 % fällig am 01.03.2033                                                          | 1.000          | 1.079                    | 0,22                              | 3,250 % fällig am 19.05.2029                                     | 700            | 705                      | 0,14                              | 7,500 % fällig am                                  |                |                          |                                   |
| <b>Bank of Queensland Ltd.</b>                                                        |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 15.03.2031                                     | 100            | 99                       | 0,02                              | 28.02.2032 (e)(f)                                  | £ 1.000        | 1.160                    | 0,24                              |
| 2,732 % fällig am 18.06.2030                                                          | 900            | 900                      | 0,18                              | <b>Europäische Investitionsbank</b>                              |                |                          |                                   | <b>NE Property BV</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Bankinter S.A.</b>                                                                 |                |                          |                                   | 0,050 % fällig am 13.10.2034                                     | 12.700         | 9.837                    | 2,01                              | 3,375 % fällig am 14.07.2027                       | € 1.300        | 1.312                    | 0,27                              |
| 3,500 % fällig am 10.09.2032                                                          | 400            | 406                      | 0,08                              | 0,250 % fällig am 20.01.2032                                     | 7.500          | 6.445                    | 1,32                              | <b>Nexi SpA</b>                                    |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 04.02.2033                                                          | 400            | 402                      | 0,08                              | 2,750 % fällig am 28.07.2028                                     | 2.400          | 2.446                    | 0,50                              | 3,875 % fällig am 21.05.2031                       | 1.700          | 1.715                    | 0,35                              |
| <b>Banque Federative du Credit Mutuel S.A.</b>                                        |                |                          |                                   | <b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b>                           |                |                          |                                   | <b>NN Group NV</b>                                 |                |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am 19.11.2027                                                          | 4.700          | 4.512                    | 0,92                              | 2,750 % fällig am 29.03.2028                                     | 1.200          | 1.194                    | 0,24                              | 6,000 % fällig am 03.11.2043                       | 450            | 502                      | 0,10                              |
| 3,500 % fällig am 15.05.2031                                                          | 300            | 307                      | 0,06                              | <b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Nomura Holdings, Inc.</b>                       |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 21.11.2029                                                          | 200            | 209                      | 0,04                              | 3,622 % fällig am 27.07.2028                                     | 1.000          | 1.001                    | 0,20                              | 3,459 % fällig am 28.05.2030                       | 1.100          | 1.108                    | 0,23                              |
| 4,125 % fällig am 13.03.2029                                                          | 2.000          | 2.092                    | 0,43                              | 4,445 % fällig am 14.02.2030                                     | 400            | 407                      | 0,08                              | <b>Nordea Bank Abp</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>Barclays PLC</b>                                                                   |                |                          |                                   | <b>GA Global Funding Trust</b>                                   |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 05.05.2028                       | 400            | 418                      | 0,09                              |
| 4,918 % fällig am 08.08.2030                                                          | 900            | 961                      | 0,20                              | 1,625 % fällig am 15.01.2026                                     | \$ 200         | 168                      | 0,03                              | <b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b>        |                |                          |                                   |
| <b>Bevco Lux SARL</b>                                                                 |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 20.06.2032                                     | € 1.000        | 993                      | 0,20                              | 0,500 % fällig am 01.10.2043 DKK                   | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 1,000 % fällig am 16.01.2030                                                          | 200            | 180                      | 0,04                              | <b>Galderma Finance Europe BV</b>                                |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>BGC Group, Inc.</b>                                                                |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 20.03.2030                                     | 1.200          | 1.212                    | 0,25                              | 1,000 % fällig am 01.10.2053                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 6,150 % fällig am 02.04.2030                                                          | \$ 900         | 778                      | 0,16                              | <b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>                                 |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2037                       | 122            | 15                       | 0,00                              |
| <b>BNP Paribas S.A.</b>                                                               |                |                          |                                   | 5,218 % fällig am 23.04.2031                                     | \$ 1.800       | 1.572                    | 0,32                              | 1,500 % fällig am 01.10.2050                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 2,750 % fällig am 25.07.2028                                                          | € 2.900        | 2.911                    | 0,59                              | <b>Goodman Australia Finance Pty. Ltd.</b>                       |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.10.2047                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 9,250 % fällig am                                                                     |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 03.05.2030                                     | € 700          | 731                      | 0,15                              | <b>Norinchukin Bank</b>                            |                |                          |                                   |
| 17.11.2027 (e)(f)                                                                     | \$ 900         | 823                      | 0,17                              | <b>Grainger PLC</b>                                              |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 16.10.2029                       | \$ 400         | 346                      | 0,07                              |
| <b>BPCE S.A.</b>                                                                      |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 24.04.2028                                     | £ 800          | 896                      | 0,18                              | <b>Nova Ljubljanska Banka d.d.</b>                 |                |                          |                                   |
| 1,625 % fällig am 02.03.2029                                                          | € 1.800        | 1.750                    | 0,36                              | <b>HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH</b>                        |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 21.01.2029                       | € 500          | 503                      | 0,10                              |
| 2,125 % fällig am                                                                     |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 05.06.2030                                     | € 700          | 720                      | 0,15                              | <b>Nykredit Realkredit A/S</b>                     |                |                          |                                   |
| 13.10.2046 (f)                                                                        | 1.000          | 880                      | 0,18                              | <b>Iccrea Banca SpA</b>                                          |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 01.10.2043 DKK                   | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>BPER Banca SpA</b>                                                                 |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 07.11.2031                                     | 600            | 596                      | 0,12                              | 1,000 % fällig am 01.10.2050                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 3,750 % fällig am 22.10.2028                                                          | 1.400          | 1.457                    | 0,30                              | <b>IHG Finance LLC</b>                                           |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2053                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>CaixaBank S.A.</b>                                                                 |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 27.09.2031                                     | 800            | 803                      | 0,16                              | 1,500 % fällig am 01.10.2037                       | 240            | 30                       | 0,01                              |
| 4,125 % fällig am 09.02.2032                                                          | 2.200          | 2.293                    | 0,47                              | <b>Indigo Group S.A.S.</b>                                       |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2050                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 5,875 % fällig am                                                                     |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 18.04.2030                                     | 1.100          | 1.160                    | 0,24                              | 2,000 % fällig am 01.10.2053                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 09.10.2027 (e)(f)                                                                     | 1.000          | 1.039                    | 0,21                              | <b>ING Groep NV</b>                                              |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.10.2036                       | 30             | 4                        | 0,00                              |
| <b>Castellum AB</b>                                                                   |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 03.09.2030                                     | 900            | 916                      | 0,19                              | 2,500 % fällig am 01.10.2047                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 4,125 % fällig am 10.12.2030                                                          | 500            | 508                      | 0,10                              | 4,250 % fällig am 26.08.2035                                     | 500            | 513                      | 0,10                              | 3,375 % fällig am 10.01.2030                       | € 1.100        | 1.111                    | 0,23                              |
| <b>CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan European Core Fund</b> |                |                          |                                   | <b>International Development Association</b>                     |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 24.07.2030                       | 2.100          | 2.138                    | 0,44                              |
| 0,500 % fällig am 27.01.2028                                                          | 400            | 376                      | 0,08                              | 1,750 % fällig am 05.05.2037                                     | 4.300          | 3.676                    | 0,75                              | <b>P3 Group SARL</b>                               |                |                          |                                   |
| 0,900 % fällig am 12.10.2029                                                          | 900            | 821                      | 0,17                              | <b>Intesa Sanpaolo Assicurazioni SpA</b>                         |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 26.01.2029                       | 800            | 755                      | 0,15                              |
| <b>CCF Holding S.A.S.</b>                                                             |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 22.12.2030                                     | 1.000          | 935                      | 0,19                              | <b>Pacific Life Global Funding</b>                 |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 27.05.2035                                                          | 500            | 502                      | 0,10                              | <b>Intesa Sanpaolo SpA</b>                                       |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 18.06.2031                       | 2.100          | 2.086                    | 0,43                              |
| <b>Cie de Financement Foncier S.A.</b>                                                |                |                          |                                   | 1,350 % fällig am 24.02.2031                                     | 950            | 859                      | 0,18                              | <b>PKO Bank Hipoteczny S.A.</b>                    |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 28.06.2029                                                          | 400            | 400                      | 0,08                              | 3,625 % fällig am 30.06.2028                                     | 900            | 933                      | 0,19                              | 2,500 % fällig am 12.06.2029                       | 900            | 897                      | 0,18                              |
| <b>Citycon Treasury BV</b>                                                            |                |                          |                                   | <b>JAB Holdings BV</b>                                           |                |                          |                                   | <b>Prologis LP</b>                                 |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 08.03.2029                                                          | 600            | 645                      | 0,13                              | 4,375 % fällig am 19.05.2035                                     | 900            | 911                      | 0,19                              | 4,200 % fällig am 15.02.2033 CAD                   | 1.600          | 1.006                    | 0,21                              |
|                                                                                       |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 29.06.2032                                     | 700            | 744                      | 0,15                              | <b>RCI Banque S.A.</b>                             |                |                          |                                   |
|                                                                                       |                |                          |                                   | <b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>                                  |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 09.10.2034                       | € 900          | 947                      | 0,19                              |
|                                                                                       |                |                          |                                   | 4,457 % fällig am 13.11.2031                                     | 3.200          | 3.414                    | 0,70                              | <b>Realkredit Danmark A/S</b>                      |                |                          |                                   |
|                                                                                       |                |                          |                                   |                                                                  |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.04.2036 DKK                   | 2              | 0                        | 0,00                              |
|                                                                                       |                |                          |                                   |                                                                  |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.04.2047                       | 0              | 0                        | 0,00                              |
|                                                                                       |                |                          |                                   |                                                                  |                |                          |                                   | <b>Sagax AB</b>                                    |                |                          |                                   |
|                                                                                       |                |                          |                                   |                                                                  |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 13.03.2032                       | € 100          | 101                      | 0,02                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

| DEUTSCHE KAPITALGESELLSCHAFTEN               |                |                          |                          |       | FÖRDERUNGS- UND KAPITALGESELLSCHAFTEN |                                                          |                          |                          |       | FÖRDERUNGS- UND KAPITALGESELLSCHAFTEN |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|---------------------------------------|----------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|-------|---------------------------------------|--------------------------------------------|------------------------------------|--------------------------|-------|-------|------|------|
| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S)                                           | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S)                             | MARKT-<br>WERT<br>(000S)           | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |       |      |      |
| Sagax Euro MTN NL BV                         | €              | 600                      | €                        | 567   | 0,12                                  | Elis S.A.                                                | €                        | 1.000                    | €     | 1.030                                 | 0,21                                       | Spirit Airlines Pass-Through Trust | \$                       | 49    | €     | 38   | 0,01 |
| 0,750 % fällig am 26.01.2028                 |                |                          |                          |       |                                       | ELO SACA                                                 |                          |                          |       |                                       |                                            | Suez SACA                          |                          |       |       |      |      |
| 1,000 % fällig am 17.05.2029                 |                | 700                      |                          | 642   | 0,13                                  | 6,000 % fällig am 22.03.2029                             | 1.000                    |                          | 934   | 0,19                                  | 1,875 % fällig am 24.05.2027               | €                                  | 1.200                    |       | 1.185 | 0,24 |      |
| SELP Finance SARL                            |                | 900                      |                          | 903   | 0,18                                  | Epiroc AB                                                | 700                      |                          | 717   | 0,15                                  | Swisscom Finance BV                        |                                    | 500                      |       | 499   | 0,10 |      |
| 3,750 % fällig am 16.01.2032                 |                |                          |                          |       |                                       | 3,625 % fällig am 28.02.2031                             |                          |                          |       |                                       | 3,125 % fällig am 21.05.2032               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Sirius Real Estate Ltd.                      |                | 2.300                    |                          | 2.258 | 0,46                                  | Fiserv Funding ULC                                       | 1.500                    |                          | 1.506 | 0,31                                  | Syensqo S.A.                               |                                    | 600                      |       | 602   | 0,12 |      |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026                 |                |                          |                          |       |                                       | 2,875 % fällig am 15.06.2028                             |                          |                          |       |                                       | 3,375 % fällig am 28.05.2031               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Sofina S.A.                                  |                | 900                      |                          | 836   | 0,17                                  | Flutter Treasury DAC                                     | 500                      |                          | 501   | 0,10                                  | T-Mobile USA, Inc.                         |                                    | 2.900                    |       | 2.875 | 0,59 |      |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028                 |                |                          |                          |       |                                       | 4,000 % fällig am 04.06.2031                             |                          |                          |       |                                       | 3,150 % fällig am 11.02.2032               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Sparebanken Norge Boligkreditt A/S           |                | 600                      |                          | 605   | 0,12                                  | Fresenius Medical Care AG                                | 200                      |                          | 202   | 0,04                                  | TDF Infrastructure SASU                    |                                    | 2.200                    |       | 2.067 | 0,42 |      |
| 2,750 % fällig am 28.06.2030                 |                |                          |                          |       |                                       | 3,125 % fällig am 08.12.2028                             |                          |                          |       |                                       | 1,750 % fällig am 01.12.2029               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Stoneweg Ereit Lux Finco SARL                |                | 1.100                    |                          | 1.113 | 0,23                                  | Gatwick Funding Ltd.                                     | 800                      |                          | 794   | 0,16                                  | Tesco Corporate Treasury Services PLC      |                                    | 800                      |       | 846   | 0,17 |      |
| 4,250 % fällig am 30.01.2031                 |                |                          |                          |       |                                       | 3,875 % fällig am 24.06.2035                             |                          |                          |       |                                       | 4,250 % fällig am 27.02.2031               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.        |                | 500                      |                          | 504   | 0,10                                  | Global Payments, Inc.                                    | 900                      |                          | 946   | 0,19                                  | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV |                                    | 500                      |       | 502   | 0,10 |      |
| 3,318 % fällig am 07.10.2031                 |                |                          |                          |       |                                       | 4,875 % fällig am 17.03.2031                             |                          |                          |       |                                       | 4,125 % fällig am 01.06.2031               |                                    |                          |       |       |      |      |
| TAG Immobilien AG                            |                | 1.200                    |                          | 1.232 | 0,25                                  | H Lundbeck A/S                                           | 1.500                    |                          | 1.438 | 0,29                                  | Toyota Motor Finance Netherlands BV        |                                    | 500                      |       | 509   | 0,10 |      |
| 4,250 % fällig am 04.03.2030                 |                |                          |                          |       |                                       | 0,875 % fällig am 14.10.2027                             |                          |                          |       |                                       | 3,125 % fällig am 21.04.2028               |                                    |                          |       |       |      |      |
| TP ICAP Finance PLC                          | £              | 1.100                    |                          | 1.183 | 0,24                                  | Heathrow Funding Ltd.                                    | 1.000                    |                          | 863   | 0,18                                  | Ubisoft Entertainment S.A.                 |                                    | 1.200                    |       | 1.083 | 0,22 |      |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028                 |                |                          |                          |       |                                       | 1,875 % fällig am 14.03.2036                             |                          |                          |       |                                       | 0,878 % fällig am 24.11.2027               |                                    |                          |       |       |      |      |
| TSB Bank PLC                                 | €              | 600                      |                          | 616   | 0,13                                  | Holding d'Infrastructures de Transport SASU              | 1.900                    |                          | 1.793 | 0,37                                  | UCB S.A.                                   |                                    | 1.400                    |       | 1.437 | 0,29 |      |
| 3,319 % fällig am 05.03.2029                 |                |                          |                          |       |                                       | 1,625 % fällig am 18.09.2029                             |                          |                          |       |                                       | 4,250 % fällig am 20.03.2030               |                                    |                          |       |       |      |      |
| UBS Group AG                                 |                | 400                      |                          | 347   | 0,07                                  | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement | 900                      |                          | 824   | 0,17                                  | Universal Music Group NV                   |                                    | 3.100                    |       | 3.180 | 0,65 |      |
| 0,875 % fällig am 03.11.2031                 |                | 3.700                    |                          | 4.170 | 0,85                                  | 0,625 % fällig am 16.09.2028                             |                          |                          |       |                                       | 3,750 % fällig am 30.06.2032               |                                    |                          |       |       |      |      |
| 7,750 % fällig am 01.03.2029                 |                |                          |                          |       |                                       | IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % bar oder 7,500 % PIK)      |                          |                          |       |                                       | 4,000 % fällig am 13.06.2031               |                                    |                          |       |       |      |      |
| UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S |                | 600                      |                          | 604   | 0,12                                  | 6,750 % fällig am 15.11.2029 (b)                         | 900                      |                          | 943   | 0,19                                  | VF Corp.                                   |                                    | 200                      |       | 141   | 0,03 |      |
| 2,875 % fällig am 25.03.2029                 |                |                          |                          |       |                                       | IMCD NV                                                  | 100                      |                          | 99    | 0,02                                  | 0,625 % fällig am 25.02.2032               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Vesteda Finance BV                           |                | 800                      |                          | 820   | 0,17                                  | 2,125 % fällig am 31.03.2027                             | 1.400                    |                          | 1.477 | 0,30                                  | Vilmorin & Cie S.A.                        |                                    | 900                      |       | 850   | 0,17 |      |
| 4,000 % fällig am 07.05.2032                 |                |                          |                          |       |                                       | 4,875 % fällig am 18.09.2028                             |                          |                          |       |                                       | 1,375 % fällig am 26.03.2028               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Volkswagen Financial Services AG             |                | 1.900                    |                          | 1.911 | 0,39                                  | INEOS Finance PLC                                        | 200                      |                          | 195   | 0,04                                  | Vmed O2 UK Financing PLC                   | £                                  | 400                      |       | 435   | 0,09 |      |
| 3,875 % fällig am 19.11.2031                 |                |                          |                          |       |                                       | 5,625 % fällig am 15.08.2030                             |                          |                          |       |                                       | 4,000 % fällig am 31.01.2029               |                                    |                          |       |       |      |      |
| Wells Fargo & Co.                            |                | 1.800                    |                          | 1.855 | 0,38                                  | Informa PLC                                              | 1.000                    |                          | 995   | 0,20                                  | 5,625 % fällig am 15.04.2032 (a)           | €                                  | 2.800                    |       | 2.842 | 0,58 |      |
| 3,900 % fällig am 22.07.2032                 |                |                          |                          |       |                                       | 3,375 % fällig am 09.06.2031                             |                          |                          |       |                                       | Volkswagen International Finance NV        |                                    | 700                      |       | 692   | 0,14 |      |
| Westpac Banking Corp.                        |                | 300                      |                          | 299   | 0,06                                  | International Distribution Services PLC                  | 1.200                    |                          | 1.275 | 0,26                                  | 1,875 % fällig am 30.03.2027               |                                    |                          |       |       |      |      |
| 2,585 % fällig am 14.05.2030                 |                |                          |                          |       |                                       | 5,250 % fällig am 14.09.2028                             |                          |                          |       |                                       | 4,250 % fällig am 15.02.2028               |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Ipsen S.A.                                               | 800                      |                          | 806   | 0,17                                  | 4,375 % fällig am 15.05.2030               |                                    | 1.600                    |       | 1.680 | 0,34 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,875 % fällig am 25.03.2032                             |                          |                          |       |                                       | 5,994 % fällig am 15.11.2033 (e)           |                                    | 200                      |       | 202   | 0,04 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | JDE Peet's NV                                            | 2.750                    |                          | 2.529 | 0,52                                  | Werfen S.A.                                |                                    | 1.200                    |       | 1.256 | 0,26 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 0,500 % fällig am 16.01.2029                             |                          |                          |       |                                       | 4,625 % fällig am 06.06.2028               |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | John Lewis PLC                                           | £                        | 950                      | 904   | 0,19                                  | WMG Acquisition Corp.                      |                                    | 1.000                    |       | 929   | 0,19 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 4,250 % fällig am 18.12.2034                             |                          |                          |       |                                       | 2,250 % fällig am 15.08.2031               |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Kering S.A.                                              | €                        | 500                      | 491   | 0,10                                  | Worley U.S. Finance Sub Ltd.               |                                    | 1.100                    |       | 1.083 | 0,22 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,375 % fällig am 11.03.2032                             |                          |                          |       |                                       | 0,875 % fällig am 09.06.2026               |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Kingspan Securities Ireland DAC                          | 600                      |                          | 603   | 0,12                                  | Yorkshire Water Finance PLC                |                                    | 1.500                    |       | 1.357 | 0,28 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,500 % fällig am 31.10.2031                             |                          |                          |       |                                       | 1,750 % fällig am 26.11.2026               | £                                  | 800                      |       | 892   | 0,18 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Mitchells & Butlers Finance PLC                          | \$                       | 257                      | 212   | 0,04                                  | 1,750 % fällig am 27.10.2032               |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 5,111 % fällig am 15.12.2030                             | £                        | 75                       | 88    | 0,02                                  | ZF Europe Finance BV                       | €                                  | 400                      |       | 401   | 0,08 |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 6,013 % fällig am 15.12.2030                             |                          |                          |       |                                       | 7,000 % fällig am 12.06.2030               |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Mobico Group PLC                                         | €                        | 500                      | 406   | 0,08                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 4,875 % fällig am 26.09.2031                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Molnlycke Holding AB                                     |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 4,250 % fällig am 08.09.2028                             | 600                      |                          | 622   | 0,13                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Motability Operations Group PLC                          | 2.100                    |                          | 2.156 | 0,44                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,625 % fällig am 24.07.2029                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | National Grid Electricity Transmission PLC               | 400                      |                          | 338   | 0,07                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 0,823 % fällig am 07.07.2032                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Netfix, Inc.                                             | 2.500                    |                          | 2.613 | 0,53                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,875 % fällig am 15.11.2029                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Norsk Hydro ASA                                          | 200                      |                          | 201   | 0,04                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,625 % fällig am 23.01.2032                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | REWE International Finance BV                            |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 2,750 % fällig am 03.07.2028 (a)                         | 1.500                    |                          | 1.502 | 0,31                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Robert Bosch GmbH                                        | 1.400                    |                          | 1.442 | 0,30                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,625 % fällig am 02.06.2030                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Sandoz Finance BV                                        | 1.100                    |                          | 1.158 | 0,24                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 4,220 % fällig am 17.04.2030                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Sartorius Finance BV                                     | 1.100                    |                          | 1.152 | 0,24                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 4,375 % fällig am 14.09.2029                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | SEB S.A.                                                 | 1.100                    |                          | 1.104 | 0,23                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,625 % fällig am 24.06.2030                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Siflin NV                                                | 1.900                    |                          | 2.017 | 0,41                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 5,125 % fällig am 17.07.2030                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA         | 1.000                    |                          | 1.001 | 0,20                                  |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |
|                                              |                |                          |                          |       |                                       | 3,500 % fällig am 09.10.2025                             |                          |                          |       |                                       |                                            |                                    |                          |       |       |      |      |

| BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Oncor Electric Delivery Co. LLC        |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 15.05.2031 €         | 900            | 916                      | 0,19                              |
| Severn Trent Utilities Finance PLC     |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 05.03.2034           | 1.700          | 1.739                    | 0,36                              |
| SW Finance PLC                         |                |                          |                                   |
| 1,625 % fällig am 30.03.2027 £         | 600            | 625                      | 0,13                              |
| TDC Net A/S                            |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 09.08.2032 €         | 1.000          | 1.024                    | 0,21                              |
| 5,618 % fällig am 06.02.2030           | 1.900          | 2.025                    | 0,41                              |
| United Utilities Water Finance PLC     |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 27.02.2033           | 500            | 497                      | 0,10                              |
| 3,750 % fällig am 23.05.2034           | 450            | 450                      | 0,09                              |
| Wintershall Dea Finance BV             |                |                          |                                   |
| 3,830 % fällig am 03.10.2029           | 1.100          | 1.113                    | 0,23                              |
|                                        |                | 24.982                   | 5,10                              |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel |                | 282.461                  | 57,64                             |

**US-REGIERUNGSBEHÖRDEN**

|                                           |        |        |       |
|-------------------------------------------|--------|--------|-------|
| Ginnie Mae, TBA                           |        |        |       |
| 4,500 % fällig am 01.07.2055 \$           | 4.000  | 3.262  | 0,67  |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA     |        |        |       |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055              | 5.600  | 4.129  | 0,84  |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055 | 3.400  | 2.693  | 0,55  |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055              | 7.700  | 6.272  | 1,28  |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055              | 12.600 | 10.521 | 2,15  |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055              | 4.300  | 3.660  | 0,75  |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055              | 18.400 | 15.915 | 3,25  |
| 6,500 % fällig am 01.08.2055              | 34.500 | 30.305 | 6,18  |
|                                           |        | 76.757 | 15,67 |

**US-SCHATZobligationen**

|                                                  |       |       |      |
|--------------------------------------------------|-------|-------|------|
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) |       |       |      |
| 1,875 % fällig am 15.07.2034                     | 3.067 | 2.616 | 0,53 |

**NON-AGENCY-MBS**

|                                                   |       |        |      |
|---------------------------------------------------|-------|--------|------|
| BPCE Home Loans FCT                               |       |        |      |
| 2,786 % fällig am 31.10.2058 €                    | 3.508 | 3.518  | 0,72 |
| Canada Square Funding PLC                         |       |        |      |
| 5,189 % fällig am 17.06.2058 £                    | 746   | 872    | 0,18 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust |       |        |      |
| 7,743 % fällig am 25.08.2034 \$                   | 14    | 11     | 0,00 |
| Domi BV                                           |       |        |      |
| 2,605 % fällig am 15.06.2053 €                    | 650   | 650    | 0,13 |
| 3,008 % fällig am 16.04.2057                      | 1.700 | 1.702  | 0,35 |
| Dutch Property Finance BV                         |       |        |      |
| 2,811 % fällig am 28.07.2058                      | 1.464 | 1.464  | 0,30 |
| 2,911 % fällig am 28.10.2059                      | 2.564 | 2.567  | 0,52 |
| Green Storm BV                                    |       |        |      |
| 2,480 % fällig am 22.02.2062                      | 1.000 | 998    | 0,20 |
| Jeronimo Funding DAC                              |       |        |      |
| 3,408 % fällig am 25.10.2064                      | 1.664 | 1.666  | 0,34 |
| Jubilee Place BV                                  |       |        |      |
| 3,113 % fällig am 17.01.2059                      | 1.523 | 1.526  | 0,31 |
| 3,263 % fällig am 17.10.2057                      | 291   | 292    | 0,06 |
| Landmark Mortgage Securities PLC                  |       |        |      |
| 4,711 % fällig am 17.04.2044 £                    | 570   | 646    | 0,13 |
| Newgate Funding PLC                               |       |        |      |
| 2,575 % fällig am 15.12.2050 €                    | 109   | 107    | 0,02 |
| Primrose Residential DAC                          |       |        |      |
| 3,399 % fällig am 24.10.2061                      | 1.623 | 1.624  | 0,33 |
| RMAC Securities PLC                               |       |        |      |
| 4,508 % fällig am 12.06.2044 £                    | 63    | 72     | 0,02 |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust       |       |        |      |
| 5,132 % fällig am 19.12.2034 \$                   | 41    | 32     | 0,01 |
| Twin Bridges PLC                                  |       |        |      |
| 5,089 % fällig am 12.03.2055 £                    | 1.599 | 1.868  | 0,38 |
|                                                   |       | 19.615 | 4,00 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE****AUTOMOBILE ABS SONSTIGE**

|                                   |       |       |      |
|-----------------------------------|-------|-------|------|
| Auto ABS Italian Stella Loans SRL |       |       |      |
| 2,773 % fällig am 28.12.2040 €    | 1.500 | 1.505 | 0,31 |

| BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Auto ABS Spanish Loans                   |                |                          |                                   |
| 2,779 % fällig am 28.09.2038 €           | 2.345          | 2.352                    | 0,48                              |
| Autonoria Spain                          |                |                          |                                   |
| 2,530 % fällig am 30.04.2043             | 1.700          | 1.702                    | 0,35                              |
| Bavarian Sky S.A.                        |                |                          |                                   |
| 2,367 % fällig am 21.02.2033             | 1.200          | 1.200                    | 0,24                              |
| Compartment VCL                          |                |                          |                                   |
| 2,431 % fällig am 21.04.2031             | 1.500          | 1.501                    | 0,31                              |
| E-Carat DE                               |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 25.05.2034             | 1.600          | 1.602                    | 0,33                              |
| Golden Bar Securitisation SRL            |                |                          |                                   |
| 3,086 % fällig am 22.09.2043             | 1.026          | 1.033                    | 0,21                              |
| Pony S.A., Compartment German Auto Loans |                |                          |                                   |
| 2,382 % fällig am 14.12.2035             | 500            | 500                      | 0,10                              |
|                                          |                | 11.395                   | 2,33                              |

**HYPOTHEKEN SONSTIGE**

|                                    |       |     |      |
|------------------------------------|-------|-----|------|
| Renaissance Home Equity Loan Trust |       |     |      |
| 5,340 % fällig am 25.01.2037 \$    | 1.291 | 339 | 0,07 |

**ABS SONSTIGE**

|                                               |       |        |      |
|-----------------------------------------------|-------|--------|------|
| Arbour CLO DAC                                |       |        |      |
| 3,293 % fällig am 15.11.2037 €                | 900   | 900    | 0,18 |
| Avoca Static CLO DAC                          |       |        |      |
| 3,249 % fällig am 15.01.2035                  | 925   | 925    | 0,19 |
| BBVA Consumo FTA                              |       |        |      |
| 2,757 % fällig am 21.08.2038                  | 1.500 | 1.503  | 0,31 |
| Bosphorus CLO DAC                             |       |        |      |
| 2,964 % fällig am 12.12.2032                  | 1.141 | 1.143  | 0,23 |
| Carlyle Euro CLO DAC                          |       |        |      |
| 0,000 % fällig am 15.08.2038 (a)              | 1.600 | 1.600  | 0,33 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC |       |        |      |
| 3,212 % fällig am 16.01.2033                  | 1.473 | 1.474  | 0,30 |
| Contego CLO BV                                |       |        |      |
| 3,049 % fällig am 15.10.2030                  | 120   | 121    | 0,03 |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC                    |       |        |      |
| 2,904 % fällig am 17.06.2032                  | 707   | 707    | 0,14 |
| Dryden Euro CLO DAC                           |       |        |      |
| 3,003 % fällig am 15.05.2034                  | 144   | 144    | 0,03 |
| Harvest CLO DAC                               |       |        |      |
| 3,129 % fällig am 15.01.2032                  | 188   | 188    | 0,04 |
| Hayfin Emerald CLO DAC                        |       |        |      |
| 3,914 % fällig am 22.01.2039                  | 700   | 701    | 0,14 |
| Invesco Euro CLO DAC                          |       |        |      |
| 2,929 % fällig am 15.07.2031                  | 370   | 370    | 0,08 |
| Madison Park Euro Funding DAC                 |       |        |      |
| 3,079 % fällig am 15.07.2032                  | 598   | 597    | 0,12 |
| Palmer Square European Loan Funding DAC       |       |        |      |
| 2,999 % fällig am 15.10.2031                  | 902   | 900    | 0,18 |
| 3,143 % fällig am 15.05.2034                  | 1.788 | 1.786  | 0,36 |
| 3,170 % fällig am 15.10.2034                  | 1.100 | 1.097  | 0,22 |
| 3,203 % fällig am 15.02.2035                  | 1.500 | 1.500  | 0,31 |
| SC Germany S.A., Compartment Consumer         |       |        |      |
| 2,592 % fällig am 14.05.2038                  | 870   | 872    | 0,18 |
| Segovia European CLO DAC                      |       |        |      |
| 3,116 % fällig am 20.07.2032                  | 454   | 454    | 0,09 |
| Toro European CLO DAC                         |       |        |      |
| 2,953 % fällig am 15.02.2034                  | 493   | 492    | 0,10 |
| 3,185 % fällig am 12.01.2032                  | 190   | 190    | 0,04 |
|                                               |       | 17.664 | 3,60 |
|                                               |       | 29.398 | 6,00 |

**STAATSEMISSIONEN**

|                                     |           |       |      |
|-------------------------------------|-----------|-------|------|
| Adif Alta Velocidad                 |           |       |      |
| 3,500 % fällig am 30.07.2028        | 3.000     | 3.085 | 0,63 |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA       |           |       |      |
| 3,250 % fällig am 17.06.2033        | 100       | 99    | 0,02 |
| Chile Government International Bond |           |       |      |
| 3,875 % fällig am 09.07.2031        | 2.100     | 2.161 | 0,44 |
| CPPIB Capital, Inc.                 |           |       |      |
| 0,050 % fällig am 24.02.2031        | 900       | 775   | 0,16 |
| 4,300 % fällig am 02.06.2034        | CAD 3.500 | 2.279 | 0,47 |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität |                |                          |                                   |
| 1,250 % fällig am 24.05.2033 €             | 15.400         | 13.763                   | 2,81                              |
| 2,375 % fällig am 11.04.2028               | 3.700          | 3.725                    | 0,76                              |
| 3,000 % fällig am 15.12.2028               | 11.000         | 11.287                   | 2,30                              |
| Europäische Union                          |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 04.07.2035 (c)           | 4.300          | 3.182                    | 0,65                              |
| 0,400 % fällig am 04.02.2037               | 8.900          | 6.541                    | 1,34                              |
| 0,450 % fällig am 04.07.2041               | 4.700          | 2.964                    | 0,60                              |
| 1,250 % fällig am 04.02.2043               | 900            | 630                      | 0,13                              |
| 2,750 % fällig am 04.02.2033               | 21.900         | 21.849                   | 4,46                              |
| 2,750 % fällig am 04.12.2037               | 6.400          | 6.056                    | 1,24                              |
| Hungary Government International Bond      |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 16.06.2034               | 900            | 908                      | 0,19                              |
| Ile-de-France Mobilites                    |                |                          |                                   |
| 3,700 % fällig am 14.06.2038               | 500            | 497                      | 0,10                              |
| Indonesia Government International Bond    |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.01.2033               | 1.800          | 1.837                    | 0,37                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro          |                |                          |                                   |
| 4,050 % fällig am 30.10.2037               | 200            | 209                      | 0,04                              |
| Japan Government International Bond        |                |                          |                                   |
| 2,300 % fällig am 20.12.2054 ¥             | 190.000        | 1.007                    | 0,21                              |
| Junta de Castilla y Leon                   |                |                          |                                   |
| 2,900 % fällig am 30.04.2032 €             | 1.100          | 1.098                    | 0,22                              |
| Kommunekredit                              |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 15.09.2032               | 2.500          | 2.445                    | 0,50                              |
| Korea Housing Finance Corp.                |                |                          |                                   |
| 4,082 % fällig am 25.09.2027               | 3.100          | 3.214                    | 0,66                              |
| Mexico Government International Bond       |                |                          |                                   |
| 1,125 % fällig am 17.01.2030               | 3.100          | 2.795                    | 0,57                              |
| 6,350 % fällig am 09.02.2035 \$            | 2.200          | 1.922                    | 0,39                              |
| Ontario Teachers' Finance Trust            |                |                          |                                   |
| 2,850 % fällig am 04.12.2031 €             | 800            | 799                      | 0,16                              |
| Peru Government International Bond         |                |                          |                                   |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033               | PEN 7.200      | 1.886                    | 0,38                              |
| Poland Government International Bond       |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 14.02.2033 €             | 1.300          | 1.364                    | 0,28                              |
| Province of Ontario                        |                |                          |                                   |
| 0,010 % fällig am 25.11.2030               | 3.800          | 3.294                    | 0,67                              |
| Province of Quebec                         |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 24.01.2033               | 4.200          | 4.201                    | 0,86                              |
| Romania Government International Bond      |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030               | 1.600          | 1.376                    | 0,28                              |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030               | 1.100          | 1.124                    | 0,23                              |
| 6,375 % fällig am 18.09.2033               | 1.600          | 1.649                    | 0,34                              |
| 6,625 % fällig am 27.09.2029               | 2.900          | 3.128                    | 0,64                              |
| South Africa Government International Bond |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037               | ZAR 20.400     | 851                      | 0,17                              |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035               | 20.600         | 922                      | 0,19                              |
| Spain Government International Bond        |                |                          |                                   |
| 3,150 % fällig am 30.04.2033 €             | 7.200          | 7.318                    | 1,49                              |
|                                            |                | 122.240                  | 24,95                             |
| Summe Übertragbare Wertpapiere             |                | € 533.087                | 108,79                            |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                       | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                     | 1,960 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | € 17.300      | Belgium Government International Bond<br>1,600 % fällig am 22.06.2047 | € (17.656)                 | € 17.300                       | € 17.301                                                       | 3,53                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                                       | € (17.656)                 | € 17.300                       | € 17.301                                                       | 3,53                         |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month SOFR June Futures                                      | Long  | 09.2027     | 222                  | € 131                                           | 0,03                    |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 666                  | (342)                                           | (0,07)                  |
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 132                  | (31)                                            | (0,01)                  |
| Euro-Bund September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 35                   | (13)                                            | 0,00                    |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Long  | 09.2025     | 75                   | (180)                                           | (0,04)                  |
| Euro-Oat September Futures                                     | Short | 09.2025     | 120                  | 57                                              | 0,01                    |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 475                  | (80)                                            | (0,02)                  |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 21                   | 17                                              | 0,00                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025     | 51                   | (49)                                            | (0,01)                  |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 496                  | 851                                             | 0,19                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 18                   | 34                                              | 0,01                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 21                   | 64                                              | 0,01                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025     | 153                  | 401                                             | 0,08                    |
|                                                                |       |             |                      | € 860                                           | 0,18                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                      | € 860                                           | 0,18                    |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

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

| Referenzeinheit      | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Next Group PLC       | (1,000) %                      | 20.12.2029       | € 2.600                   | € 4                                             | 0,00                    |
| Publicis Groupe S.A. | (1,000)                        | 20.12.2029       | 2.300                     | 6                                               | 0,00                    |
|                      |                                |                  |                           | € 10                                            | 0,00                    |

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

| Referenzeinheit                      | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|--------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 1,000 %                        | 20.12.2029       | € 1.100                   | € 12                                            | 0,01                    |
| Cellnex Telecom S.A.                 | 5,000                          | 20.06.2030       | 2.700                     | (27)                                            | (0,01)                  |
| Commerzbank AG                       | 1,000                          | 20.12.2029       | 1.050                     | 10                                              | 0,00                    |
| Glencore Finance Europe Ltd.         | 5,000                          | 20.06.2030       | 800                       | (4)                                             | 0,00                    |
| International Game Technology PLC    | 5,000                          | 20.06.2030       | 1.000                     | (4)                                             | 0,00                    |
| Stellantis NV                        | 5,000                          | 20.06.2028       | 700                       | (6)                                             | 0,00                    |
|                                      |                                |                  |                           | € (19)                                          | 0,00                    |

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

| Index/Tranchen                      | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| iTraxx Europe Main 43 10-Year Index | (1,000) %                      | 20.06.2035       | € 26.600                  | € (20)                                          | 0,00                    |

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

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index   | 5,000 %                        | 20.06.2030       | € 3.800                   | € 40                                            | 0,01                    |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 192.700                   | 172                                             | 0,03                    |
|                                    |                                |                  |                           | € 212                                           | 0,04                    |



**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex             | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 19.000   | € 282                                           | 0,06                         |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500           | 19.03.2035       | 25.900     | (243)                                           | (0,05)                       |
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 19.03.2027       | 19.700     | 118                                             | 0,02                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 0,500           | 16.06.2026       | \$ 27.600  | (1.801)                                         | (0,37)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 0,750           | 16.06.2031       | 4.530      | (369)                                           | (0,08)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 1,750           | 15.06.2052       | 3.400      | (139)                                           | (0,03)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000           | 19.03.2030       | 58.700     | (1.548)                                         | (0,32)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 19.03.2035       | 32.700     | (1.045)                                         | (0,21)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 20.09.2025       | 37.000     | (466)                                           | (0,09)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 18.12.2054       | 2.900      | 324                                             | 0,07                         |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 13,354          | 02.01.2029       | BRL 58.800 | 68                                              | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                      | 14,515          | 04.01.2027       | 22.600     | 21                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2034       | CAD 3.400  | (24)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,750           | 19.03.2030       | AUD 18.800 | 12                                              | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2055       | € 2.890    | 79                                              | 0,02                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,380           | 31.12.2034       | 1.600      | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,410           | 05.11.2034       | 1.490      | 3                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,460           | 13.03.2035       | 900        | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,460           | 01.04.2035       | 900        | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520           | 27.03.2035       | 900        | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,610           | 24.03.2035       | 900        | 4                                               | 0,00                         |
|                                                |                                     |                 |                  |            | € (4.746)                                       | (0,97)                       |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                     |                 |                  |            | € (4.563)                                       | (0,93)                       |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN****CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000 %       | 16.07.2025    | 7.900                     | € (7)   | € 0       | 0,00                         |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 7.900                     | (9)     | (1)       | 0,00                         |
|            |                                  |                         |               |               |                           | € (16)  | € (1)     | 0,00                         |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung                             | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------------------------------|----------------------------|-----------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| CBK        | Call - OTC 10-Year<br>Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR        | Erhalt                                  | 2,380 %       | 03.07.2025    | 1.400                     | € (3)   | € 0       | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year<br>Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR        | Erhalt                                  | 2,460         | 16.07.2025    | 1.400                     | (4)     | (1)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year<br>Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR        | Zahlung                                 | 2,640         | 03.07.2025    | 1.400                     | (3)     | (2)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year<br>Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR        | Zahlung                                 | 2,720         | 16.07.2025    | 1.400                     | (4)     | (2)       | 0,00                         |
|            |                                          |                            |                                         |               |               |                           | € (14)  | € (5)     | 0,00                         |
|            |                                          |                            |                                         |               |               |                           |         |           |                              |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit      | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------|--------------------------------|-----------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| GST        | SoftBank Group Corp. | 1,000 %                        | 20.06.2026            | \$ 1.300                  | € (10)                                       | € 5                                             | € (5)     | 0,00                         |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                 | 2.976 \$              | 413                           | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 616                   | 721                           | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 61                    | 101                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 3.857 \$              | 536                           | 0                               | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NZD                 | 101                   | 61                            | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
| BOA        | 08.2025          | \$                  | 723                   | 616                           | 2                               | 2                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 464                   | 496                           | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 637.519               | 467                           | 0                               | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 17                    | 13                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 18.250                | 16.050                        | 504                             | 504                                           | 0,10                 |
|            | 07.2025          |                     | 203                   | 3.314.013                     | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 72                    | 92                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 92                    | 72                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 83                    | 3                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 392                   | 53                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | €                   | 15.107                | 12.877                        | 0                               | (75)                                          | (0,02)               |
|            | 07.2025          | £                   | 14.193                | 16.897                        | 329                             | 329                                           | 0,07                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 178                   | 5                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 10.754                | 331                           | 0                               | (33)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 407                   | 2.315                         | 15                              | 15                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 349                   | 303                           | 6                               | 6                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 354                   | 5.780.365                     | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 20                    | THB                           | 655                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 101                   | TWD                           | 2.996                           | 2                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 607                   | 85                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £                   | 12.903                | 15.107                        | 74                              | 74                                            | 0,02                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 15.337                | 489                           | 0                               | (37)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 266                   | INR                           | 23.107                          | 2                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 124                   | TWD                           | 4.063                           | 14                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 1.299                 | £                             | 1.106                           | 0                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     | 126                   | ¥                             | 21.360                          | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 454                   | €                             | 535                             | 5                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 1.801                 | \$                            | 517                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 26.192                | €                             | 160                             | 6                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 23.340                | \$                            | 17                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TRY                 | 1.947                 |                               | 48                              | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 256                   | ILS                           | 866                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 29                    | PLN                           | 109                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 25.603                | \$                            | 1.416                           | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 21.329                | €                             | 126                             | 0                                             | 0,00                 |
| CBK        | 08.2025          | \$                  | 997                   | TRY                           | 41.291                          | 10                                            | 0,00                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 6.410                 | \$                            | 1.755                           | 0                                             | (0,01)               |
|            | 07.2025          | CAD                 | 8.032                 | €                             | 5.140                           | 125                                           | 0,03                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 1.410.795             | \$                            | 1.029                           | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 9.295                 |                               | 280                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 19.778                |                               | 608                             | (62)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 2.036                 | BRL                           | 11.645                          | 83                                            | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 191                   | IDR                           | 3.103.679                       | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 132                   | TWD                           | 3.901                           | 2                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 1.009                 | \$                            | 140                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 27.320                |                               | 861                             | (76)                                          | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 1.595                 | INR                           | 137.505                         | 5                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MXN                 | 762                   | \$                            | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 12.2025          | PEN                 | 1.752                 |                               | 473                             | (16)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 19.611                |                               | 22.751                          | (231)                                         | (0,05)               |
| DUB        | 07.2025          | ILS                 | 874                   |                               | 252                             | (6)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 27.272                |                               | 20                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 16                    |                               | 13                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 22                    | IDR                           | 362.149                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 91                    | TWD                           | 2.712                           | 2                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 300                   | CNH                           | 2.166                           | 3                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 22.751                | €                             | 19.568                          | 229                                           | 0,05                 |
|            | 08.2025          |                     | 765                   | INR                           | 66.039                          | 3                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MXN                 | 0                     | \$                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | BRL                 | 13.986                |                               | 2.537                           | (22)                                          | 0,00                 |
| GLM        | 07.2025          | €                   | 5.329                 | CAD                           | 8.494                           | 0                                             | (0,01)               |
|            | 07.2025          | ¥                   | 42.172                | €                             | 259                             | 10                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 4.038                 | \$                            | 124                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 45                    | IDR                           | 736.208                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 33                    | SGD                           | 42                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD                 | 8.499                 | €                             | 5.329                           | 26                                            | 0,01                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 1.448                 | \$                            | 202                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 42                    |                               | 33                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 10.2025          | \$                  | 2.537                 | BRL                           | 14.306                          | 21                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 204                   | €                             | 115                             | 1                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | CNH                 | 2.683                 | \$                            | 372                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 293                   | ¥                             | 49.420                          | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 512                   | \$                            | 586                             | (13)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 104.157               |                               | 76                              | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 101                   |                               | 60                              | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 635                   |                               | 494                             | (4)                                           | 0,00                 |



| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MBC                              | 07.2025          | TWD                    | 10.886                   | \$ 335                           | € 0                                | € (34)                                               | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 5.708                    | € 4.932                          | 70                                 | 70                                                   | 0,01                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 958                      | PLN 3.558                        | 23                                 | 23                                                   | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 47                       | SGD 60                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | ZAR                    | 6.327                    | \$ 354                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 4.689                    | 652                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | ¥                      | 49.343                   | € 293                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | SGD                    | 60                       | \$ 47                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 11.503                   | 353                              | 0                                  | (40)                                                 | (0,01)                  |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 297                      | INR 25.771                       | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | AUD                    | 263                      | € 150                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | CAD                    | 296                      | 189                              | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 41                       | \$ 30                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | CHF                    | 219                      | € 235                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | CNH                    | 1.465                    | \$ 203                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | DKK                    | 266                      | € 36                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | SGD                    | 1.524                    | \$ 1.188                         | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | THB                    | 4.666                    | 141                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | TWD                    | 5.877                    | 180                              | 0                                  | (19)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 30                       | CAD 41                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 51                       | IDR 822.380                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 224                      | PLN 837                          | 7                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 1.242                    | SGD 1.606                        | 16                                 | 16                                                   | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 7                        | TWD 218                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 4.022                    | \$ 561                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
| MYI                              | 08.2025          | SGD                    | 1.603                    | 1.242                            | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 11.896                   | 369                              | 0                                  | (38)                                                 | (0,01)                  |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 30                       | CAD 41                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | €                      | 546                      | \$ 624                           | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 2                        | PLN 7                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX                              | 08.2025          | CNH                    | 888                      | \$ 124                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | AUD                    | 3.916                    | € 2.223                          | 37                                 | 37                                                   | 0,01                    |
|                                  | 07.2025          | €                      | 2.444                    | AUD 4.383                        | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 83                       | DKK 617                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | ILS                    | 13                       | \$ 4                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG                              | 07.2025          | TWD                    | 592                      | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 210                      | IDR 3.423.866                    | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 248                      | SGD 320                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 272                      | TWD 8.084                        | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | AUD                    | 4.383                    | € 2.440                          | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 5.456                    | \$ 758                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | DKK                    | 617                      | € 83                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | SGD                    | 319                      | \$ 248                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 3.245                    | 99                               | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 405                      | CNH 2.928                        | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          |                        | 232                      | INR 19.941                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          |                        | 331                      | TWD 10.728                       | 35                                 | 35                                                   | 0,01                    |
|                                  | 07.2025          | €                      | 78                       | CHF 73                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 1.026                    | £ 878                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | CHF                    | 73                       | € 78                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB                              | 08.2025          | \$                     | 2                        | INR 154                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          |                        | 150                      | TWD 4.903                        | 17                                 | 17                                                   | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          |                        | 177                      | INR 15.290                       | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | €                      | 639                      | CHF 600                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | ILS                    | 132                      | \$ 37                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025          | KRW                    | 23.292                   | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | THB                    | 741                      | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 17                       | KRW 23.303                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | CHF                    | 598                      | € 639                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 09.2025          | \$                     | 389                      | MXN 7.543                        | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|                                  |                  |                        |                          | € 1.725                          | € (945)                            | € 780                                                | 0,16                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    | € 769                                                | 0,16                    |
| Summe Anlagen                    |                  |                        |                          |                                  |                                    | € 547.453                                            | 111,73                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                        |                          |                                  |                                    | € (57.487)                                           | (11,73)                 |
| Nettovermögen                    |                  |                        |                          |                                  |                                    | € 489.966                                            | 100,00                  |

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

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

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

Barmittel in Höhe von 13.596 EUR (31. Dezember 2024: 10.889 EUR) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert        |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                | € 527.145                                                 | € 5.942                                                | € 533.087        |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                  | 17.300                                                    | 0                                                      | 17.300           |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (189)                                                              | (2.745)                                                   | 0                                                      | (2.934)          |
| <b>Summen</b>                 | <b>€ (189)</b>                                                     | <b>€ 541.700</b>                                          | <b>€ 5.942</b>                                         | <b>€ 547.453</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert        |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                | € 554.343                                                 | € 0                                                    | € 554.343        |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (1.140)                                                            | (1.582)                                                   | 0                                                      | (2.722)          |
| <b>Summen</b>                 | <b>€ (1.140)</b>                                                   | <b>€ 552.761</b>                                          | <b>€ 0</b>                                             | <b>€ 551.621</b> |

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

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

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | € (7)                            | € 0                                | € (7)                           | € 3                              | € 0                                | € 3                             |
| BOA        | 500                              | (310)                              | 190                             | 5                                | 0                                  | 5                               |
| BPS        | 298                              | (260)                              | 38                              | (5)                              | 0                                  | (5)                             |
| BRC        | (61)                             | 0                                  | (61)                            | 40                               | 0                                  | 40                              |
| CBK        | 36                               | 0                                  | 36                              | 80                               | 0                                  | 80                              |
| DUB        | 0                                | 0                                  | 0                               | 23                               | 0                                  | 23                              |
| GLM        | (5)                              | 0                                  | (5)                             | 7                                | 0                                  | 7                               |
| GST        | (5)                              | 0                                  | (5)                             | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| JPM        | (5)                              | 0                                  | (5)                             | 39                               | 0                                  | 39                              |
| MBC        | (55)                             | 0                                  | (55)                            | (332)                            | 0                                  | (332)                           |
| MYI        | (14)                             | 0                                  | (14)                            | (3)                              | 0                                  | (3)                             |
| RBC        | (1)                              | 0                                  | (1)                             | 12                               | 0                                  | 12                              |
| RYL        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (18)                             | 0                                  | (18)                            |
| SCX        | 67                               | 0                                  | 67                              | (151)                            | 0                                  | (151)                           |
| SOG        | 16                               | 0                                  | 16                              | (10)                             | 0                                  | (10)                            |
| SSB        | 1                                | 0                                  | 1                               | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| UAG        | 4                                | 0                                  | 4                               | (3)                              | 0                                  | (3)                             |

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

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 62,00             | 69,53             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 16,82             | 15,29             |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 2,56              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,23              | 0,07              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,17              | 0,21              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,26              | 0,02              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 17,96             | 14,88             |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>     | <b>100,00</b>     |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 57,64             | 64,05             |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 15,67             | 12,99             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 0,53              | 2,90              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 4,00              | 3,68              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 6,00              | 4,21              |
| Staatsemissionen                                                                       | 24,95             | 21,62             |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 3,53              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,18              | (0,14)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | k. A.             | (0,01)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,03              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,04              | 0,01              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,97)            | (0,37)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | k. A.             |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | 0,16              | (0,05)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (11,73)           | (8,91)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   | <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                          |                |                          |                                   | <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   |
| Altice France S.A.                        |                |                          |                                   | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                      |                |                          |                                   | Thames Water Super Senior Issuer PLC      |                |                          |                                   |
| 5,279 % fällig am 02.02.2026              | € 1.396        | € 1.234                  | 0,07                              | 4,250 % fällig am 03.05.2030                             | € 3.400        | € 3.550                  | 0,19                              | 9,750 % fällig am 10.10.2025              | £ 274          | € 299                    | 0,02                              |
| 7,779 % fällig am 15.08.2028              | 99             | 89                       | 0,00                              | HLD Europe S.C.A.                                        | 6.700          | 6.847                    | 0,37                              | UBS Group AG                              | \$ 1.600       | 1.483                    | 0,08                              |
| 9,756 % fällig am 15.08.2028              | \$ 792         | 613                      | 0,03                              | 4,125 % fällig am 02.04.2030                             |                |                          |                                   | 6,537 % fällig am 12.08.2033              | € 5.300        | 5.973                    | 0,32                              |
| Charter Communications Operating LLC      |                |                          |                                   | Host Hotels & Resorts LP                                 | \$ 800         | 686                      | 0,04                              | 7,750 % fällig am 01.03.2029              |                |                          |                                   |
| 6,548 % fällig am 15.12.2031              | 2.352          | 2.009                    | 0,11                              | 5,700 % fällig am 01.07.2034                             |                |                          |                                   | UniCredit SpA                             | \$ 500         | 416                      | 0,02                              |
| Numericable Group S.A.                    |                |                          |                                   | HSBC Holdings PLC                                        | € 1.400        | 1.417                    | 0,08                              | 1,982 % fällig am 03.06.2027              |                |                          |                                   |
| 5,186 % fällig am 31.07.2025              | € 1.696        | 1.492                    | 0,08                              | 3,445 % fällig am 25.09.2030                             |                |                          |                                   | VICI Properties LP                        | 400            | 336                      | 0,02                              |
| Pantheon Senior Debt Secondaries          |                |                          |                                   | Hudson Pacific Properties LP                             | \$ 800         | 665                      | 0,04                              | 3,750 % fällig am 15.02.2027              | 300            | 247                      | 0,01                              |
| 6,317 % fällig am                         |                |                          |                                   | 5,950 % fällig am 15.02.2028                             |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.02.2029              | 1.300          | 1.063                    | 0,06                              |
| 26.03.2026 (i)                            | \$ 600         | 511                      | 0,03                              | IHG Finance LLC                                          | € 6.400        | 6.428                    | 0,34                              | 4,125 % fällig am 15.08.2030              | 300            | 255                      | 0,01                              |
| Project Alfa                              |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 27.09.2031                             | 7.420          | 7.783                    | 0,42                              | 4,500 % fällig am 15.01.2028              | 10.708         | 8.966                    | 0,48                              |
| 4,256 % fällig am                         | € 378          | 378                      | 0,02                              | 4,375 % fällig am 28.11.2029                             |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 01.02.2027              | 600            | 518                      | 0,03                              |
| 27.02.2026 (i)                            |                |                          |                                   | ING Groep NV                                             | 2.700          | 2.748                    | 0,15                              | Yango Justice International Ltd.          |                |                          |                                   |
| Project Hudson                            |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 03.09.2030                             |                |                          |                                   | 7,875 % fällig am                         | 12.600         | 55                       | 0,00                              |
| 7,730 % fällig am 29.05.2026              | \$ 800         | 691                      | 0,04                              | Intesa Sanpaolo SpA                                      | \$ 14.275      | 14.122                   | 0,75                              | 04.09.2024 ^                              |                |                          |                                   |
| Republic of Panama                        |                |                          |                                   | 8,248 % fällig am 21.11.2033                             |                |                          |                                   |                                           | 180.116        | 9,62                     |                                   |
| 4,804 % fällig am 01.04.2027              | € 8.700        | 8.741                    | 0,47                              | Iridium Capital PLC                                      | € 1.500        | 1.627                    | 0,09                              |                                           |                |                          |                                   |
| SCUR-Alpha 1503 GmbH                      |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 18.06.2029                             |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| 7,656 % - 7,686 % fällig am               |                |                          |                                   | JAB Holdings BV                                          | 3.800          | 3.872                    | 0,21                              |                                           |                |                          |                                   |
| 29.03.2030                                | 1.200          | 1.184                    | 0,06                              | 4,375 % fällig am 25.04.2034                             |                |                          |                                   | Altice France S.A.                        |                |                          |                                   |
| 7,656 % - 7,686 % fällig am               | \$ 2.444       | 1.972                    | 0,10                              | 5,000 % fällig am 12.06.2033                             | 700            | 747                      | 0,04                              | 3,375 % fällig am 15.01.2028              | € 2.700        | 2.267                    | 0,12                              |
| 29.03.2030                                |                |                          |                                   | Jyske Realkredit A/S                                     |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.01.2029              | 100            | 84                       | 0,00                              |
| Stepstone Group Midco GmbH                |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 01.10.2043                             | DKK 0          | 0                        | 0,00                              | 4,250 % fällig am 15.10.2029              | 2.400          | 2.020                    | 0,11                              |
| 6,673 % fällig am 26.04.2032              | € 8.700        | 8.548                    | 0,46                              | 1,000 % fällig am 01.10.2050                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,500 % fällig am 15.01.2028              | \$ 400         | 287                      | 0,02                              |
| Subcalidora                               |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2053                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,500 % fällig am 15.10.2029              | 200            | 141                      | 0,01                              |
| 7,730 % fällig am 14.08.2029              | 1.200          | 1.206                    | 0,06                              | 1,500 % fällig am 01.10.2037                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,875 % fällig am 01.02.2027              | € 100          | 90                       | 0,01                              |
|                                           |                | 28.668                   | 1,53                              | 1,500 % fällig am 01.10.2050                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 8,125 % fällig am 01.02.2027              | \$ 800         | 614                      | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | Kaisa Group Holdings Ltd.                                |                |                          |                                   | Altrad Investment Authority S.A.S.        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 10,875 % fällig am 23.07.2023 ^                          | \$ 5.400       | 207                      | 0,01                              | 4,429 % fällig am 23.06.2032              | € 4.000        | 4.005                    | 0,21                              |
|                                           |                |                          |                                   | 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^                          | 3.500          | 134                      | 0,01                              | American Airlines Pass-Through Trust      |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 11,650 % fällig am 01.06.2026 ^                          | 4.000          | 153                      | 0,01                              | 3,350 % fällig am 15.04.2031              | \$ 311         | 252                      | 0,01                              |
|                                           |                |                          |                                   | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.                   | € 8.842        |                          |                                   | Aston Martin Capital Holdings Ltd.        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 12.11.2025                             |                | 8.785                    | 0,47                              | 10,375 % fällig am 31.03.2029             | £ 500          | 546                      | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | Morgan Stanley                                           |                |                          |                                   | Barry Callebaut Services NV               | € 7.400        | 7.472                    | 0,40                              |
|                                           |                |                          |                                   | 3,790 % fällig am 21.03.2030                             | 1.900          | 1.957                    | 0,10                              | 3,750 % fällig am 19.02.2028              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                     |                |                          |                                   | Bayer U.S. Finance LLC                    |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 01.10.2043                             | DKK 0          | 0                        | 0,00                              | 4,375 % fällig am 15.12.2028              | \$ 200         | 169                      | 0,01                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 6,375 % fällig am 21.11.2030              | 2.300          | 2.083                    | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2053                             | 0              | 0                        | 0,00                              | Burberry Group PLC                        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2050                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,750 % fällig am 20.06.2030              | £ 3.600        | 4.207                    | 0,23                              |
|                                           |                |                          |                                   | Nykredit Realkredit A/S                                  |                |                          |                                   | Carvana Co. (13,000 % PIK)                |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 01.10.2043                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 13,000 % fällig am                        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 01.06.2030 (c)                            | \$ 1.556       | 1.395                    | 0,08                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2053                             | 0              | 0                        | 0,00                              | Carvana Co. (14,000 % PIK)                |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2037                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 14,000 % fällig am                        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2050                             | 0              | 0                        | 0,00                              | 01.06.2031 (c)                            | 3.450          | 3.384                    | 0,18                              |
|                                           |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.10.2036                             | 0              | 0                        | 0,00                              | DISH DBS Corp.                            |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC           |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 01.12.2026              | 2.873          | 2.226                    | 0,12                              |
|                                           |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am                                        |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 01.12.2028              | 2.700          | 1.995                    | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | 05.04.2032 (e)                                           | \$ 6.500       | 3.941                    | 0,21                              | ELO SACA                                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Realkredit Danmark A/S                                   |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 29.01.2026              | € 3.400        | 3.360                    | 0,18                              |
|                                           |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.04.2036                             | DKK 0          | 0                        | 0,00                              | Energy Transfer LP                        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Realty Income Corp.                                      |                |                          |                                   | 5,600 % fällig am 01.09.2034              | \$ 2.300       | 1.991                    | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 20.06.2031                             | € 7.100        | 7.083                    | 0,38                              | Essent Group Ltd.                         |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Sagax AB                                                 |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.07.2029              | 5.600          | 4.944                    | 0,26                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 30.01.2027                             | 7.082          | 6.903                    | 0,37                              | Flora Food Management BV                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Sagax Euro MTN NL BV                                     |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 02.07.2029              | € 1.100        | 1.118                    | 0,06                              |
|                                           |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 26.01.2028                             | 1.400          | 1.324                    | 0,07                              | Fortune Star BVI Ltd.                     |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Sirius Real Estate Ltd.                                  |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 02.10.2026              | 10.100         | 9.797                    | 0,52                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 22.06.2026                             | 4.100          | 4.026                    | 0,21                              | Informa PLC                               |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 24.11.2028                             | 5.200          | 4.931                    | 0,26                              | 3,375 % fällig am 09.06.2031              | 3.900          | 3.881                    | 0,21                              |
|                                           |                |                          |                                   | Societe Generale S.A.                                    |                |                          |                                   | Ipsen S.A.                                |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 2,797 % fällig am 19.01.2028                             | \$ 10.800      | 8.937                    | 0,48                              | 3,875 % fällig am 25.03.2032              | 5.000          | 5.040                    | 0,27                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,691 % fällig am 10.01.2034                             | 300            | 273                      | 0,01                              | JDE Peet's NV                             |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % bar oder 6,000 % PIK) |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 23.01.2034              | 1.300          | 1.362                    | 0,07                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am                                        |                |                          |                                   | JetBlue Pass-Through Trust                |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 30.09.2026 ^ (c)                                         | 245            | 26                       | 0,00                              | 2,750 % fällig am 15.11.2033              | \$ 818         | 612                      | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK) |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.05.2034              | 71             | 56                       | 0,00                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am                                        |                |                          |                                   | Mitchells & Butlers Finance PLC           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 30.09.2027 ^ (c)                                         | 246            | 26                       | 0,00                              | 4,808 % fällig am 15.12.2030              | £ 283          | 328                      | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK) |                |                          |                                   | 5,111 % fällig am 15.12.2030              | \$ 489         | 402                      | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am                                        |                |                          |                                   | Nissan Motor Co. Ltd.                     |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 30.09.2027 ^ (c)                                         | 492            | 52                       | 0,00                              | 4,345 % fällig am 17.09.2027              | 1.200          | 982                      | 0,05                              |
|                                           |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK) |                |                          |                                   | Roadster Finance DAC                      |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am                                        |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 08.12.2032              | € 400          | 392                      | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | 30.09.2028 ^ (c)                                         | 740            | 79                       | 0,00                              | Thames Water Super Senior Issuer PLC      |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK) |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 10.10.2027              | £ 272          | 350                      | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am                                        |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 30.09.2029 ^ (c)                                         | 742            | 79                       | 0,00                              |                                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK) |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am                                        |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 30.09.2030 ^ (c)                                         | 349            | 37                       | 0,00                              |                                           |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Thames Water Utilities Finance PLC</b>                            |                |                          |                                   | <b>American Home Mortgage Assets Trust</b>                 |                |                          |                                   | <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>    |                |                          |                                   |
| 0,875 % fällig am 31.01.2030                                         | € 3.500        | € 2.228                  | 0,12                              | 4,644 % fällig am 25.12.2046                               | \$ 1.124       | € 820                    | 0,04                              | 4,180 % fällig am 20.02.2036                                | \$ 111         | € 84                     | 0,01                              |
| 1,250 % fällig am 31.01.2034                                         | 100            | 65                       | 0,00                              | 5,319 % fällig am 25.11.2046                               | 442            | 91                       | 0,01                              | 4,551 % fällig am 25.11.2037                                | 73             | 57                       | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am 18.04.2029                                         | 100            | 66                       | 0,00                              | <b>Banc of America Alternative Loan Trust</b>              |                |                          |                                   | 4,641 % fällig am 20.12.2035                                | 44             | 33                       | 0,00                              |
| 4,375 % fällig am 18.01.2033                                         | 2.000          | 1.309                    | 0,07                              | 2,206 % fällig am 25.06.2037 (a)                           | 191            | 20                       | 0,00                              | 4,860 % fällig am 25.09.2047                                | 56             | 43                       | 0,00                              |
| 4,375 % fällig am 03.07.2036                                         | £ 200          | 153                      | 0,01                              | 4,794 % fällig am 25.06.2037                               | 176            | 108                      | 0,01                              | 4,925 % fällig am 25.01.2036                                | 21             | 17                       | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 11.02.2043                                         | 400            | 311                      | 0,02                              | 5,500 % fällig am 25.10.2033                               | 126            | 108                      | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.03.2035                                | 262            | 129                      | 0,01                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.07.2046                               | 174            | 129                      | 0,01                              | 5,054 % fällig am 25.03.2035                                | 12             | 9                        | 0,00                              |
| <b>Thames Water Utilities Ltd.</b>                                   |                |                          |                                   | <b>Banc of America Funding Trust</b>                       |                |                          |                                   | 5,174 % fällig am 25.02.2035                                | 146            | 116                      | 0,01                              |
| 0,000 % fällig am 22.03.2027 (e)                                     | 40             | 40                       | 0,00                              | 4,812 % fällig am 20.10.2036                               | 59             | 39                       | 0,00                              | 5,397 % fällig am 20.09.2036                                | 15             | 11                       | 0,00                              |
| <b>Ubisoft Entertainment S.A.</b>                                    |                |                          |                                   | 4,846 % fällig am 20.09.2046                               | 30             | 23                       | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.12.2035                                | 62             | 25                       | 0,00                              |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027                                         | € 4.200        | 3.791                    | 0,20                              | 4,854 % fällig am 25.04.2037                               | 52             | 38                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.03.2037                                | 89             | 32                       | 0,00                              |
| <b>UCB S.A.</b>                                                      |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 20.04.2035                               | 45             | 36                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.04.2037                                | 14             | 6                        | 0,00                              |
| 4,250 % fällig am 20.03.2030                                         | 800            | 821                      | 0,04                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                               | 232            | 163                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.07.2037                                | 162            | 59                       | 0,00                              |
| <b>United Airlines Pass-Through Trust</b>                            |                |                          |                                   | 6,878 % fällig am 20.09.2046                               | 15             | 12                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.11.2036                                | 243            | 61                       | 0,00                              |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033                                         | \$ 757         | 578                      | 0,03                              | <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                      |                |                          |                                   | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b> |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029                                         | 159            | 138                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.10.2036                               | 6              | 5                        | 0,00                              | 5,584 % fällig am 25.09.2034                                | 11             | 18                       | 0,00                              |
| <b>Universal Music Group NV</b>                                      |                |                          |                                   | <b>BCAP LLC Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.01.2036                                | 160            | 80                       | 0,00                              |
| 3,750 % fällig am 30.06.2032                                         | € 9.200        | 9.438                    | 0,50                              | 4,770 % fällig am 26.03.2037                               | 48             | 33                       | 0,00                              | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Certificates</b>          |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 13.06.2031                                         | 7.500          | 7.828                    | 0,42                              | 5,172 % fällig am 27.03.2037                               | 186            | 136                      | 0,01                              | 6,344 % fällig am 15.07.2032                                | 1.024          | 867                      | 0,05                              |
| <b>Var Energi ASA</b>                                                |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.11.2034                               | 10             | 7                        | 0,00                              | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b> |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 12.03.2031                                         | 8.600          | 8.642                    | 0,46                              | <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>         |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.08.2036                                | 1.157          | 263                      | 0,01                              |
| <b>Venture Global LNG, Inc.</b>                                      |                |                          |                                   | 5,661 % fällig am 25.02.2035                               | 5              | 4                        | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.07.2036                                | 177            | 70                       | 0,00                              |
| 9,500 % fällig am 01.02.2029                                         | \$ 12.181      | 11.311                   | 0,60                              | 6,373 % fällig am 25.12.2046                               | 134            | 95                       | 0,01                              | 6,500 % fällig am 25.10.2021                                | 205            | 5                        | 0,00                              |
| <b>Ubisoft Entertainment S.A.</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                            |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.02.2022                                | 464            | 23                       | 0,00                              |
| 9,875 % fällig am 01.02.2032                                         | 1.625          | 1.496                    | 0,08                              | 4,333 % fällig am 25.11.2036                               | 55             | 21                       | 0,00                              | <b>Curzon Mortgages PLC</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Vmed O2 UK Financing PLC</b>                                      |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 25.05.2036                               | 293            | 120                      | 0,01                              | 6,032 % fällig am 28.07.2049                                | £ 5.528        | 6.474                    | 0,35                              |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032 (b)                                     | € 10.000       | 10.150                   | 0,54                              | 4,810 % fällig am 25.07.2035                               | 276            | 159                      | 0,01                              | 6,782 % fällig am 28.07.2049                                | 2.958          | 3.469                    | 0,19                              |
| <b>Windstream Services LLC</b>                                       |                |                          |                                   | 4,909 % fällig am 25.09.2035                               | 143            | 42                       | 0,00                              | <b>Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust</b>        |                |                          |                                   |
| 8,250 % fällig am 01.10.2031                                         | \$ 4.100       | 3.661                    | 0,20                              | <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>          |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.04.2037                                | \$ 154         | 92                       | 0,01                              |
| <b>Yorkshire Water Finance PLC</b>                                   |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.11.2034                               | 120            | 91                       | 0,01                              | <b>Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC</b>          |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 18.11.2034                                         | £ 4.200        | 5.068                    | 0,27                              | <b>Bridgegate Funding PLC</b>                              | £ 24.122       | 28.406                   | 1,52                              | Trust Certificates                                          |                |                          |                                   |
|                                                                      |                | 134.946                  | 7,20                              | 6,564 % fällig am 16.10.2062                               |                |                          |                                   | 4,319 % fällig am 27.06.2037                                | 2.382          | 1.804                    | 0,10                              |
| <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                                        |                |                          |                                   | <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                        |                |                          |                                   | <b>Dilosk RMBS DAC</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>Edison International</b>                                          |                |                          |                                   | 4,266 % fällig am 25.03.2037                               | \$ 16          | 13                       | 0,00                              | 2,786 % fällig am 24.09.2060                                | € 7.219        | 7.217                    | 0,39                              |
| 6,250 % fällig am 15.03.2030                                         | \$ 500         | 433                      | 0,02                              | 4,639 % fällig am 25.01.2036                               | 145            | 112                      | 0,01                              | <b>Dutch Property Finance BV</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>                                |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.05.2037                               | 95             | 35                       | 0,00                              | 2,911 % fällig am 28.10.2059                                | 5.129          | 5.133                    | 0,27                              |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027                                         | 3.275          | 2.700                    | 0,15                              | <b>ChaseFlex Trust</b>                                     |                |                          |                                   | 3,061 % fällig am 28.04.2064                                | 12.050         | 12.094                   | 0,65                              |
| 6,100 % fällig am 15.01.2029                                         | 6.800          | 6.004                    | 0,32                              | 5,000 % fällig am 25.07.2037                               | 67             | 18                       | 0,00                              | <b>Edenbrook Mortgage Funding PLC</b>                       |                |                          |                                   |
|                                                                      |                | 9.137                    | 0,49                              | <b>ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through</b>   |                |                          |                                   | 5,109 % fällig am 22.03.2057                                | £ 4.188        | 4.901                    | 0,26                              |
| <b>Summe Unternehmensanleihen und Wechsel</b>                        |                | 324.199                  | 17,31                             | <b>Certificates Trust</b>                                  |                |                          |                                   | <b>EuroMASTR PLC</b>                                        |                |                          |                                   |
|                                                                      |                |                          |                                   | 4,283 % fällig am 25.08.2037                               | 19             | 14                       | 0,00                              | 4,558 % fällig am 15.06.2040                                | 79             | 90                       | 0,01                              |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                 |                |                          |                                   | <b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>  |                |                          |                                   |
| <b>Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK)</b> |                |                          |                                   | 4,764 % fällig am 25.12.2034                               | 3              | 2                        | 0,00                              | 4,355 % fällig am 25.01.2036                                | \$ 135         | 57                       | 0,00                              |
| 8,000 % fällig am 31.12.2026 (c)                                     | € 1.909        | 773                      | 0,04                              | 4,770 % fällig am 25.03.2037                               | 33             | 24                       | 0,00                              | 5,338 % fällig am 25.04.2036                                | 38             | 27                       | 0,00                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 4,832 % fällig am 25.04.2037                               | 111            | 85                       | 0,01                              | <b>First Horizon Mortgage Pass-Through Trust</b>            |                |                          |                                   |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                         |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.12.2035                               | 107            | 44                       | 0,00                              | 6,344 % fällig am 25.11.2037                                | 17             | 10                       | 0,00                              |
| <b>Freddie Mac</b>                                                   |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.11.2037                               | 139            | 48                       | 0,00                              | <b>GS Mortgage Securities Corp. Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 25.09.2055                                         | \$ 6.003       | 4.694                    | 0,25                              | <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                 |                |                          |                                   | 3,659 % fällig am 10.01.2043                                | 1.475          | 1.181                    | 0,06                              |
| 4,750 % fällig am 25.07.2056 - 25.11.2057                            | 14.183         | 11.825                   | 0,63                              | 6,000 % fällig am 25.01.2037                               | 180            | 138                      | 0,01                              | <b>GSC Capital Corp. Mortgage Trust</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Ginnie Mae, TBA</b>                                               |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.06.2037                               | 299            | 224                      | 0,01                              | 4,794 % fällig am 25.05.2036                                | 47             | 38                       | 0,00                              |
| 3,000 % fällig am 01.08.2055                                         | 2.900          | 2.185                    | 0,12                              | <b>Commercial Mortgage Trust</b>                           |                |                          |                                   | <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055                                         | 3.100          | 2.593                    | 0,14                              | 3,140 % fällig am 10.10.2036                               | 1.494          | 1.184                    | 0,06                              | 5,500 % fällig am 25.06.2035                                | 75             | 66                       | 0,00                              |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                              |                |                          |                                   | 3,545 % fällig am 10.02.2036                               | 6.000          | 5.023                    | 0,27                              | <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                       |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.05.2052                                         | 1.141          | 843                      | 0,05                              | 5,608 % fällig am 15.09.2033                               | 4.000          | 3.122                    | 0,17                              | 4,300 % fällig am 19.06.2036                                | 89             | 39                       | 0,00                              |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>                         |                |                          |                                   | <b>Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust</b> |                |                          |                                   | 5,174 % fällig am 19.12.2035                                | 158            | 68                       | 0,00                              |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055                                         | 10.700         | 7.889                    | 0,42                              | 3,931 % fällig am 25.08.2037                               | 55             | 21                       | 0,00                              | 7,297 % fällig am 19.12.2035                                | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055                                         | 1.800          | 1.426                    | 0,08                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                               | 48             | 19                       | 0,00                              | <b>HSI Asset Loan Obligation Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055                                         | 164.800        | 137.516                  | 7,34                              | <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                  |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                | 44             | 34                       | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055                            | 197.900        | 168.474                  | 8,99                              | 4,144 % fällig am 25.05.2036                               | 5              | 4                        | 0,00                              | <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                          |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                                         | 318.200        | 275.222                  | 14,69                             | 4,400 % fällig am 25.06.2037                               | 31             | 25                       | 0,00                              | 3,446 % fällig am 25.06.2036                                | 37             | 27                       | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 01.08.2055                                         | 237.200        | 208.356                  | 11,12                             | 5,500 % fällig am 25.03.2035                               | 4.322          | 3.287                    | 0,18                              | 3,886 % fällig am 25.06.2037                                | 960            | 498                      | 0,03                              |
| 7,000 % fällig am 01.08.2055 - 01.09.2055                            | 13.650         | 12.194                   | 0,65                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                               | 64             | 31                       | 0,00                              | 3,961 % fällig am 25.11.2035                                | 71             | 57                       | 0,00                              |
|                                                                      |                | 833.217                  | 44,48                             | 5,500 % fällig am 25.12.2035                               | 61             | 26                       | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.09.2037                                | 3.034          | 2.588                    | 0,14                              |
| <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                                          |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.02.2036                               | 43             | 21                       | 0,00                              | 5,054 % fällig am 25.10.2036                                | 9.882          | 4.389                    | 0,23                              |
| <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)</b>              |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.04.2047                               | 91             | 40                       | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.01.2035                                | 44             | 29                       | 0,00                              |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033                                         | 9.717          | 8.042                    | 0,43                              | 6,000 % fällig am 25.03.2036                               | 195            | 75                       | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.11.2037                                | 42             | 14                       | 0,00                              |
| 1,500 % fällig am 15.02.2053                                         | 3.669          | 2.478                    | 0,13                              | 6,000 % fällig am 25.05.2036                               | 1.047          | 410                      | 0,02                              | <b>Jeronimo Funding DAC</b>                                 |                |                          |                                   |
|                                                                      |                | 10.520                   | 0,56                              | 6,000 % fällig am 25.08.2036                               | 223            | 108                      | 0,01                              | 3,408 % fällig am 25.10.2064                                | € 15.436       | 15.461                   | 0,83                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.04.2037                               | 56             | 24                       | 0,00                              | <b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Alba PLC</b>                                                      |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.05.2037                               | 782            | 283                      | 0,02                              | 4,794 % fällig am 25.12.2036                                | \$ 3           | 3                        | 0,00                              |
| 4,618 % fällig am 15.12.2038                                         | £ 1.110        | 1.222                    | 0,07                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                               | 306            | 123                      | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.10.2036                                | 2.255          | 1.740                    | 0,09                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.07.2036                               | 1.272          | 456                      | 0,02                              | 4,939 % fällig am 27.06.2037                                | 145            | 74                       | 0,00                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.12.2036                               | 20             | 7                        | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.03.2036                                | 171            | 75                       | 0,00                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.12.2036                               | 59             | 21                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.05.2036                                | 2              | 1                        | 0,00                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.08.2037                               | 338            | 121                      | 0,01                              | <b>Jubilee Place BV</b>                                     |                |                          |                                   |
|                                                                      |                |                          |                                   | 6,629 % fällig am 25.09.2034                               | 2              | 2                        | 0,00                              | 2,804 % fällig am 17.09.2060                                | € 12.338       | 12.373                   | 0,66                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>   |                |                          |                                   | 3,113 % fällig am 17.01.2059                                | 3.838          | 3.847                    | 0,21                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.04.2036                               | 122            | 92                       | 0,01                              | 3,263 % fällig am 17.10.2057                                | 787            | 788                      | 0,04                              |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Jupiter Mortgage PLC</b>                                |                |                          |                                   | 5,774 % fällig am 20.04.2051                                                       | £ 1.264        | € 1.478                  | 0,08                              | <b>Argent Securities Trust</b>                                        |                |                          |                                   |
| 5,298 % fällig am 20.07.2055                               | £ 1.941        | € 2.273                  | 0,12                              | 6,474 % fällig am 20.04.2051                                                       | 1.053          | 1.232                    | 0,07                              | 4,584 % fällig am 25.09.2036                                          | \$ 807         | € 221                    | 0,01                              |
| <b>Lavender Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 6,698 % fällig am 20.07.2053                                                       | 423            | 498                      | 0,03                              | 4,634 % fällig am 25.06.2036                                          | 444            | 103                      | 0,01                              |
| 6,250 % fällig am 26.10.2036                               | \$ 154         | 60                       | 0,00                              | 7,474 % fällig am 20.04.2051                                                       | 843            | 985                      | 0,05                              | <b>Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   |
| <b>Lehman Mortgage Trust</b>                               |                |                          |                                   | 7,798 % fällig am 20.07.2053                                                       | 400            | 472                      | 0,03                              | 5,074 % fällig am 25.01.2036                                          | 416            | 327                      | 0,02                              |
| 4,362 % fällig am 25.12.2035                               | 159            | 21                       | 0,00                              | 8,474 % fällig am 20.04.2051                                                       | 526            | 615                      | 0,03                              | <b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| 5,094 % fällig am 25.01.2036                               | 35             | 29                       | 0,00                              | 8,798 % fällig am 20.07.2053                                                       | 400            | 472                      | 0,03                              | 5,409 % fällig am 25.06.2035                                          | 372            | 301                      | 0,02                              |
| <b>Lehman XS Trust</b>                                     |                |                          |                                   | <b>Towd Point Mortgage Trust</b>                                                   |                |                          |                                   | 5,434 % fällig am 25.06.2037                                          | 64             | 45                       | 0,00                              |
| 4,794 % fällig am 25.12.2036                               | 546            | 452                      | 0,02                              | 3,250 % fällig am 25.03.2058                                                       | \$ 3.302       | 2.781                    | 0,15                              | 5,484 % fällig am 25.03.2034                                          | 95             | 79                       | 0,00                              |
| <b>Ludgate Funding PLC</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                                                    |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>                     |                |                          |                                   |
| 2,175 % fällig am 01.12.2060                               | € 2.205        | 2.131                    | 0,11                              | 5,029 % fällig am 20.12.2066                                                       | £ 8.523        | 9.962                    | 0,53                              | 5,334 % fällig am 25.08.2034                                          | 937            | 791                      | 0,04                              |
| 2,488 % fällig am 01.01.2061                               | 3.981          | 3.848                    | 0,21                              | 5,117 % fällig am 20.05.2066                                                       | 1.756          | 2.054                    | 0,11                              | <b>Carrington Mortgage Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Mansard Mortgages PLC</b>                               |                |                          |                                   | 5,798 % fällig am 20.10.2064                                                       | 1.955          | 2.283                    | 0,12                              | 4,694 % fällig am 25.02.2037                                          | 108            | 89                       | 0,01                              |
| 5,008 % fällig am 15.12.2049                               | £ 505          | 585                      | 0,03                              | 7,448 % fällig am 20.10.2064                                                       | 2.300          | 2.689                    | 0,14                              | <b>Centex Home Equity Loan Trust</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>               |                |                          |                                   | <b>Trinity Square PLC</b>                                                          |                |                          |                                   | 5,484 % fällig am 25.10.2035                                          | 3.642          | 3.064                    | 0,16                              |
| 4,530 % fällig am 25.03.2035                               | \$ 10          | 8                        | 0,00                              | 5,217 % fällig am 15.07.2059                                                       | 10.072         | 11.786                   | 0,63                              | <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>              |                |                          |                                   |
| <b>Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust</b>          |                |                          |                                   | <b>Uropa Securities PLC</b>                                                        |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 25.12.2046                                          | 2.790          | 2.264                    | 0,12                              |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037                               | 118            | 77                       | 0,00                              | 2,643 % fällig am 10.10.2040                                                       | € 1.549        | 1.422                    | 0,08                              | 4,874 % fällig am 25.05.2037                                          | 6.718          | 5.509                    | 0,29                              |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>              |                |                          |                                   | <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>                               |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.03.2036                                          | 846            | 637                      | 0,03                              |
| 4,448 % fällig am 25.03.2036                               | 217            | 92                       | 0,01                              | 3,876 % fällig am 25.05.2037                                                       | \$ 31          | 23                       | 0,00                              | <b>Fieldstone Mortgage Investment Trust</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Merrion Square Residential DAC</b>                      |                |                          |                                   | 4,017 % fällig am 25.10.2036                                                       | 21             | 16                       | 0,00                              | 5,214 % fällig am 25.12.2035                                          | 9.291          | 7.067                    | 0,38                              |
| 2,999 % fällig am 24.03.2081                               | € 12.472       | 12.488                   | 0,67                              | 4,142 % fällig am 25.12.2036                                                       | 211            | 159                      | 0,01                              | <b>First NLC Trust</b>                                                |                |                          |                                   |
| <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                  |                |                          |                                   | 5,135 % fällig am 25.12.2035                                                       | 5              | 4                        | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.08.2037                                          | 126            | 54                       | 0,00                              |
| 4,664 % fällig am 25.03.2036                               | \$ 92          | 44                       | 0,00                              | 5,214 % fällig am 25.10.2044                                                       | 45             | 37                       | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.08.2037                                          | 42             | 18                       | 0,00                              |
| 5,962 % fällig am 25.06.2036                               | 4.126          | 933                      | 0,05                              | <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>                  |                |                          |                                   | <b>Fremont Home Loan Trust</b>                                        |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037                               | 111            | 49                       | 0,00                              | 5,169 % fällig am 25.04.2047                                                       | 300            | 210                      | 0,01                              | 4,554 % fällig am 25.01.2037                                          | 9.668          | 3.758                    | 0,20                              |
| 6,201 % fällig am 25.02.2047                               | 2.799          | 824                      | 0,04                              | 6,000 % fällig am 25.07.2036                                                       | 84             | 52                       | 0,00                              | 4,584 % fällig am 25.01.2037                                          | 199            | 77                       | 0,00                              |
| <b>Newgate Funding PLC</b>                                 |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                                       | 22             | 17                       | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.08.2036                                          | 175            | 47                       | 0,00                              |
| 2,195 % fällig am 01.12.2050                               | € 1.369        | 1.293                    | 0,07                              | <b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>                                          |                |                          |                                   | 4,774 % fällig am 25.02.2037                                          | 614            | 160                      | 0,01                              |
| 2,225 % fällig am 01.12.2050                               | 949            | 916                      | 0,05                              | 6,250 % fällig am 25.11.2037                                                       | 24             | 18                       | 0,00                              | 5,304 % fällig am 25.11.2034                                          | 1.080          | 829                      | 0,04                              |
| 2,575 % fällig am 15.12.2050                               | 121            | 119                      | 0,01                              |                                                                                    |                |                          |                                   | 5,364 % fällig am 25.04.2035                                          | 2.174          | 1.788                    | 0,10                              |
| 4,529 % fällig am 01.12.2050                               | £ 591          | 671                      | 0,04                              |                                                                                    |                |                          |                                   | <b>GSA Home Equity Trust</b>                                          |                |                          |                                   |
| 4,558 % fällig am 15.12.2050                               | 1.829          | 2.026                    | 0,11                              |                                                                                    |                |                          |                                   | 5,772 % fällig am 25.11.2036                                          | 119            | 28                       | 0,00                              |
| 5,358 % fällig am 15.12.2050                               | 133            | 153                      | 0,01                              |                                                                                    |                |                          |                                   | <b>GSAMP Trust</b>                                                    |                |                          |                                   |
| <b>Nomura Resecuritization Trust</b>                       |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                            |                |                          |                                   | 4,574 % fällig am 25.12.2036                                          | 772            | 351                      | 0,02                              |
| 5,334 % fällig am 25.03.2037                               | \$ 2.863       | 2.360                    | 0,13                              | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                                                     |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.12.2046                                          | 168            | 71                       | 0,00                              |
| <b>Primrose Residential DAC</b>                            |                |                          |                                   | <b>Asset-Backed European Securitisation Transaction</b>                            |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.09.2036                                          | 665            | 196                      | 0,01                              |
| 3,399 % fällig am 24.10.2061                               | € 3.130        | 3.132                    | 0,17                              | <b>Twenty-One BV</b>                                                               |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.12.2046                                          | 462            | 195                      | 0,01                              |
| <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>              |                |                          |                                   | 2,576 % fällig am 21.09.2031                                                       | € 2.121        | 2.123                    | 0,11                              | 4,834 % fällig am 25.11.2036                                          | 174            | 69                       | 0,00                              |
| 4,854 % fällig am 25.06.2037                               | \$ 40          | 30                       | 0,00                              | <b>Auto ABS Italian Stella Loans SRL</b>                                           |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.12.2046                                          | 84             | 35                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                               | 47             | 33                       | 0,00                              | 2,659 % fällig am 29.12.2036                                                       | 7.550          | 7.570                    | 0,40                              | <b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037                               | 39             | 28                       | 0,00                              | <b>Auto ABS Spanish Loans</b>                                                      |                |                          |                                   | 6,384 % fällig am 25.03.2035                                          | 1.000          | 796                      | 0,04                              |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037                               | 102            | 72                       | 0,00                              | 2,779 % fällig am 28.09.2038                                                       | 15.787         | 15.835                   | 0,85                              | <b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Residential Asset Securitization Trust</b>              |                |                          |                                   | <b>Auto1 Car Funding SARL</b>                                                      |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.12.2036                                          | 189            | 40                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036                               | 322            | 105                      | 0,01                              | 2,592 % fällig am 15.12.2033                                                       | 4.117          | 4.124                    | 0,22                              | 4,774 % fällig am 25.12.2036                                          | 907            | 185                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                               | 146            | 47                       | 0,00                              | <b>BBVA Consumer Auto</b>                                                          |                |                          |                                   | 4,809 % fällig am 25.05.2037                                          | 3.374          | 2.847                    | 0,15                              |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036                               | 122            | 36                       | 0,00                              | 2,723 % fällig am 19.03.2038                                                       | 16.006         | 16.066                   | 0,86                              | 4,874 % fällig am 25.12.2036                                          | 525            | 107                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037                               | 98             | 25                       | 0,00                              | <b>FACT S.A.</b>                                                                   |                |                          |                                   | <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.</b>                            |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037                               | 631            | 275                      | 0,02                              | 2,547 % fällig am 22.09.2031                                                       | 6.446          | 6.458                    | 0,35                              | 5,364 % fällig am 25.06.2035                                          | 4.968          | 4.003                    | 0,21                              |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036                               | 83             | 26                       | 0,00                              | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>                                               |                |                          |                                   | <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b> |                |                          |                                   | 2,747 % fällig am 20.12.2044                                                       | 9.200          | 9.219                    | 0,49                              | 4,714 % fällig am 25.06.2037                                          | 900            | 669                      | 0,04                              |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036                               | 40             | 28                       | 0,00                              | 3,086 % fällig am 22.09.2043                                                       | 7.262          | 7.309                    | 0,39                              | 6,337 % fällig am 25.08.2036                                          | 1.897          | 955                      | 0,05                              |
| <b>RMAC PLC</b>                                            |                |                          |                                   | 4,936 % fällig am 22.09.2043                                                       | 1.342          | 1.372                    | 0,07                              | <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,437 % fällig am 15.02.2047                               | £ 7.413        | 8.685                    | 0,46                              | <b>Hill FL BV</b>                                                                  |                |                          |                                   | 4,534 % fällig am 25.11.2036                                          | 127            | 32                       | 0,00                              |
| <b>RMAC Securities PLC</b>                                 |                |                          |                                   | 2,631 % fällig am 18.10.2032                                                       | 4.800          | 4.807                    | 0,26                              | 4,734 % fällig am 25.08.2036                                          | 218            | 68                       | 0,00                              |
| 2,224 % fällig am 12.06.2044                               | € 2.774        | 2.673                    | 0,14                              | <b>Koromo Italy Compartment</b>                                                    |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.06.2036                                          | 120            | 36                       | 0,00                              |
| 2,384 % fällig am 12.06.2044                               | 280            | 270                      | 0,01                              | 2,614 % fällig am 26.02.2032                                                       | 7.709          | 7.726                    | 0,41                              | 4,914 % fällig am 25.08.2036                                          | 786            | 245                      | 0,01                              |
| 4,528 % fällig am 12.06.2044                               | £ 292          | 333                      | 0,02                              | <b>Red &amp; Black Auto Italy SRL</b>                                              |                |                          |                                   | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,628 % fällig am 12.06.2044                               | 2.909          | 3.317                    | 0,18                              | 2,739 % fällig am 28.07.2036                                                       | 12.077         | 12.121                   | 0,65                              | 4,400 % fällig am 25.11.2037                                          | 1.981          | 528                      | 0,03                              |
| <b>Shamrock Residential DAC</b>                            |                |                          |                                   |                                                                                    |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.04.2047                                          | 1.407          | 476                      | 0,03                              |
| 2,899 % fällig am 24.06.2071                               | € 11.768       | 11.772                   | 0,63                              | <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>                                                         |                |                          |                                   | <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>Southern Pacific Securities PLC</b>                     |                |                          |                                   | <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   | 4,544 % fällig am 25.02.2037                                          | 906            | 245                      | 0,01                              |
| 2,489 % fällig am 10.03.2044                               | 1.305          | 1.296                    | 0,07                              | 4,654 % fällig am 25.10.2036                                                       | \$ 1.731       | 580                      | 0,03                              | 4,564 % fällig am 25.01.2037                                          | 90             | 35                       | 0,00                              |
| <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                       |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.12.2036                                                       | 395            | 84                       | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.10.2036                                          | 100            | 37                       | 0,00                              |
| 5,139 % fällig am 28.06.2050                               | £ 9.273        | 10.836                   | 0,58                              | 4,714 % fällig am 25.07.2036                                                       | 91             | 63                       | 0,00                              | 4,614 % fällig am 25.03.2037                                          | 300            | 109                      | 0,01                              |
| 5,214 % fällig am 25.06.2049                               | 8.302          | 9.703                    | 0,52                              | 4,734 % fällig am 25.01.2037                                                       | 7.006          | 3.266                    | 0,18                              | 4,634 % fällig am 25.09.2036                                          | 53             | 15                       | 0,00                              |
| 5,989 % fällig am 20.06.2060                               | 11.900         | 13.905                   | 0,74                              | 4,994 % fällig am 25.02.2037                                                       | 2.569          | 901                      | 0,05                              | 4,634 % fällig am 25.02.2037                                          | 100            | 37                       | 0,00                              |
| <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>      |                |                          |                                   | 5,409 % fällig am 25.11.2033                                                       | 566            | 485                      | 0,03                              | 4,684 % fällig am 25.03.2037                                          | 300            | 109                      | 0,01                              |
| 4,665 % fällig am 25.02.2036                               | \$ 46          | 29                       | 0,00                              | <b>Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates</b>      |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.09.2036                                          | 10.508         | 3.077                    | 0,17                              |
| 5,673 % fällig am 25.10.2035                               | 81             | 65                       | 0,00                              | 6,384 % fällig am 25.06.2034                                                       | 1.196          | 989                      | 0,05                              | 5,334 % fällig am 25.08.2034                                          | 422            | 370                      | 0,02                              |
| <b>SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>        |                |                          |                                   | <b>Ameriqwest Mortgage Securities Trust</b>                                        |                |                          |                                   | 5,409 % fällig am 25.02.2035                                          | 2.379          | 1.654                    | 0,09                              |
| 6,615 % fällig am 25.02.2037                               | 45             | 36                       | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.10.2036                                                       | 3.010          | 754                      | 0,04                              | <b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>TBW Mortgage-Backed Trust</b>                           |                |                          |                                   | <b>Ameriqwest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 4,604 % fällig am 25.04.2037                                          | 233            | 103                      | 0,01                              |
| 6,300 % fällig am 25.03.2037                               | 8.038          | 1.393                    | 0,07                              | 3,620 % fällig am 25.04.2034                                                       | 1.412          | 1.183                    | 0,06                              | <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                     |                |                          |                                   | 5,454 % fällig am 25.01.2036                                                       | 4.000          | 2.986                    | 0,16                              | 4,964 % fällig am 25.04.2037                                          | 2.170          | 650                      | 0,04                              |
| 5,474 % fällig am 20.04.2051                               | £ 2.106        | 2.462                    | 0,13                              |                                                                                    |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.04.2037                                          | 2.170          | 650                      | 0,04                              |
| 5,637 % fällig am 20.02.2054                               | 9.069          | 10.618                   | 0,57                              |                                                                                    |                |                          |                                   | 6,465 % fällig am 25.09.2046                                          | 275            | 77                       | 0,00                              |

|                                                                    | PARI   | MARKT-         | % DES                    |                                              | PARI      | MARKT-         | % DES |                                                    | PARI       | MARKT-         | % DES |
|--------------------------------------------------------------------|--------|----------------|--------------------------|----------------------------------------------|-----------|----------------|-------|----------------------------------------------------|------------|----------------|-------|
| BESCHREIBUNG                                                       | (000S) | WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | (000S)    | WERT<br>(000S) | GENS  | BESCHREIBUNG                                       | (000S)     | WERT<br>(000S) | GENS  |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust               |        |                |                          | BNPP IP Euro CLO DAC                         |           |                |       | Toro European CLO DAC                              |            |                |       |
| 6,532 % fällig am 25.10.2036                                       | \$ 148 | € 26           | 0,00                     | 3,069 % fällig am 15.10.2030                 | € 389     | € 389          | 0,02  | 3,185 % fällig am 12.01.2032                       | € 8.755    | € 8.748        | 0,47  |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                                    |        |                |                          | Cairn CLO DAC                                |           |                |       | 3,269 % fällig am 15.07.2034                       | 3.800      | 3.799          | 0,20  |
| 4,734 % fällig am 25.06.2036                                       | 75     | 47             | 0,00                     | 2,856 % fällig am 31.01.2030                 | 6.789     | 6.772          | 0,36  | Trinitas Euro CLO DAC                              |            |                |       |
| 4,734 % fällig am 25.09.2036                                       | 132    | 44             | 0,00                     | 3,269 % fällig am 15.07.2034                 | 3.000     | 2.995          | 0,16  | 3,166 % fällig am 20.10.2032                       | 172        | 172            | 0,01  |
| 4,754 % fällig am 25.05.2036                                       | 132    | 111            | 0,01                     | Carlyle Euro CLO DAC                         |           |                |       | Voya Euro CLO DAC                                  |            |                |       |
| 4,754 % fällig am 25.10.2036                                       | 1.021  | 395            | 0,02                     | 2,200 % fällig am 15.08.2032                 | 1.000     | 955            | 0,05  | 3,249 % fällig am 15.10.2034                       | 7.300      | 7.294          | 0,39  |
| Option One Mortgage Loan Trust                                     |        |                |                          | Contego CLO BV                               |           |                |       |                                                    |            |                |       |
| 4,534 % fällig am 25.07.2036                                       | 9.658  | 3.571          | 0,19                     | 3,049 % fällig am 15.10.2030                 | 223       | 224            | 0,01  |                                                    | 251.037    | 13,41          |       |
| 4,614 % fällig am 25.04.2037                                       | 12.235 | 5.910          | 0,32                     | Contego CLO DAC                              |           |                |       | SICHERHEITEN FÜR WHOLE LOANS                       |            |                |       |
| 4,764 % fällig am 25.04.2037                                       | 639    | 266            | 0,01                     | 2,823 % fällig am 23.01.2030                 | 5.518     | 5.509          | 0,30  | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust         |            |                |       |
| 4,874 % fällig am 25.01.2037                                       | 225    | 113            | 0,01                     | Cumulus Static CLO DAC                       |           |                |       | 5,348 % fällig am 25.10.2036                       | \$ 30      | 12             | 0,00  |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |        |                |                          | 3,343 % fällig am 15.11.2033                 | 7.194     | 7.212          | 0,39  | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                |            |                |       |
| 5,169 % fällig am 25.08.2035                                       | 1.425  | 1.209          | 0,07                     | CVC Cordatus Loan Fund DAC                   |           |                |       | 6,851 % fällig am 25.05.2036                       | 119        | 37             | 0,00  |
| Renaissance Home Equity Loan Trust                                 |        |                |                          | 2,866 % fällig am 21.07.2030                 | 4.258     | 4.266          | 0,23  | First Franklin Mortgage Loan Trust                 |            |                |       |
| 5,612 % fällig am 25.04.2037                                       | 10.873 | 2.150          | 0,12                     | 2,904 % fällig am 17.06.2032                 | 1.022     | 1.021          | 0,06  | 4,754 % fällig am 25.10.2036                       | 7.072      | 3.941          | 0,21  |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037                                       | 3.494  | 767            | 0,04                     | 2,939 % fällig am 26.08.2032                 | 436       | 435            | 0,02  | Lehman XS Trust                                    |            |                |       |
| 6,234 % fällig am 25.09.2037                                       | 121    | 82             | 0,01                     | 4,790 % fällig am 23.10.2034                 | 1.000     | 1.005          | 0,05  | 4,604 % fällig am 25.02.2037                       | 825        | 533            | 0,03  |
| 7,238 % fällig am 25.09.2037                                       | 857    | 289            | 0,02                     | CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC       |           |                |       | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust     |            |                |       |
| Residential Asset Mortgage Products Trust                          |        |                |                          | 3,683 % fällig am 15.08.2033                 | 1.000     | 1.002          | 0,05  | 4,934 % fällig am 25.03.2036                       | 2.813      | 1.498          | 0,08  |
| 5,379 % fällig am 25.10.2035                                       | 1.500  | 1.116          | 0,06                     | Dryden Euro CLO DAC                          |           |                |       | 4,934 % fällig am 25.05.2036                       | 595        | 261            | 0,02  |
| Residential Asset Securities Corp. Trust                           |        |                |                          | 2,893 % fällig am 15.05.2032                 | 425       | 425            | 0,02  | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust |            |                |       |
| 4,694 % fällig am 25.11.2036                                       | 559    | 442            | 0,02                     | 3,003 % fällig am 15.05.2034                 | 216       | 216            | 0,01  | 4,734 % fällig am 25.09.2037                       | 346        | 202            | 0,01  |
| 5,394 % fällig am 25.01.2036                                       | 3.300  | 2.670          | 0,14                     | Euro-Galaxy CLO DAC                          |           |                |       |                                                    | 6.484      | 0,35           |       |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust                     |        |                |                          | 3,093 % fällig am 15.02.2034                 | 4.999     | 4.985          | 0,27  |                                                    | 443.882    | 23,71          |       |
| 4,614 % fällig am 25.07.2036                                       | 182    | 51             | 0,00                     | Fair Oaks Loan Funding DAC                   |           |                |       | STAATSEMISSIONEN                                   |            |                |       |
| 4,754 % fällig am 25.07.2036                                       | 178    | 50             | 0,00                     | 3,279 % fällig am 15.10.2034                 | 4.000     | 3.994          | 0,21  | Bank Gospodarstwa Krajowego                        |            |                |       |
| 4,914 % fällig am 25.07.2036                                       | 152    | 43             | 0,00                     | FCT Ponant                                   |           |                |       | 3,250 % fällig am 18.03.2030                       | € 5.700    | 5.782          | 0,31  |
| Soundview Home Loan Trust                                          |        |                |                          | 2,564 % fällig am 27.09.2038                 | 12.069    | 12.086         | 0,65  | 3,875 % fällig am 13.03.2035                       | 2.200      | 2.202          | 0,12  |
| 4,107 % fällig am 25.04.2035                                       | 985    | 839            | 0,05                     | FTA Consumo Santander                        |           |                |       | Bulgaria Government International Bond             |            |                |       |
| 4,654 % fällig am 25.02.2037                                       | 250    | 57             | 0,00                     | 3,563 % fällig am 20.07.2038                 | 863       | 867            | 0,05  | 3,500 % fällig am 07.05.2034                       | 4.500      | 4.552          | 0,24  |
| 4,714 % fällig am 25.06.2037                                       | 122    | 68             | 0,00                     | 3,913 % fällig am 20.07.2038                 | 863       | 867            | 0,05  | 4,125 % fällig am 07.05.2038                       | 4.500      | 4.588          | 0,24  |
| 4,794 % fällig am 25.02.2037                                       | 370    | 84             | 0,01                     | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos |           |                |       | Magyar Export-Import Bank                          |            |                |       |
| 4,884 % fällig am 25.05.2036                                       | 9.017  | 6.716          | 0,36                     | 2,949 % fällig am 25.02.2034                 | 6.956     | 6.981          | 0,37  | 4,500 % fällig am 27.11.2031                       | 2.000      | 2.034          | 0,11  |
| 5,109 % fällig am 25.06.2035                                       | 500    | 423            | 0,02                     | Griffith Park CLO DAC                        |           |                |       | Mexico Government International Bond               |            |                |       |
| 5,434 % fällig am 25.09.2037                                       | 7.069  | 4.374          | 0,23                     | 2,795 % fällig am 21.11.2031                 | 1.450     | 1.447          | 0,08  | 2,750 % fällig am                                  |            |                |       |
| Structured Asset Investment Loan Trust                             |        |                |                          | Harvest CLO DAC                              |           |                |       | 27.11.2031 (g)                                     | MXN 38.169 | 1.525          | 0,08  |
| 4,584 % fällig am 25.09.2036                                       | 13     | 11             | 0,00                     | 2,919 % fällig am 15.10.2031                 | 799       | 799            | 0,04  | 4,000 % fällig am                                  |            |                |       |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust              |        |                |                          | 2,997 % fällig am 18.11.2030                 | 944       | 945            | 0,05  | 30.11.2028 (g)                                     | 80.333     | 3.552          | 0,19  |
| 6,184 % fällig am 25.04.2031                                       | 1.879  | 1.624          | 0,09                     | 3,186 % fällig am 20.10.2032                 | 3.419     | 3.419          | 0,18  | 4,000 % fällig am                                  |            |                |       |
|                                                                    |        | 91.167         | 4,87                     | Hayfin Emerald CLO DAC                       |           |                |       | 24.08.2034 (g)                                     | 102.520    | 4.301          | 0,23  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,319 % fällig am 15.10.2034                 | 3.000     | 2.992          | 0,16  | 7,750 % fällig am 29.05.2031                       | 5.000      | 215            | 0,01  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,586 % fällig am 18.07.2038                 | 400       | 401            | 0,02  | 8,500 % fällig am 01.03.2029                       | 30.200     | 1.360          | 0,07  |
|                                                                    |        |                |                          | Holland Park CLO DAC                         |           |                |       | 8,500 % fällig am 31.05.2029                       | 19.400     | 873            | 0,05  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,789 % fällig am 14.11.2032                 | 1.000     | 1.002          | 0,05  | Peru Government International Bond                 |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | Indigo Credit Management DAC                 |           |                |       | 5,400 % fällig am 12.08.2034                       | PEN 2.200  | 500            | 0,03  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,479 % fällig am 15.07.2038                 | 10.800    | 10.820         | 0,58  | 6,150 % fällig am 12.08.2032                       | 15.100     | 3.750          | 0,20  |
|                                                                    |        |                |                          | Invesco Euro CLO DAC                         |           |                |       | 6,900 % fällig am 12.08.2037                       | 3.170      | 776            | 0,04  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,296 % fällig am 30.10.2038                 | 4.000     | 3.992          | 0,21  | 6,950 % fällig am 12.08.2031                       | 12.402     | 3.237          | 0,17  |
|                                                                    |        |                |                          | Lyra Music Assets Delaware LP                |           |                |       | 7,300 % fällig am 12.08.2033                       | 9.500      | 2.489          | 0,13  |
|                                                                    |        |                |                          | 5,760 % fällig am 22.12.2064                 | \$ 17.774 | 15.227         | 0,82  | 7,600 % fällig am 12.08.2039                       | 9.300      | 2.382          | 0,13  |
|                                                                    |        |                |                          | Marzio Finance SRL                           |           |                |       | Romania Government International Bond              |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | 2,649 % fällig am 30.06.2050                 | € 9.690   | 9.705          | 0,52  | 5,125 % fällig am 24.09.2031                       | € 9.200    | 9.093          | 0,49  |
|                                                                    |        |                |                          | 2,759 % fällig am 28.09.2049                 | 12.166    | 12.214         | 0,65  | 5,250 % fällig am                                  |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | Oak Hill European Credit Partners DAC        |           |                |       | 30.05.2032 (j)                                     | 14.400     | 14.191         | 0,76  |
|                                                                    |        |                |                          | 2,966 % fällig am 20.01.2032                 | 968       | 967            | 0,05  | 5,375 % fällig am 22.03.2031                       | 870        | 874            | 0,05  |
|                                                                    |        |                |                          | Palmer Square European Loan Funding DAC      |           |                |       | 5,625 % fällig am 22.02.2036                       | 390        | 372            | 0,02  |
|                                                                    |        |                |                          | 2,999 % fällig am 15.10.2031                 | 1.936     | 1.932          | 0,10  | Saudi Arabia Government International Bond         |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | 3,133 % fällig am 15.05.2034                 | 13.174    | 13.165         | 0,70  | 3,750 % fällig am 05.03.2037                       | 1.200      | 1.170          | 0,06  |
|                                                                    |        |                |                          | 4,033 % fällig am 15.05.2034                 | 8.100     | 8.117          | 0,43  | Serbia Government International Bond               |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | Purple Finance CLO DAC                       |           |                |       | 3,125 % fällig am 15.05.2027                       | 11.030     | 10.991         | 0,59  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,236 % fällig am 20.04.2032                 | 899       | 901            | 0,05  | South Africa Government International Bond         |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | RRE Loan Management DAC                      |           |                |       | 7,000 % fällig am 28.02.2031                       | ZAR 53.400 | 2.355          | 0,13  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,149 % fällig am 15.04.2035                 | 2.745     | 2.746          | 0,15  | 8,875 % fällig am 28.02.2035                       | 56.600     | 2.534          | 0,13  |
|                                                                    |        |                |                          | Sculptor European CLO DAC                    |           |                |       | Turkey Government International Bond               |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | 3,329 % fällig am 15.10.2034                 | 2.878     | 2.872          | 0,15  | 47,469 % fällig am 06.09.2028                      | TRY 7.900  | 163            | 0,01  |
|                                                                    |        |                |                          | Segovia European CLO DAC                     |           |                |       | 49,053 % fällig am 20.05.2026                      | 900        | 19             | 0,00  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,116 % fällig am 20.07.2032                 | 1.815     | 1.817          | 0,10  | 49,053 % fällig am 19.08.2026                      | 500        | 11             | 0,00  |
|                                                                    |        |                |                          | SLM Student Loan Trust                       |           |                |       | 49,053 % fällig am 17.05.2028                      | 123.000    | 2.554          | 0,14  |
|                                                                    |        |                |                          | 2,558 % fällig am 25.10.2039                 | 755       | 704            | 0,04  | Ukraine Government International Bond              |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          | 5,220 % fällig am 25.03.2026                 | \$ 10.056 | 8.513          | 0,46  | 0,000 % fällig am 01.02.2030                       | \$ 171     | 70             | 0,00  |
|                                                                    |        |                |                          | St. Paul's CLO DAC                           |           |                |       | 0,000 % fällig am 01.02.2034                       | 638        | 211            | 0,01  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,023 % fällig am 17.07.2030                 | € 695     | 694            | 0,04  | 0,000 % fällig am 01.02.2035                       | 539        | 218            | 0,01  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,138 % fällig am 25.10.2035                 | 7.300     | 7.281          | 0,39  | 0,000 % fällig am 01.02.2036                       | 449        | 181            | 0,01  |
|                                                                    |        |                |                          | Tikehau CLO DAC                              |           |                |       | 1,750 % fällig am 01.02.2029                       | 1.875      | 990            | 0,05  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,259 % fällig am 15.01.2035                 | 10.000    | 9.983          | 0,53  | 1,750 % fällig am 01.02.2034                       | 1.250      | 554            | 0,03  |
|                                                                    |        |                |                          | 3,929 % fällig am 15.10.2031                 | 1.000     | 1.003          | 0,05  |                                                    |            |                |       |
|                                                                    |        |                |                          |                                              |           |                |       |                                                    | 90.669     | 4,84           |       |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

|                                          |           | % DES                    |                          |                                             |                                     | % DES                    |                          |                                                   |                    |                          |                          | % DES                                        |                                              |                          |                          |  |
|------------------------------------------|-----------|--------------------------|--------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|--------------------------|---------------------------------------------------|--------------------|--------------------------|--------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--|
| BESCHREIBUNG                             | AKTIEN    | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | AKTIEN                              | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S)     | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S)                               | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |  |
| STAMMAKTIE                               |           |                          |                          | 2,065 % fällig am 14.08.2025 (e)(f) €       |                                     |                          |                          | 12.010 € 11.982 0,64                              |                    |                          |                          | NIGERIA TREASURY BILLS                       |                                              |                          |                          |  |
| FINANZWERTE                              |           |                          |                          | 2,097 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)         |                                     |                          |                          | 4.920 4.909 0,26                                  |                    |                          |                          | 30,612 % fällig am                           |                                              |                          |                          |  |
| Corestate Capital Holding S.A.<br>(d)(f) | 1.265.902 | €                        | 0                        | 0,00                                        | 2,122 % fällig am 10.07.2025 (e)(f) |                          |                          |                                                   | 6.360 6.357 0,34   |                          |                          |                                              | 29.06.2026 (e)(f) NGN 3.414.539 € 1.527 0,08 |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          |                                             | 2,146 % fällig am 10.07.2025 (e)(f) |                          |                          |                                                   | 10.270 10.266 0,55 |                          |                          |                                              | 30,864 % fällig am                           |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          |                                             | 2,153 % fällig am 10.07.2025 (e)(f) |                          |                          |                                                   | 7.490 7.487 0,40   |                          |                          |                                              | 26.06.2026 (e)(f) 3.010.693 1.349 0,07       |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          |                                             | 2,393 % fällig am 10.07.2025 (e)(f) |                          |                          |                                                   | 3.270 3.269 0,17   |                          |                          |                                              | 33,126 % fällig am                           |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          |                                             | 2,407 % fällig am 10.07.2025 (e)(f) |                          |                          |                                                   | 20.830 20.821 1,11 |                          |                          |                                              | 12.06.2026 (e)(f) 2.084.200 940 0,05         |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          | 2,408 % fällig am 10.07.2025 (e)(f)         |                                     |                          |                          | 5.480 5.478 0,29                                  |                    |                          |                          | 33,156 % fällig am                           |                                              |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          | 2,419 % fällig am 10.07.2025 (e)(f)         |                                     |                          |                          | 4.610 4.608 0,25                                  |                    |                          |                          | 2.086.200 942 0,05                           |                                              |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          |                                             |                                     |                          |                          | 187.344 10,00                                     |                    |                          |                          | 4.758 0,25                                   |                                              |                          |                          |  |
|                                          |           |                          |                          |                                             |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          | Summe kurzfristige Instrumente 229.111 12,23 |                                              |                          |                          |  |
| KURZFRISTIGE INSTRUMENTE                 |           |                          |                          | EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREASURY BILLS |                                     |                          |                          | Summe Übertragbare Wertpapiere € 2.246.962 119,96 |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| BELGIUM TREASURY BILLS                   |           |                          |                          | 2,080 % fällig am 07.08.2025 (e)(f)         |                                     |                          |                          | 2.960 2.954 0,16                                  |                    |                          |                          | AKTIEN                                       |                                              |                          |                          |  |
| 1,963 % fällig am 16.10.2025 (e)(f) €    |           |                          |                          | 5.940 5.906 0,32                            |                                     |                          |                          | 21.500 21.459 1,14                                |                    |                          |                          | INVESTMENTFONDS                              |                                              |                          |                          |  |
| 1,964 % fällig am 16.10.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 2.590 2.575 0,14                            |                                     |                          |                          | 6.120 6.108 0,33                                  |                    |                          |                          | ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN            |                                              |                          |                          |  |
| 1,967 % fällig am 16.10.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 1.750 1.740 0,09                            |                                     |                          |                          | 3.670 3.663 0,20                                  |                    |                          |                          | PIMCO Funds: Global                          |                                              |                          |                          |  |
| 1,968 % fällig am 11.09.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 2.340 2.331 0,12                            |                                     |                          |                          | 2.730 2.725 0,14                                  |                    |                          |                          | Investors Series plc -                       |                                              |                          |                          |  |
| 1,970 % fällig am 16.10.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 2.960 2.943 0,16                            |                                     |                          |                          | 33.955 1,81                                       |                    |                          |                          | PIMCO European High                          |                                              |                          |                          |  |
| 1,975 % fällig am 16.10.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 590 587 0,03                                |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          | Yield Bond Fund (h) 1.494.064 18.900 1,01    |                                              |                          |                          |  |
| 1,978 % fällig am 11.09.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 9.680 9.643 0,52                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          | BÖRSENGEHADELTE FONDS                        |                                              |                          |                          |  |
| 1,983 % fällig am 11.09.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 2.790 2.779 0,15                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          | PIMCO ETFs plc - PIMCO                       |                                              |                          |                          |  |
| 1,987 % fällig am 11.09.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 3.100 3.088 0,17                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          | Euro Short Maturity                          |                                              |                          |                          |  |
| 1,992 % fällig am 11.09.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 5.140 5.121 0,27                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          | UCITS ETF (h) 1.562.400 163.552 8,73         |                                              |                          |                          |  |
| 2,029 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 5.910 5.896 0,31                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          | Summe Investmentfonds € 182.452 9,74         |                                              |                          |                          |  |
| 2,030 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 7.850 7.832 0,42                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| 2,031 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 7.460 7.443 0,40                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| 2,034 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 3.350 3.342 0,18                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| 2,035 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 700 698 0,04                                |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| 2,043 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 17.670 17.629 0,94                          |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| 2,046 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 1.380 1.377 0,07                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| 2,048 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 7.410 7.393 0,39                            |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |
| 2,052 % fällig am 14.08.2025 (e)(f)      |           |                          |                          | 23.900 23.844 1,27                          |                                     |                          |                          |                                                   |                    |                          |                          |                                              |                                              |                          |                          |  |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                     | 1,970 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | € 186.100     | European Union 3.250 % fällig<br>am 04.02.2050 | € (189.544)                | € 186.100                      | € 186.100                                                      | 9,93                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                | € (189.544)                | € 186.100                      | € 186.100                                                      | 9,93                         |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month SOFR June Futures                            | Short | 09.2025     | 154                  | € 271                                           | 0,02                    |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025     | 113                  | 55                                              | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                          | Long  | 09.2025     | 119                  | (122)                                           | (0,01)                  |
| Euro-Schatz September Futures                        | Short | 09.2025     | 4.253                | 658                                             | 0,04                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 3.029                | 2.990                                           | 0,16                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 2.954                | 4.614                                           | 0,25                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Long  | 09.2025     | 662                  | 1.296                                           | 0,07                    |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025     | 374                  | (1.241)                                         | (0,07)                  |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 952                  | 3.361                                           | 0,18                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025     | 731                  | 1.833                                           | 0,10                    |
|                                                      |       |             |                      | € 13.715                                        | 0,74                    |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 47                      | € (14)  | € (1)     | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000       | 25.07.2025    | 79                      | (27)    | (2)       | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500       | 25.07.2025    | 56                      | (16)    | (3)       | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250       | 25.07.2025    | 48                      | (10)    | (5)       | 0,00                         |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000       | 25.07.2025    | 47                      | (14)    | (30)      | 0,00                         |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500       | 25.07.2025    | 135                     | (44)    | (61)      | (0,01)                       |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750       | 25.07.2025    | 48                      | (13)    | (18)      | 0,00                         |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250     | 25.07.2025    | 22                      | (4)     | (4)       | 0,00                         |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500       | 25.07.2025    | 22                      | (3)     | (3)       | 0,00                         |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | 129,000       | 25.07.2025    | 12                      | (5)     | (4)       | 0,00                         |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500       | 25.07.2025    | 12                      | (6)     | (2)       | 0,00                         |
|                                                                |               |               |                         | € (156) | € (133)   | (0,01)                       |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                         |         | € 13.582  | 0,73                         |

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

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

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

| Referenzeinheit       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| AT&T, Inc.            | 1,000 %                        | 20.06.2026       | \$ 2.400                  | € (24)                                          | 0,00                    |
| AT&T, Inc.            | 1,000                          | 20.06.2028       | 1.100                     | 21                                              | 0,00                    |
| Barclays Bank PLC     | 1,000                          | 20.12.2025       | € 12.600                  | (21)                                            | 0,00                    |
| BNP Paribas S.A.      | 1,000                          | 20.12.2025       | 6.900                     | (13)                                            | 0,00                    |
| Citigroup, Inc.       | 1,000                          | 20.12.2025       | \$ 8.600                  | (25)                                            | 0,00                    |
| Deutsche Bank AG      | 1,000                          | 20.12.2029       | € 2.600                   | 24                                              | 0,00                    |
| Ford Motor Co.        | 5,000                          | 20.12.2028       | \$ 3.100                  | (112)                                           | (0,01)                  |
| Électricité de France | 1,000                          | 20.06.2030       | € 7.700                   | (14)                                            | 0,00                    |
|                       |                                |                  |                           | € (164)                                         | (0,01)                  |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-39 5-Year Index             | 5,000 %                        | 20.12.2027       | \$ 679                    | € 46                                            | 0,00                    |
| CDX.HY-43 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2029       | 5.800                     | (10)                                            | 0,00                    |
| CDX.HY-44 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2030       | 27.600                    | 543                                             | 0,03                    |
| CDX.IG-41 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2028       | 200                       | 1                                               | 0,00                    |
| CDX.IG-43 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2029       | 3.100                     | (3)                                             | 0,00                    |
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2030       | 24.800                    | 80                                              | 0,00                    |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | € 11.900                  | 16                                              | 0,00                    |
|                                    |                                |                  |                           | € 673                                           | 0,03                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                  | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %            | 19.03.2030       | £ 57.900    | € 12                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,700              | 28.03.2034       | 1.000       | 24                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400              | 15.06.2032       | ¥ 5.164.600 | 1.283                                           | 0,07                    |
| Erhalt                                   | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,700              | 18.09.2029       | 5.070.000   | 73                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000              | 18.09.2034       | 2.610.000   | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,868              | 05.05.2032       | \$ 15.100   | (1.241)                                         | (0,07)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,040              | 25.05.2032       | 7.800       | (558)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,068              | 11.05.2032       | 15.400      | (1.100)                                         | (0,06)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,153              | 18.05.2032       | 15.400      | (1.010)                                         | (0,05)                  |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,750              | 21.06.2053       | 39.900      | 5.704                                           | 0,31                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 19.03.2030       | 15.500      | (265)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2033       | 3.085       | (68)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,231              | 18.09.2034       | 4.000       | 159                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,232              | 10.09.2034       | 2.250       | 93                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,240              | 16.09.2034       | 1.300       | 52                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,248              | 18.09.2034       | 4.000       | 155                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2030       | 135.900     | 646                                             | 0,04                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 19.03.2032       | 17.370      | (319)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2032       | 3.090       | 9                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2035       | 1.940       | 16                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 19.03.2055       | 34.200      | (1.244)                                         | (0,07)                  |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2055       | 38.100      | (146)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,278              | 16.09.2034       | 5.200       | 194                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,300              | 06.03.2033       | 2.600       | (39)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,300              | 14.06.2033       | 9.700       | (122)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,370              | 12.07.2053       | 2.800       | (243)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,375              | 15.10.2034       | 4.200       | (93)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,385              | 17.10.2034       | 2.700       | (58)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,395              | 17.10.2034       | 5.700       | (118)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,400              | 17.10.2034       | 2.300       | (47)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,420              | 24.05.2033       | 7.600       | (47)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,425              | 01.03.2033       | 40.200      | (284)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,446              | 23.10.2034       | 2.600       | (45)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,450              | 07.03.2033       | 5.000       | (29)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,450              | 11.10.2034       | 4.200       | (70)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,463              | 23.10.2034       | 4.600       | (74)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,465              | 30.10.2034       | 9.300       | (144)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,481              | 29.10.2034       | 4.600       | (66)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,495              | 30.10.2034       | 4.400       | (59)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 22.06.2030       | 12.200      | 77                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.12.2030       | 194.100     | (1.906)                                         | (0,10)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 21.06.2033       | 8.100       | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.12.2033       | 212.800     | 2.161                                           | 0,12                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500              | 20.06.2054       | 27.000      | (305)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,515              | 06.11.2034       | 8.400       | (96)                                            | (0,01)                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex       | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,525 %         | 02.03.2030       | \$ 1.800   | € 8                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,532           | 20.08.2034       | 4.000      | 75                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,550           | 21.08.2034       | 30.400     | 531                                             | 0,03                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,555           | 05.03.2054       | 1.000      | (49)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,569           | 14.08.2034       | 4.400      | 71                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,594           | 09.01.2034       | 2.300      | 10                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,595           | 19.08.2034       | 4.400      | 63                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,600           | 17.01.2034       | 2.200      | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,613           | 22.08.2034       | 4.000      | 51                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620           | 31.01.2034       | 1.200      | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,645           | 07.08.2034       | 4.000      | 43                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,648           | 08.01.2034       | 2.300      | 11                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650           | 10.07.2033       | 4.600      | (10)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650           | 05.03.2034       | 2.400      | 9                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,655           | 24.01.2034       | 1.300      | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,665           | 24.01.2034       | 2.300      | 10                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,670           | 08.01.2034       | 2.500      | 9                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,679           | 13.08.2034       | 4.000      | 33                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,684           | 03.01.2034       | 1.200      | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,685           | 24.01.2034       | 2.300      | 13                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700           | 05.03.2034       | 1.200      | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,710           | 05.03.2034       | 2.400      | 18                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,715           | 07.08.2034       | 4.980      | 32                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,725           | 07.02.2034       | 1.100      | 10                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,730           | 03.08.2033       | 1.300      | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735           | 07.08.2033       | 1.500      | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735           | 23.01.2034       | 1.200      | 11                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,738           | 23.01.2034       | 700        | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2026       | 329.400    | 3.139                                           | 0,17                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2029       | 16.000     | 97                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2029       | 282.740    | (408)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2029       | 30.200     | (442)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 15.03.2030       | 46.000     | 656                                             | 0,04                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2031       | 3.300      | (104)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 12.07.2033       | 4.000      | 19                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 02.01.2034       | 1.200      | (2)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2034       | 240        | 8                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2034       | 120        | 0                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 07.05.2035       | 5.400      | 46                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,760           | 23.08.2033       | 4.700      | 35                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,783           | 07.02.2034       | 1.000      | 13                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,795           | 06.08.2034       | 4.000      | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800           | 10.03.2028       | 5.000      | 45                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800           | 05.09.2028       | 8.500      | 98                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800           | 22.08.2030       | 1.200      | 14                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800           | 30.08.2033       | 2.300      | 24                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,810           | 02.01.2034       | 1.200      | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,830           | 12.10.2053       | 700        | (9)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,840           | 08.01.2035       | 2.500      | 31                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,842           | 26.12.2033       | 1.200      | (10)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,850           | 08.01.2035       | 1.200      | 16                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,854           | 29.12.2033       | 2.200      | (20)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,860           | 21.02.2034       | 4.600      | 82                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,865           | 20.11.2034       | 4.300      | 66                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870           | 05.03.2035       | 1.300      | (12)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870           | 17.10.2053       | 700        | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,874           | 05.03.2035       | 2.700      | (25)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880           | 16.10.2053       | 700        | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,884           | 25.03.2035       | 3.200      | (35)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,885           | 12.07.2034       | 31.200     | (189)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,896           | 08.01.2035       | 5.200      | 87                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,899           | 11.03.2035       | 4.300      | (49)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 30.08.2033       | 4.700      | 79                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 10.04.2034       | 2.300      | 47                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 15.04.2034       | 1.200      | 24                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 08.01.2035       | 2.500      | 42                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,908           | 04.03.2035       | 2.600      | (30)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,933           | 06.01.2035       | 5.200      | 102                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,940           | 22.02.2029       | 6.800      | 115                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950           | 19.12.2033       | 2.400      | (37)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950           | 16.04.2034       | 2.500      | 58                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970           | 27.02.2029       | 2.300      | 41                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970           | 15.01.2035       | 2.400      | 53                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,994           | 02.07.2034       | 3.400      | (48)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,015           | 30.12.2034       | 4.200      | 108                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030           | 04.10.2033       | 4.500      | 119                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030           | 15.12.2033       | 2.200      | (45)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,060           | 02.07.2034       | 2.400      | (45)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,071           | 15.01.2035       | 4.000      | 118                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,078           | 29.04.2034       | 2.400      | 75                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,080           | 17.04.2034       | 2.300      | 73                                              | 0,00                    |

| Zahlung/<br>Erhalt variabler |                                     |                 |                  |            |                            | Nicht realisierte | % des  |
|------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|------------|----------------------------|-------------------|--------|
| Zinssatz                     | Variabler Zinssatzindex             | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Nettovermögens    |        |
| Erhalt                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,080 %         | 05.06.2034       | \$ 2.700   | € (68)                     |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,085           | 22.04.2034       | 2.300      | 75                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,090           | 30.04.2034       | 12.800     | 411                        |                   | 0,02   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,100           | 21.01.2035       | 2.100      | 66                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,105           | 24.04.2034       | 6.600      | 221                        |                   | 0,01   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,130           | 03.05.2034       | 2.300      | 80                         |                   | 0,01   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,150           | 12.10.2033       | 2.100      | 74                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,175           | 10.10.2033       | 2.100      | 77                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,200           | 18.10.2033       | 1.800      | 69                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,220           | 20.10.2033       | 2.200      | 87                         |                   | 0,01   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,230           | 23.10.2033       | 1.100      | 44                         |                   | 0,00   |
| Erhalt                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250           | 22.11.2033       | 2.200      | (76)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,255           | 23.10.2033       | 1.100      | 46                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,393           | 25.10.2033       | 1.100      | 56                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,435           | 01.11.2033       | 1.100      | 60                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,450           | 31.10.2033       | 1.300      | 72                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,450           | 01.11.2033       | 2.200      | 123                        |                   | 0,01   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 9,874           | 02.01.2026       | BRL 10.600 | (93)                       |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 9,899           | 02.01.2026       | 5.400      | (47)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 9,939           | 02.01.2026       | 9.200      | (78)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 9,998           | 04.01.2027       | 15.500     | (184)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,037          | 04.01.2027       | 4.200      | (49)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,041          | 04.01.2027       | 17.100     | (200)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,052          | 02.01.2026       | 21.000     | (171)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,072          | 04.01.2027       | 7.860      | (78)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,085          | 02.01.2026       | 20.900     | (169)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,090          | 04.01.2027       | 32.200     | (371)                      |                   | (0,02) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,098          | 04.01.2027       | 23.760     | (233)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,105          | 02.01.2026       | 20.700     | (167)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,138          | 04.01.2027       | 8.000      | (91)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,165          | 04.01.2027       | 12.050     | (115)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,170          | 04.01.2027       | 20.100     | (192)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,183          | 04.01.2027       | 36.110     | (343)                      |                   | (0,02) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,203          | 04.01.2027       | 28.140     | (265)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,210          | 04.01.2027       | 4.050      | (38)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,256          | 04.01.2027       | 28.110     | (260)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 10,328          | 04.01.2027       | 21.530     | (194)                      |                   | (0,01) |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 13,291          | 02.01.2029       | 25.100     | 34                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 13,354          | 02.01.2029       | 49.900     | 49                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927          | 04.01.2027       | 38.200     | (19)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 1-Year BRL-CDI                      | 14,009          | 04.01.2027       | 27.200     | (5)                        |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2025       | CAD 23.100 | 452                        |                   | 0,03   |
| Zahlung                      | 3-Month NZD-BBR                     | 4,750           | 19.06.2029       | NZD 9.700  | 194                        |                   | 0,01   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,000           | 03.01.2031       | ZAR 5.700  | 7                          |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,001           | 06.01.2031       | 5.700      | 7                          |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,010           | 07.01.2031       | 5.600      | 7                          |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,030           | 07.01.2031       | 5.600      | 8                          |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,053           | 07.01.2031       | 5.600      | 8                          |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,058           | 07.01.2031       | 5.600      | 8                          |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,063           | 08.01.2031       | 17.000     | 24                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,080           | 08.01.2031       | 7.900      | 12                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,203           | 10.01.2031       | 28.200     | 49                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,360           | 07.08.2028       | 26.500     | 49                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,380           | 04.08.2028       | 11.700     | 22                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,400           | 07.08.2028       | 26.500     | 50                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410           | 31.07.2028       | 12.600     | 24                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410           | 04.08.2028       | 28.300     | 54                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410           | 07.08.2028       | 7.900      | 15                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,415           | 31.07.2028       | 10.100     | 19                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,415           | 04.08.2028       | 11.800     | 23                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,420           | 31.07.2028       | 37.700     | 72                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,421           | 04.08.2028       | 12.000     | 23                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,426           | 01.08.2028       | 15.200     | 29                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,428           | 31.07.2028       | 25.100     | 49                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,460           | 01.08.2028       | 25.700     | 51                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,460           | 02.08.2028       | 26.100     | 52                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,464           | 02.08.2028       | 26.100     | 52                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,543           | 04.08.2028       | 12.000     | 25                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,550           | 03.08.2028       | 24.200     | 51                         |                   | 0,00   |
| Zahlung                      | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 20.09.2033       | AUD 13.200 | 316                        |                   | 0,02   |
| Zahlung                      | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 20.03.2034       | 13.500     | 344                        |                   | 0,02   |
| Zahlung                      | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 18.09.2034       | 2.400      | 22                         |                   | 0,00   |
| Erhalt <sup>(3)</sup>        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,830           | 09.12.2052       | € 26.700   | 2.495                      |                   | 0,13   |
| Zahlung                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,520           | 07.07.2027       | 9.600      | (33)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,000           | 17.09.2027       | 777.800    | 5.170                      |                   | 0,28   |
| Zahlung                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,220           | 08.01.2035       | 1.500      | (45)                       |                   | 0,00   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2030       | 424.140    | 4.794                      |                   | 0,26   |
| Zahlung <sup>(3)</sup>       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2035       | 74.590     | (97)                       |                   | (0,01) |
| Erhalt <sup>(3)</sup>        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2055       | 51.500     | 1.637                      |                   | 0,09   |
| Erhalt                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,300           | 25.09.2029       | 5.400      | (70)                       |                   | 0,00   |
| Erhalt                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,350           | 29.04.2030       | 4.600      | (15)                       |                   | 0,00   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz        | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,360 %         | 07.10.2029       | € 5.300    | € (86)                                          | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,380           | 31.12.2034       | 2.100      | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,400           | 09.04.2030       | 2.800      | (14)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,400           | 12.02.2035       | 2.700      | 51                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,410           | 05.11.2034       | 3.100      | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,420           | 07.03.2035       | 1.500      | (18)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,450           | 05.05.2035       | 3.500      | 52                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,460           | 13.03.2035       | 2.600      | (22)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,460           | 01.04.2035       | 1.600      | (14)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,510           | 09.04.2035       | 1.600      | 16                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,520           | 27.03.2035       | 1.600      | (8)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,520           | 09.04.2035       | 1.700      | 16                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,550           | 16.04.2035       | 3.600      | 22                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,590           | 19.08.2034       | 2.500      | (34)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,650           | 14.08.2029       | 2.000      | (61)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,750           | 05.03.2034       | 1.600      | 34                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,760           | 04.03.2034       | 1.600      | 35                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,770           | 16.04.2029       | 2.400      | 59                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,770           | 29.04.2034       | 1.600      | 36                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,780           | 02.05.2029       | 2.400      | 60                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,860           | 24.04.2029       | 3.600      | 100                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,950           | 12.06.2029       | 1.900      | 60                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,270           | 21.08.2033       | 1.600      | 128                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,450           | 20.10.2028       | 2.700      | 172                                             | 0,01                    |
|                                                |                         |                 |                  |            | € 20.557                                        | 1,10                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                 |                  |            | € 21.066                                        | 1,12                    |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750    | 11.08.2025    | 500                       | € (15)  | € 0       | 0,00                         |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750        | 11.08.2025    | 500                       | (10)    | (2)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600        | 12.11.2025    | 500                       | (18)    | (3)       | 0,00                         |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900        | 12.11.2025    | 500                       | (13)    | (8)       | 0,00                         |
|            |                           |               |               |                           | € (56)  | € (13)    | 0,00                         |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,555 %       | 24.07.2025    | 3.100                     | € (8)   | € (9)     | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,637         | 18.07.2025    | 3.400                     | (9)     | (14)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,700         | 21.07.2025    | 3.200                     | (9)     | (21)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770         | 09.07.2025    | 2.900                     | (8)     | (23)      | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,905         | 24.07.2025    | 3.100                     | (8)     | (5)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,037         | 18.07.2025    | 3.400                     | (9)     | (1)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050         | 21.07.2025    | 3.200                     | (9)     | (1)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120         | 09.07.2025    | 2.900                     | (8)     | 0         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564         | 24.07.2025    | 3.100                     | (9)     | (10)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605         | 23.07.2025    | 2.900                     | (9)     | (12)      | 0,00                         |
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914         | 24.07.2025    | 3.100                     | (8)     | (5)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955         | 23.07.2025    | 2.900                     | (8)     | (3)       | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380         | 03.07.2025    | 1.200                     | (3)     | 0         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460         | 16.07.2025    | 1.800                     | (5)     | (2)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640         | 03.07.2025    | 1.200                     | (3)     | (1)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720         | 16.07.2025    | 1.800                     | (5)     | (2)       | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525         | 28.07.2025    | 5.600                     | (16)    | (16)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583         | 23.07.2025    | 1.500                     | (5)     | (5)       | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653         | 14.07.2025    | 2.900                     | (8)     | (11)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680         | 07.07.2025    | 2.500                     | (8)     | (8)       | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695         | 17.07.2025    | 3.300                     | (8)     | (20)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775         | 07.07.2025    | 4.900                     | (13)    | (37)      | (0,01)                       |



| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875 %       | 28.07.2025    | 5.600                     | € (16)  | € (12)    | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933         | 23.07.2025    | 1.500                     | (5)     | (2)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030         | 07.07.2025    | 2.500                     | (8)     | 0         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053         | 14.07.2025    | 2.900                     | (8)     | 0         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095         | 17.07.2025    | 3.300                     | (8)     | (1)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125         | 07.07.2025    | 4.900                     | (13)    | 0         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772         | 10.07.2025    | 2.900                     | (8)     | (24)      | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122         | 10.07.2025    | 2.900                     | (8)     | 0         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664         | 14.07.2025    | 2.900                     | (8)     | (12)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669         | 07.07.2025    | 3.100                     | (10)    | (9)       | 0,00                         |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697         | 16.07.2025    | 3.000                     | (7)     | (17)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715         | 02.07.2025    | 3.100                     | (10)    | (11)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725         | 03.07.2025    | 3.100                     | (10)    | (14)      | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019         | 07.07.2025    | 3.100                     | (10)    | 0         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064         | 14.07.2025    | 2.900                     | (8)     | 0         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065         | 02.07.2025    | 3.100                     | (10)    | 0         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075         | 03.07.2025    | 3.100                     | (10)    | 0         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097         | 16.07.2025    | 3.000                     | (7)     | 0         | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | € (340) | € (308)   | (0,02)                       |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| GST        | Romania Government International Bond | 1,000 %                        | 20.12.2025       | \$ 7.600                  | € 10                                         | € (1)                                           | € 9       | 0,00                         |
|            | ADLER Real Estate AG                  | 5,000                          | 20.12.2026       | € 1.200                   | (7)                                          | 48                                              | 41        | 0,00                         |
|            | Israel Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2026       | \$ 14.200                 | 54                                           | 25                                              | 79        | 0,01                         |
|            | Israel Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2029       | 700                       | (17)                                         | 21                                              | 4         | 0,00                         |
|            | SoftBank Group Corp.                  | 1,000                          | 20.06.2026       | 1.400                     | (11)                                         | 6                                               | (5)       | 0,00                         |
| JPM        | Israel Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2029       | 200                       | (5)                                          | 6                                               | 1         | 0,00                         |
| MYC        | Israel Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2029       | 400                       | (9)                                          | 11                                              | 2         | 0,00                         |
|            |                                       |                                |                  |                           | € 15                                         | € 116                                           | € 131     | 0,01                         |

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

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.12.2029       | € 9.647                   | € 1.663                                      | € 115                                           | € 1.778   | 0,09                         |

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

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | 95                       | \$ 13                            | € 0                                | € 0                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      | 7.886                    | 9.016                            | 0                                  | (205)                                                | (0,01)                       |
|            | 08.2025          | CNH                    | 151                      | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.895                    | € 1.615                          | 4                                  | 4                                                    | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 1.918                    | \$ 2.188                         | 0                                  | (54)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | 407.683                  | € 358.545                        | 11.241                             | 0                                                    | 0,60                         |
|            | 07.2025          | DKK                    | 367                      | 49                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      | 1.884                    | \$ 2.205                         | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025          | TWD                    | 342                      | 11                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | 5                        | IDR 78.518                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH                    | 50                       | \$ 7                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | TWD                    | 176                      | 5                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 05.2026          | \$                     | 450                      | KWD 137                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 06.2026          |                        | 326                      | 99                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 06.2027          |                        | 158                      | 48                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 05.2029          | KWD                    | 675                      | \$ 2.320                         | 138                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2029          |                        | 90                       | 310                              | 19                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 05.2030          |                        | 507                      | 1.746                            | 111                                | 0                                                    | 0,01                         |
| BRC        | 07.2025          | €                      | 894                      | £ 761                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 13.887                   | \$ 15.977                        | 0                                  | (276)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025          | £                      | 2.374                    | € 2.811                          | 39                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | 8.902                    | TRY 364.840                      | 135                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025          |                        | 3.449                    | ZAR 62.336                       | 46                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | 2.925                    | TRY 121.348                      | 29                                 | 0                                                    | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>Wertabnahme | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|----------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK                              | 09.2025          | PEN                    | 21.083                   | \$ 5.776                         | € 0                              | € (129)                                              | € (129) (0,01)          |
|                                  | 07.2025          | €                      | 5.381                    | 6.152                            | 0                                | (140)                                                | (140) (0,01)            |
|                                  | 07.2025          | PEN                    | 6.754                    | 1.826                            | 0                                | (66)                                                 | (66) 0,00               |
|                                  | 07.2025          | TWD                    | 514                      | 16                               | 0                                | (2)                                                  | (2) 0,00                |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 13.774                   | BRL 81.818                       | 1.037                            | 0                                                    | 1.037 0,06              |
|                                  | 07.2025          |                        | 1.690                    | € 1.466                          | 27                               | 0                                                    | 27 0,00                 |
|                                  | 07.2025          |                        | 18                       | IDR 300.140                      | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          |                        | 1.332                    | PEN 4.800                        | 18                               | 0                                                    | 18 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 73                       | \$ 10                            | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | PEN                    | 1.480                    | 393                              | 0                                | (20)                                                 | (20) 0,00               |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 539                      | 16                               | 0                                | (2)                                                  | (2) 0,00                |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 14                       | INR 1.199                        | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 09.2025          | PEN                    | 12.180                   | \$ 3.324                         | 0                                | (85)                                                 | (85) 0,00               |
|                                  | 12.2025          |                        | 5.142                    | 1.389                            | 0                                | (45)                                                 | (45) 0,00               |
|                                  | 07.2025          | €                      | 328.312                  | 380.875                          | 0                                | (3.847)                                              | (3.847) (0,21)          |
| DUB                              | 08.2025          | \$                     | 380.875                  | € 327.592                        | 3.833                            | 0                                                    | 3.833 0,20              |
|                                  | 08.2025          |                        | 6                        | INR 478                          | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 09.2025          | MXN                    | 0                        | \$ 0                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | BRL                    | 82.112                   | 14.851                           | 0                                | (165)                                                | (165) (0,01)            |
|                                  | 07.2025          | CNH                    | 48                       | 7                                | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
| FAR                              | 07.2025          | \$                     | 2.723                    | € 2.380                          | 60                               | 0                                                    | 60 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 52                       | \$ 7                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 4                        | INR 340                          | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 09.2025          |                        | 14.851                   | BRL 83.369                       | 164                              | 0                                                    | 164 0,01                |
|                                  | 09.2025          |                        | 5.977                    | MXN 116.374                      | 113                              | 0                                                    | 113 0,01                |
|                                  | 09.2025          |                        | 63                       | PEN 230                          | 1                                | 0                                                    | 1 0,00                  |
|                                  | 11.2025          | PEN                    | 4.768                    | \$ 1.302                         | 0                                | (31)                                                 | (31) 0,00               |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 14                       | ZAR 260                          | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | CNH                    | 92                       | \$ 13                            | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | €                      | 873                      | £ 740                            | 0                                | (9)                                                  | (9) 0,00                |
|                                  | 07.2025          |                        | 2.772                    | \$ 3.202                         | 0                                | (44)                                                 | (44) 0,00               |
|                                  | 07.2025          | ¥                      | 3.222.272                | € 19.086                         | 82                               | 0                                                    | 82 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | TWD                    | 346                      | \$ 11                            | 0                                | (1)                                                  | (1) 0,00                |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 4.740                    | € 4.058                          | 20                               | 0                                                    | 20 0,00                 |
|                                  | 07.2025          |                        | 989                      | ZAR 17.675                       | 3                                | 0                                                    | 3 0,00                  |
| GLM<br>JPM                       | 08.2025          | CNH                    | 98                       | \$ 14                            | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | €                      | 19.086                   | ¥ 3.217.284                      | 0                                | (81)                                                 | (81) 0,00               |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 162                      | \$ 5                             | 0                                | (1)                                                  | (1) 0,00                |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 3                        | INR 230                          | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | CNH                    | 44                       | \$ 6                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | DKK                    | 250                      | € 33                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | €                      | 27.358                   | ¥ 4.457.500                      | 0                                | (1.070)                                              | (1.070) (0,06)          |
|                                  | 07.2025          | TWD                    | 185                      | \$ 6                             | 0                                | (1)                                                  | (1) 0,00                |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 2.718                    | € 2.377                          | 61                               | 0                                                    | 61 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 44                       | \$ 6                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 177                      | 5                                | 0                                | (1)                                                  | (1) 0,00                |
|                                  | 07.2025          | €                      | 10.703                   | 12.222                           | 0                                | (291)                                                | (291) (0,02)            |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 4.514                    | € 3.916                          | 71                               | 0                                                    | 71 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 53                       | \$ 7                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | €                      | 78                       | DKK 578                          | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
| SCX                              | 07.2025          | £                      | 135.225                  | € 160.817                        | 2.955                            | 0                                                    | 2.955 0,16              |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 20                       | IDR 331.349                      | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 92                       | \$ 13                            | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | DKK                    | 578                      | € 78                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 106                      | \$ 3                             | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 3                        | INR 238                          | 0                                | 0                                                    | 0 0,00                  |
|                                  | 07.2025          | €                      | 160.586                  | £ 137.039                        | 0                                | (608)                                                | (608) (0,03)            |
|                                  | 08.2025          | £                      | 137.320                  | € 160.586                        | 604                              | 0                                                    | 604 0,03                |
|                                  | 12.2025          | PEN                    | 3.358                    | \$ 908                           | 0                                | (29)                                                 | (29) 0,00               |
|                                  | 07.2025          | €                      | 1.275                    | £ 1.086                          | 0                                | (7)                                                  | (7) 0,00                |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 80                       | TRY 3.532                        | 5                                | 0                                                    | 5 0,00                  |
|                                  | 09.2025          |                        | 159                      | MXN 3.074                        | 2                                | 0                                                    | 2 0,00                  |
|                                  | 11.2025          |                        | 85                       | TRY 4.006                        | 4                                | 0                                                    | 4 0,00                  |
|                                  |                  |                        |                          |                                  | € 20.822                         | € (7.224)                                            | € 13.598 0,73           |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                  | € 15.186                                             | 0,81                    |
| Summe Anlagen                    |                  |                        |                          |                                  |                                  | € 2.665.348                                          | 142,29                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                        |                          |                                  |                                  | € (792.163)                                          | (42,29)                 |
| Nettovermögen                    |                  |                        |                          |                                  |                                  | € 1.873.185                                          | 100,00                  |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.



(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,02 %):

| Emittentenbeschreibung                                        | Kaufdatum  | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------------------------|------------|--------|-----------|----------------------|
| Corestate Capital Holding S.A.                                | 22.08.2023 | € 0    | € 0       | 0,00                 |
| Pantheon Senior Debt Secondaries 6,317 % fällig am 26.03.2026 | 18.03.2025 | 549    | 511       | 0,03                 |
| Project Alfa 4,256 % fällig am 27.02.2026                     | 28.02.2025 | 378    | 378       | 0,02                 |
|                                                               |            | € 927  | € 889     | 0,05                 |

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 4.435 EUR (31. Dezember 2024: 6.154 EUR) als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 54.696 EUR (31. Dezember 2024: 51.640 EUR) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 1.253 EUR (31. Dezember 2024: 10.088 EUR) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert          |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                | € 2.220.992                                               | € 25.970                                               | € 2.246.962        |
| Investmentfonds               | 182.452                                                            | 0                                                         | 0                                                      | 182.452            |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                  | 186.100                                                   | 0                                                      | 186.100            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 2.412                                                              | 47.422                                                    | 0                                                      | 49.834             |
| <b>Summen</b>                 | <b>€ 184.864</b>                                                   | <b>€ 2.454.514</b>                                        | <b>€ 25.970</b>                                        | <b>€ 2.665.348</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert          |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|--------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                | € 2.121.862                                               | € 9.057                                                | € 2.130.919        |
| Investmentfonds               | 18.242                                                             | 145.268                                                   | 0                                                      | 163.510            |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                  | 158.800                                                   | 0                                                      | 158.800            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (95)                                                               | 30.498                                                    | 0                                                      | 30.403             |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                  | (591)                                                     | 0                                                      | (591)              |
| <b>Summen</b>                 | <b>€ 18.147</b>                                                    | <b>€ 2.455.837</b>                                        | <b>€ 9.057</b>                                         | <b>€ 2.483.041</b> |

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BPS                                       | 1,890 %    | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (4.144)    | € (4.148)                                | (0,22)               |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                    |              | <b>€ (4.148)</b>                         | <b>(0,22)</b>        |

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

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | € (201)                             | € 9                                   | € (192)                         | € k. A.                             | € k. A.                               | € k. A.                         |
| BOA        | 11.113                              | (10.589)                              | 524                             | (338)                               | 299                                   | (39)                            |
| BPS        | 2.046                               | (2.080)                               | (34)                            | (660)                               | 730                                   | 70                              |
| BRC        | (161)                               | 0                                     | (161)                           | 23                                  | 319                                   | 342                             |
| CBK        | 687                                 | (554)                                 | 133                             | (178)                               | 0                                     | (178)                           |
| DUB        | (14)                                | 0                                     | (14)                            | (375)                               | 290                                   | (85)                            |
| FAR        | 142                                 | 0                                     | 142                             | (4)                                 | 0                                     | (4)                             |
| GLM        | (112)                               | 239                                   | 127                             | (456)                               | 637                                   | 181                             |
| GST        | 119                                 | 0                                     | 119                             | 30                                  | 0                                     | 30                              |
| JPM        | (54)                                | 34                                    | (20)                            | 474                                 | (270)                                 | 204                             |
| MBG        | (1.011)                             | 954                                   | (57)                            | (8.139)                             | 6.432                                 | (1.707)                         |
| MYC        | (61)                                | 0                                     | (61)                            | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| MYI        | (220)                               | 0                                     | (220)                           | (270)                               | 309                                   | 39                              |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (14)                                | 0                                     | (14)                            |
| SCX        | 2.955                               | (2.547)                               | 408                             | (1.334)                             | 1.072                                 | (262)                           |
| SSB        | (33)                                | 0                                     | (33)                            | 3                                   | 0                                     | 3                               |
| UAG        | (9)                                 | 17                                    | 8                               | 24                                  | 0                                     | 24                              |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 23,78             | 16,83             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 35,80             | 44,24             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,06              | 0,06              |
| Investmentfonds                                                        | 4,84              | 4,71              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 4,94              | 4,57              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,40              | 0,07              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,97              | 1,79              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,60              | 0,06              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 28,61             | 27,67             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 1,53              | 1,26              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 17,31             | 21,27             |
| Wandelanleihen & Wechsel                                                               | 0,04              | 0,05              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 44,48             | 51,35             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 0,56              | 3,74              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 15,26             | 18,93             |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 23,71             | 23,68             |
| Staatsemissionen                                                                       | 4,84              | 6,81              |
| Stammaktien                                                                            | 0,00              | 0,00              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 12,23             | k. A.             |
| Investmentfonds                                                                        | 9,74              | 9,75              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 9,93              | 9,47              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,74              | (0,07)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | (0,01)            | (0,01)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | (0,01)            | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,03              | 0,02              |
| Zinsswaps                                                                              | 1,10              | 2,54              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,00              | (0,07)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,02)            | (0,02)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,09              | k. A.             |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | 0,73              | (0,58)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | k. A.             | (0,04)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (42,29)           | (48,08)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>         |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| <b>BANKEN UND FINANZEN</b>              |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| Canadian Imperial Bank of Commerce      |                |                          |                                   | Barley Hill PLC                             |                |                          |                                   | Towd Point Mortgage Funding PLC          |                |                          |                                   |
| 4,495 % fällig am 20.12.2027 AUD        | 4.900          | € 2.771                  | 0,23                              | 5,144 % fällig am 27.08.2058                | £ 4            | € 5                      | 0,00                              | 5,074 % fällig am 20.04.2051             | £ 2.556        | € 2.986                  | 0,25                              |
| 4,876 % fällig am 14.01.2030            | \$ 5.100       | 4.484                    | 0,37                              | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust |                |                          |                                   | 5,223 % fällig am 20.07.2053             | 2.472          | 2.893                    | 0,24                              |
| International Development Association   |                |                          |                                   | 4,967 % fällig am 25.07.2033                | \$ 2           |                          | 0,00                              | Tower Bridge Funding PLC                 |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 24.01.2040            | € 1.300        | 1.284                    | 0,10                              | Bletchley Park Funding PLC                  |                |                          |                                   | 4,959 % fällig am 20.12.2063             | 64             | 75                       | 0,01                              |
| Jyske Realkredit A/S                    |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 27.01.2070                | £ 925          | 1.082                    | 0,09                              | 5,398 % fällig am 20.01.2066             | 1.558          | 1.823                    | 0,15                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK        | 0              | 0                        | 0,00                              | Bowbell Master Issuer PLC                   |                |                          |                                   | Trinity Square PLC                       |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053            | 0              | 0                        | 0,00                              | 0,000 % fällig am 23.07.2071                | 3.800          | 4.442                    | 0,37                              | 5,217 % fällig am 15.07.2059             | 2.739          | 3.206                    | 0,27                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050            | 3              | 0                        | 0,00                              | Braccan Mortgage Funding PLC                |                |                          |                                   | Twin Bridges PLC                         |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050            | 16             | 2                        | 0,00                              | 0,000 % fällig am 17.05.2067                | 5.200          | 6.097                    | 0,50                              | 4,898 % fällig am 12.09.2055             | 2.159          | 2.521                    | 0,21                              |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau         |                |                          |                                   | Brants Bridge PLC                           |                |                          |                                   | 5,009 % fällig am 12.12.2055             | 533            | 623                      | 0,05                              |
| 2,625 % fällig am 10.01.2034            | € 11.800       | 11.665                   | 0,96                              | 5,139 % fällig am 14.06.2066                | 1.174          | 1.374                    | 0,11                              | 5,417 % fällig am 15.05.2056             | 634            | 743                      | 0,06                              |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab    |                |                          |                                   | Canada Square Funding PLC                   |                |                          |                                   |                                          |                | 94.009                   | 7,75                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK        | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,019 % fällig am 17.06.2058                | 1.263          | 1.475                    | 0,12                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050            | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,161 % fällig am 17.01.2059                | 1.519          | 1.776                    | 0,15                              | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>           |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047            | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,189 % fällig am 17.06.2058                | 249            | 291                      | 0,02                              | Auto ABS French Loans                    |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050            | 19             | 2                        | 0,00                              | Cheshire PLC                                |                |                          |                                   | 2,421 % fällig am 24.07.2036             | € 3.571        | 3.574                    | 0,29                              |
| 4,000 % fällig am 01.10.2056            | 24.456         | 3.239                    | 0,27                              | Curzon Mortgages PLC                        |                |                          |                                   | Auto ABS Italian Stella Loans SRL        |                |                          |                                   |
| Nykredit Realkredit A/S                 |                |                          |                                   | 5,482 % fällig am 28.07.2049                | 6.270          | 7.342                    | 0,61                              | 2,773 % fällig am 28.12.2040             | 4.800          | 4.815                    | 0,40                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050            | 0              | 0                        | 0,00                              | Dilosk RMBS DAC                             |                |                          |                                   | Autonorria Spain                         |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053            | 10             | 1                        | 0,00                              | 2,751 % fällig am 20.05.2062                | € 2.885        | 2.884                    | 0,24                              | 2,530 % fällig am 30.04.2043             | 6.100          | 6.108                    | 0,50                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2056            | 0              | 0                        | 0,00                              | 2,786 % fällig am 24.09.2060                | 2.201          | 2.200                    | 0,18                              | Bavarian Sky S.A.                        |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 01.10.2047            | 1              | 0                        | 0,00                              | 3,049 % fällig am 20.10.2062                | 1.113          | 1.118                    | 0,09                              | 0,000 % fällig am 20.08.2032 (a)         | 4.100          | 4.101                    | 0,34                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050            | 0              | 0                        | 0,00                              | 3,106 % fällig am 20.07.2061                | 309            | 309                      | 0,03                              | Bumper NL BV                             |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 01.10.2052            | 0              | 0                        | 0,00                              | Domi BV                                     |                |                          |                                   | 2,539 % fällig am 21.03.2036             | 3.600          | 3.604                    | 0,30                              |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047            | 0              | 0                        | 0,00                              | 3,023 % fällig am 15.11.2052                | 560            | 561                      | 0,05                              | Cars Alliance Auto Loans France          |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050            | 22             | 2                        | 0,00                              | 3,129 % fällig am 15.04.2054                | 651            | 653                      | 0,05                              | 2,499 % fällig am 23.10.2034             | 4.000          | 4.006                    | 0,33                              |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053            | 0              | 0                        | 0,00                              | Dutch Property Finance BV                   |                |                          |                                   | Cars Alliance Auto Loans Germany         |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053            | 0              | 0                        | 0,00                              | 2,911 % fällig am 28.10.2059                | 2.287          | 2.289                    | 0,19                              | 2,431 % fällig am 18.01.2036             | 3.311          | 3.314                    | 0,27                              |
| 3,500 % fällig am 01.04.2053            | 0              | 0                        | 0,00                              | 3,061 % fällig am 28.04.2064                | 149            | 149                      | 0,01                              | Compartment VCL                          |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 01.10.2056            | 109.913        | 14.570                   | 1,20                              | Economic Master Issuer PLC                  |                |                          |                                   | 2,389 % fällig am 22.07.2030             | 2.618          | 2.620                    | 0,22                              |
| 5,000 % fällig am 01.10.2053            | 7              | 1                        | 0,00                              | 0,000 % fällig am 25.04.2075 (a)            | £ 5.100        | 5.956                    | 0,49                              | 2,431 % fällig am 21.04.2031             | 5.700          | 5.704                    | 0,47                              |
| Realcredit Danmark A/S                  |                |                          |                                   | Eurohome UK Mortgages PLC                   |                |                          |                                   | E-Carat DE                               |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050            | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,508 % fällig am 15.06.2044                | 34             | 40                       | 0,00                              | 0,000 % fällig am 25.05.2034             | 6.100          | 6.106                    | 0,50                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053            | 0              | 0                        | 0,00                              | Holmes Master Issuer PLC                    |                |                          |                                   | 2,321 % fällig am 25.11.2035             | 3.100          | 3.099                    | 0,26                              |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047            | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,847 % fällig am 15.10.2072                | 2.900          | 3.389                    | 0,28                              | FACT S.A.                                |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053            | 0              | 0                        | 0,00                              | Hops Hill PLC                               |                |                          |                                   | 2,547 % fällig am 22.09.2031             | 2.659          | 2.664                    | 0,22                              |
| 4,000 % fällig am 01.10.2056            | 17.041         | 2.275                    | 0,19                              | 0,000 % fällig am 21.06.2056 (a)            | 2.500          | 2.921                    | 0,24                              | FCT CA Leasing                           |                |                          |                                   |
|                                         |                | 40.296                   | 3,32                              | 5,103 % fällig am 21.04.2056                | 3.246          | 3.803                    | 0,31                              | 2,794 % fällig am 26.02.2042             | 270            | 271                      | 0,02                              |
|                                         |                |                          |                                   | Jubilee Place BV                            |                |                          |                                   | FTA Santander Consumer Spain Auto        |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 3,263 % fällig am 17.10.2057                | € 58           | 58                       | 0,01                              | 2,736 % fällig am 22.06.2035             | 825            | 826                      | 0,07                              |
|                                         |                |                          |                                   | Lace Funding PLC                            |                |                          |                                   | Golden Bar Securitisation SRL            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 4,787 % fällig am 21.11.2074                | £ 2.717        | 3.179                    | 0,26                              | 2,747 % fällig am 20.12.2044             | 6.100          | 6.113                    | 0,50                              |
|                                         |                |                          |                                   | Landmark Mortgage Securities PLC            |                |                          |                                   | 3,086 % fällig am 22.09.2043             | 2.921          | 2.940                    | 0,24                              |
|                                         |                |                          |                                   | 4,558 % fällig am 17.06.2039                | 113            | 130                      | 0,01                              | Hill FL BV                               |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | London Wall Mortgage Capital PLC            |                |                          |                                   | 2,641 % fällig am 18.02.2032             | 1.728          | 1.730                    | 0,14                              |
|                                         |                |                          |                                   | 4,987 % fällig am 15.05.2051                | 438            | 512                      | 0,04                              | LT Rahoitus DAC                          |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Ludgate Funding PLC                         |                |                          |                                   | 2,451 % fällig am 18.07.2036             | 442            | 443                      | 0,04                              |
|                                         |                |                          |                                   | 4,519 % fällig am 01.01.2061                | 55             | 62                       | 0,01                              | Pony S.A., Compartment German Auto Loans |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 4,547 % fällig am 01.12.2060                | 126            | 145                      | 0,01                              | 2,532 % fällig am 14.11.2032             | 1.343          | 1.346                    | 0,11                              |
|                                         |                |                          |                                   | Mortimer BTL PLC                            |                |                          |                                   | Pulse UK PLC                             |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 4,939 % fällig am 23.06.2053                | 1.205          | 1.406                    | 0,12                              | 4,884 % fällig am 27.05.2036             | £ 3.400        | 3.973                    | 0,33                              |
|                                         |                |                          |                                   | 5,409 % fällig am 22.12.2056                | 590            | 692                      | 0,06                              | Red & Black Auto Germany UG              |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Mortimer Mix PLC                            |                |                          |                                   | 2,482 % fällig am 15.04.2034             | € 5.870        | 5.881                    | 0,49                              |
|                                         |                |                          |                                   | 5,069 % fällig am 22.09.2067                | 3.700          | 4.333                    | 0,36                              | Red & Black Auto Italy SRL               |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Newgate Funding PLC                         |                |                          |                                   | 2,929 % fällig am 28.07.2034             | 750            | 754                      | 0,06                              |
|                                         |                |                          |                                   | 2,575 % fällig am 15.12.2050                | € 422          | 415                      | 0,03                              | RevoCar S.A., Compartment                |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Pierpont BTL PLC                            |                |                          |                                   | 2,431 % fällig am 25.07.2037             | 3.061          | 3.064                    | 0,25                              |
|                                         |                |                          |                                   | 5,339 % fällig am 21.09.2054                | £ 227          | 266                      | 0,02                              | Revocar UG                               |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Precise Mortgage Funding PLC                |                |                          |                                   | 2,436 % fällig am 21.02.2037             | 2.853          | 2.856                    | 0,24                              |
|                                         |                |                          |                                   | 5,203 % fällig am 16.07.2060                | 975            | 1.143                    | 0,09                              |                                          |                | 79.912                   | 6,59                              |
|                                         |                |                          |                                   | Primrose Residential DAC                    |                |                          |                                   | <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>               |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 3,399 % fällig am 24.10.2061                | € 348          | 348                      | 0,03                              | <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>   |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | RMAC Securities PLC                         |                |                          |                                   | 3,719 % fällig am 25.01.2036             | \$ 0           | 0                        | 0,00                              |
|                                         |                |                          |                                   | 4,508 % fällig am 12.06.2044                | £ 139          | 159                      | 0,01                              | <b>ABS SONSTIGE</b>                      |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Silverstone Master Issuer PLC               |                |                          |                                   | Accunia European CLO DAC                 |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 4,588 % fällig am 21.01.2070                | 1.516          | 1.766                    | 0,15                              | 3,229 % fällig am 15.07.2030             | € 128          | 129                      | 0,01                              |
|                                         |                |                          |                                   | 4,798 % fällig am 21.01.2070                | 2.100          | 2.454                    | 0,20                              | Anchorage Capital Europe CLO DAC         |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Stratton Mortgage Funding PLC               |                |                          |                                   | 3,499 % fällig am 15.10.2038             | 3.500          | 3.495                    | 0,29                              |
|                                         |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 25.06.2049                | 3.041          | 3.555                    | 0,29                              | Arcano Euro CLO DAC                      |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 5,389 % fällig am 20.06.2060                | 2.003          | 2.343                    | 0,19                              | 0,000 % fällig am 25.07.2039 (a)         | 1.000          | 1.000                    | 0,08                              |
|                                         |                |                          |                                   | Structured Asset Mortgage Investments Trust |                |                          |                                   | Ares European CLO DAC                    |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 4,932 % fällig am 19.07.2035                | \$ 4           | 4                        | 0,00                              | 3,086 % fällig am 20.04.2032             | 922            | 922                      | 0,08                              |
|                                         |                |                          |                                   | Thornburg Mortgage Securities Trust         |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 5,074 % fällig am 25.09.2043                | 11             | 10                       | 0,00                              |                                          |                |                          |                                   |

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

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 657                  | € 1.215                                  | 0,10                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Long  | 09.2025     | 185                  | 398                                      | 0,03                 |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025     | 366                  | (1.260)                                  | (0,11)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 228                  | 639                                      | 0,05                 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Short | 09.2025     | 91                   | (172)                                    | (0,02)               |
|                                                      |       |             |                      | € (1.777)                                | (0,15)               |

## OPTIONSKAUF

### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|--------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,938      | 15.12.2025    | 332                  | € 159  | € 12      | 0,00                 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|---------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,813      | 12.12.2025    | 332                  | € (212) | € (54)    | 0,00                 |

|                                                                |  |  |  |  |           |        |
|----------------------------------------------------------------|--|--|--|--|-----------|--------|
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |  |  |  |  | € (1.819) | (0,15) |
|----------------------------------------------------------------|--|--|--|--|-----------|--------|

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

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

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex        | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|------------------|------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 79.700   | € 455                                    | 0,04                 |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2027       | 3.512      | 1                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 20.12.2053       | \$ 6.700   | 109                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 19.03.2055       | 800        | (12)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500           | 20.06.2054       | 17.200     | 12                                       | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,900           | 15.02.2035       | 16.682     | (256)                                    | (0,02)               |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,100           | 15.11.2052       | 21.240     | (382)                                    | (0,03)               |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,611           | 31.10.2025       | 63.800     | 49                                       | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR            | 1,830           | 17.09.2027       | € 15.700   | 49                                       | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,000           | 17.09.2027       | 64.200     | 168                                      | 0,01                 |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2035       | 103.600    | 918                                      | 0,08                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2055       | 34.900     | 1.022                                    | 0,08                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                        | 2,125           | 15.03.2035       | 12.000     | (139)                                    | (0,01)               |
|                                             |                                |                 |                  |            | € 1.994                                  | 0,16                 |
|                                             |                                |                 |                  |            | € 1.994                                  | 0,16                 |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|----------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                           | 3,650 %       | 04.12.2025    | 160.800                   | € 317  | € 439     | 0,04                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

### ZINSSWAPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                             | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld   | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------|-----------|------------------------------|
| BRC        | Call - OTC 2-Year Interest<br>Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,440 %       | 25.01.2027    | 4.400                     | € (37)    | € (37)    | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest<br>Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,440         | 25.01.2027    | 4.400                     | (37)      | (23)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest<br>Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,740         | 08.09.2025    | 4.800                     | (103)     | (79)      | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 10-Year Interest<br>Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,740         | 08.09.2025    | 4.800                     | (103)     | (27)      | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 2-Year Interest<br>Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,350         | 07.01.2027    | 18.500                    | (162)     | (141)     | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest<br>Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,350         | 07.01.2027    | 18.500                    | (162)     | (111)     | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 2-Year Interest<br>Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,500         | 14.01.2027    | 26.300                    | (234)     | (246)     | (0,02)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest<br>Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,500         | 14.01.2027    | 26.300                    | (234)     | (130)     | (0,01)                       |
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest<br>Rate Swap  | 6-Month GBP-SONIA       | Erhalt                                  | 3,150         | 04.12.2025    | 160.800                   | (104)     | (120)     | (0,01)                       |
| MYI        | Put - OTC 5-Year Interest<br>Rate Swap   | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                                 | 4,000         | 15.08.2025    | 41.600                    | (272)     | (33)      | 0,00                         |
|            |                                          |                         |                                         |               |               |                           | € (1.448) | € (947)   | (0,08)                       |

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

### DEWISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                    | 344                      | \$ 431                           | € 0                                | € (1)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 6.560                    | 911                              | 0                                  | € (5)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 8                        | AUD 12                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.295                    | € 2.019                          | 64                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 427                      | NZD 710                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 12                       | \$ 8                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 17.413                   | 2.429                            | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 25                       | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 710                      | 428                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 431                      | CHF 343                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | CHF                    | 1.949                    | € 2.082                          | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 2.244                    | \$ 2.534                         | 0                                  | (85)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 1.083.703                | 795                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 91                       | 70                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 54.102                   | € 47.581                         | 1.492                              | 1.492                                                | 0,12                    |
|            | 07.2025          |                        | 813                      | IDR 13.256.053                   | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 383                      | SGD 491                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 490                      | \$ 383                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 290                      | 9                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 157                      | € 167                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | DKK                    | 88.806                   | 11.909                           | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 99.295                   | £ 84.637                         | 0                                  | (490)                                                | (0,04)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 74.699                   | € 88.930                         | 1.727                              | 1.727                                                | 0,14                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 2.090                    | 181                              | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.019                    | \$ 31                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 55.160                   | 1.697                            | 0                                  | (171)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 890                      | BRL 4.954                        | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.821                    | IDR 29.706.186                   | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 130                      | THB 4.258                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 503                      | TWD 14.981                       | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 08.2025          | CNH                    | 9.228                    | \$ 1.292                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 84.811                   | € 99.295                         | 488                                | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 45.677                   | \$ 1.401                         | 0                                  | (158)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.436                    | INR 124.845                      | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.730                    | TWD 50.806                       | 30                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 117                      | £ 100                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.529                    | ¥ 250.002                        | 0                                  | (54)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 37                       | NOK 429                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.782                    | \$ 3.230                         | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 5.725                    | € 6.730                          | 46                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | ILS                    | 8.444                    | \$ 2.425                         | 0                                  | (70)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 203.883                  | € 1.206                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 134.205                  | \$ 98                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 199                      | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 140                      | 37                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 785                      | 19                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.806                    | € 3.281                          | 38                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.203                    | ILS 4.060                        | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 17                       | KRW 23.055                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 127                      | TRY 5.165                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        | 842                      | ZAR 15.214                       | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 1.206                    | ¥ 203.579                        | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 17.162                   | \$ 3.001                         | 0                                  | (123)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CAD                    | 14.572                   | € 9.325                          | 227                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          | €                      | 235                      | NOK 2.775                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.011                    | \$ 2.300                         | 0                                  | (52)                                                 | 0,00                    |
|            |                  | KRW                    | 9.510.051                | 6.938                            | 0                                  | (80)                                                 | (0,01)                  |



| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte |             | Nicht realisierte               |                  | % des<br>Nettovermögens |       |      |       |        |
|------------|------------------|------------------------|-----------------------|-------------------|-------------|---------------------------------|------------------|-------------------------|-------|------|-------|--------|
|            |                  |                        |                       | Wertzunahme       | Wertabnahme | Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | Nettowertabnahme |                         |       |      |       |        |
| DUB        | 07.2025          | THB                    | 53.304                | \$                | 1.603       | €                               | 0                | €                       | (33)  | €    | (33)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD                    | 96.086                |                   | 2.953       |                                 | 0                |                         | (302) |      | (302) | (0,03) |
|            | 07.2025          | \$                     | 15.357                | BRL               | 89.139      |                                 | 831              |                         | 0     |      | 831   | 0,07   |
|            | 07.2025          |                        | 64                    | CNY               | 457         |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 4.610                 | €                 | 4.017       |                                 | 90               |                         | 0     |      | 90    | 0,01   |
|            | 07.2025          |                        | 1.435                 | IDR               | 23.369.169  |                                 | 4                |                         | 0     |      | 4     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 790                   | TWD               | 23.409      |                                 | 14               |                         | 0     |      | 14    | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH                    | 2.225                 | \$                | 310         |                                 | 0                |                         | (2)   |      | (2)   | 0,00   |
|            | 08.2025          | NOK                    | 2.780                 | €                 | 235         |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD                    | 107.225               | \$                | 3.291       |                                 | 0                |                         | (371) |      | (371) | (0,03) |
|            | 08.2025          | \$                     | 8.617                 | INR               | 742.951     |                                 | 26               |                         | (4)   |      | 22    | 0,00   |
|            | 09.2025          | MXN                    | 3.811                 | \$                | 199         |                                 | 0                |                         | (1)   |      | (1)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | AUD                    | 12                    |                   | 8           |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 07.2025          | €                      | 46.531                |                   | 53.981      |                                 | 0                |                         | (545) |      | (545) | (0,05) |
|            | 07.2025          | ILS                    | 4.100                 |                   | 1.183       |                                 | 0                |                         | (29)  |      | (29)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | KRW                    | 149.998               |                   | 110         |                                 | 0                |                         | (1)   |      | (1)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | SGD                    | 88                    |                   | 68          |                                 | 0                |                         | (1)   |      | (1)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                     | 111                   | IDR               | 1.810.743   |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 179                   | TWD               | 5.327       |                                 | 4                |                         | 0     |      | 4     | 0,00   |
|            | GLM              | 08.2025                | CNH                   | 13.346            | \$          | 1.848                           |                  | 0                       |       | (18) |       | (18)   |
| 08.2025    |                  | \$                     | 53.981                | €                 | 46.429      |                                 | 543              |                         | 0     |      | 543   | 0,04   |
| 08.2025    |                  |                        | 4.131                 | INR               | 356.815     |                                 | 17               |                         | (1)   |      | 16    | 0,00   |
| 09.2025    |                  | MXN                    | 1                     | \$                | 0           |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
| 07.2025    |                  | BRL                    | 77.077                |                   | 13.982      |                                 | 0                |                         | (119) |      | (119) | (0,01) |
| 07.2025    |                  | DKK                    | 921                   | €                 | 123         |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
| 07.2025    |                  | €                      | 9.325                 | CAD               | 14.862      |                                 | 0                |                         | (46)  |      | (46)  | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                        | 2.471                 | ¥                 | 402.534     |                                 | 0                |                         | (97)  |      | (97)  | (0,01) |
| 07.2025    |                  | TWD                    | 10.243                | \$                | 315         |                                 | 0                |                         | (32)  |      | (32)  | 0,00   |
| 07.2025    |                  | \$                     | 340                   | IDR               | 5.543.266   |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
| JPM        | 07.2025          |                        | 175                   | SGD               | 223         |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 08.2025          | CAD                    | 14.871                | €                 | 9.325       |                                 | 45               |                         | 0     |      | 45    | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH                    | 4.344                 | \$                | 606         |                                 | 0                |                         | (3)   |      | (3)   | 0,00   |
|            | 08.2025          | SGD                    | 223                   |                   | 175         |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 10.2025          | \$                     | 13.982                | BRL               | 78.841      |                                 | 114              |                         | 0     |      | 114   | 0,01   |
|            | 07.2025          | AUD                    | 232                   | €                 | 130         |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
|            | 07.2025          | CNH                    | 5.914                 | \$                | 819         |                                 | 0                |                         | (6)   |      | (6)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | €                      | 950                   | DKK               | 7.091       |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 235                   | £                 | 200         |                                 | 0                |                         | (1)   |      | (1)   | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 2.618                 | \$                | 3.007       |                                 | 0                |                         | (57)  |      | (57)  | (0,01) |
|            | 07.2025          | £                      | 3.958                 | €                 | 4.688       |                                 | 67               |                         | 0     |      | 67    | 0,01   |
|            | 07.2025          | ¥                      | 471.710               |                   | 2.794       |                                 | 12               |                         | 0     |      | 12    | 0,00   |
|            | 07.2025          | KRW                    | 819.431               | \$                | 599         |                                 | 0                |                         | (6)   |      | (6)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | NZD                    | 710                   |                   | 423         |                                 | 0                |                         | (6)   |      | (6)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | PLN                    | 1.509                 |                   | 402         |                                 | 0                |                         | (13)  |      | (13)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | SGD                    | 3.382                 |                   | 2.633       |                                 | 0                |                         | (19)  |      | (19)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD                    | 55.833                |                   | 1.717       |                                 | 0                |                         | (175) |      | (175) | (0,01) |
|            | 07.2025          | \$                     | 7.347                 | PLN               | 27.156      |                                 | 140              |                         | 0     |      | 140   | 0,01   |
|            | 07.2025          |                        | 251                   | SGD               | 321         |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 241                   | ZAR               | 4.314       |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
| MBC        | 08.2025          | CNH                    | 16.270                | \$                | 2.268       |                                 | 0                |                         | (10)  |      | (10)  | 0,00   |
|            | 08.2025          | DKK                    | 7.089                 | €                 | 950         |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 08.2025          | €                      | 2.794                 | ¥                 | 470.980     |                                 | 0                |                         | (12)  |      | (12)  | 0,00   |
|            | 08.2025          | SGD                    | 321                   | \$                | 251         |                                 | 0                |                         | (1)   |      | (1)   | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD                    | 56.625                |                   | 1.738       |                                 | 0                |                         | (196) |      | (196) | (0,02) |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.606                 | INR               | 139.242     |                                 | 12               |                         | 0     |      | 12    | 0,00   |
|            | 08.2025          |                        | 55                    | TWD               | 1.790       |                                 | 6                |                         | 0     |      | 6     | 0,00   |
|            | 07.2025          | AUD                    | 1.266                 | €                 | 721         |                                 | 14               |                         | 0     |      | 14    | 0,00   |
|            | 07.2025          | CHF                    | 919                   |                   | 986         |                                 | 2                |                         | 0     |      | 2     | 0,00   |
|            | 07.2025          | CNH                    | 3.230                 | \$                | 448         |                                 | 0                |                         | (3)   |      | (3)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | DKK                    | 60.367                | €                 | 8.095       |                                 | 3                |                         | 0     |      | 3     | 0,00   |
|            | 07.2025          | €                      | 79                    | NOK               | 924         |                                 | 0                |                         | (1)   |      | (1)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | PLN                    | 1.079                 | \$                | 288         |                                 | 0                |                         | (9)   |      | (9)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | SGD                    | 8.125                 |                   | 6.334       |                                 | 0                |                         | (39)  |      | (39)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | THB                    | 26.758                |                   | 808         |                                 | 0                |                         | (13)  |      | (13)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD                    | 26.777                |                   | 822         |                                 | 0                |                         | (85)  |      | (85)  | (0,01) |
|            | 07.2025          | \$                     | 419                   | CHF               | 344         |                                 | 12               |                         | 0     |      | 12    | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 349                   | IDR               | 5.675.521   |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 6.621                 | SGD               | 8.562       |                                 | 87               |                         | 0     |      | 87    | 0,01   |
|            | 07.2025          |                        | 37                    | TWD               | 1.090       |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
| MYI        | 08.2025          | CNH                    | 3.239                 | \$                | 448         |                                 | 0                |                         | (5)   |      | (5)   | 0,00   |
|            | 08.2025          | NOK                    | 925                   | €                 | 79          |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
|            | 08.2025          | SGD                    | 8.543                 | \$                | 6.621       |                                 | 0                |                         | (88)  |      | (88)  | (0,01) |
|            | 08.2025          | TWD                    | 44.421                |                   | 1.373       |                                 | 0                |                         | (146) |      | (146) | (0,01) |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.430                 | TWD               | 39.797      |                                 | 0                |                         | (40)  |      | (40)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | €                      | 1.626                 | \$                | 1.884       |                                 | 0                |                         | (21)  |      | (21)  | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                     | 187                   | NOK               | 1.882       |                                 | 0                |                         | (1)   |      | (1)   | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 21                    | PLN               | 79          |                                 | 0                |                         | 0     |      | 0     | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH                    | 13.500                | \$                | 1.886       |                                 | 0                |                         | (5)   |      | (5)   | 0,00   |
|            | 08.2025          | NOK                    | 1.882                 |                   | 187         |                                 | 1                |                         | 0     |      | 1     | 0,00   |
| RBC        | 08.2025          | TWD                    | 47.009                |                   | 1.470       |                                 | 0                |                         | (139) |      | (139) | (0,01) |
|            | 07.2025          | SEK                    | 2.010                 | €                 | 183         |                                 | 4                |                         | 0     |      | 4     | 0,00   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |         |   |         |   |       |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|---------|---|---------|---|-------|
| RYL                              | 07.2025          | NOK                 | 1.520                 | €                             | 132                             | €                                              | 4                    | 0,00    |   |         |   |       |
| SCX                              | 07.2025          | SEK                 | 1.145                 |                               | 105                             |                                                | 3                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | AUD                 | 45.448                |                               | 25.798                          |                                                | 425                  | 0,03    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | CNY                 | 458                   | \$                            | 64                              |                                                | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | €                   | 26.176                | AUD                           | 46.946                          |                                                | 34                   | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          |                     | 18.856                | DKK                           | 140.664                         | (2)                                            | (2)                  | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          |                     | 701                   | £                             | 600                             | (1)                                            | (1)                  | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | ILS                 | 62                    | \$                            | 18                              | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | TWD                 | 3.552                 |                               | 122                             | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 1.582                 | IDR                           | 25.779.968                      | 0                                              | 5                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          |                     | 1.322                 | SGD                           | 1.705                           | 0                                              | 14                   | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          |                     | 272                   | TWD                           | 8.084                           | 0                                              | 5                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | AUD                 | 46.946                | €                             | 26.133                          | (36)                                           | (36)                 | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | CNH                 | 27.621                | \$                            | 3.865                           | (5)                                            | (5)                  | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | DKK                 | 140.627               | €                             | 18.856                          | 0                                              | 2                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | SGD                 | 1.702                 | \$                            | 1.322                           | (15)                                           | (15)                 | 0,00    |   |         |   |       |
| SOG                              | 08.2025          | TWD                 | 14.958                |                               | 458                             | (52)                                           | (52)                 | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 64                    | CNY                           | 457                             | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          |                     | 1.255                 | INR                           | 107.745                         | (1)                                            | (1)                  | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | €                   | 345                   | CHF                           | 323                             | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 20                    | NOK                           | 196                             | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | CHF                 | 322                   | €                             | 345                             | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | NOK                 | 196                   | \$                            | 20                              | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 10                    | INR                           | 832                             | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
| UAG                              | 07.2025          | €                   | 2.831                 | CHF                           | 2.654                           | 10                                             | 10                   | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | ILS                 | 620                   | \$                            | 173                             | (10)                                           | (10)                 | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | KRW                 | 133.928               |                               | 99                              | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | NOK                 | 1.879                 |                               | 185                             | (1)                                            | (1)                  | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | THB                 | 4.249                 |                               | 128                             | (3)                                            | (3)                  | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 99                    | KRW                           | 133.993                         | 0                                              | 0                    | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 08.2025          | CHF                 | 2.649                 | €                             | 2.831                           | (10)                                           | (10)                 | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  | 09.2025          | \$                  | 2.156                 | MXN                           | 41.787                          | 33                                             | 33                   | 0,00    |   |         |   |       |
|                                  |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                | €                    | 6.787   | € | (4.192) | € | 2.595 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 | €                                              | 2.087                | 0,17    |   |         |   |       |
| Summe Anlagen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | €                                              | 1.643.235            | 135,52  |   |         |   |       |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                     |                       |                               |                                 | €                                              | (430.678)            | (35,52) |   |         |   |       |
| Nettovermögen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | €                                              | 1.212.557            | 100,00  |   |         |   |       |

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

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

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 321.357 EUR (31. Dezember 2024: 292.590 EUR) und Barmittel in Höhe von 286 EUR (31. Dezember 2024: 254 EUR) als Sicherheiten verpfändet.

(e) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 940 EUR (31. Dezember 2024: 788 EUR) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 15.690 EUR (31. Dezember 2024: 17.813 EUR) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert   |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                         | € 1.634.873                                                     | € 6.100                                                      | € 1.640.973 |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (1.609)                                                                     | 3.871                                                           | 0                                                            | 2.262       |
| Summen                        | € (1.609)                                                                   | € 1.638.744                                                     | € 6.100                                                      | € 1.643.235 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert   |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                         | € 1.589.074                                                     | € 0                                                          | € 1.589.074 |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (6.479)                                                                     | (1.433)                                                         | 0                                                            | (7.912)     |
| Summen                        | € (6.479)                                                                   | € 1.587.641                                                     | € 0                                                          | € 1.581.162 |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BRC                                | 1,400 %    | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (4.537)    | € (4.540)                                | (0,38)               |
|                                    | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (952)        | (953)                                    | (0,08)               |
|                                    | 1,960      | 11.06.2025       | 05.09.2025         | (51.652)     | (51.708)                                 | (4,26)               |
|                                    | 2,020      | 11.06.2025       | 05.09.2025         | (63.435)     | (63.506)                                 | (5,24)               |
|                                    | 2,040      | 11.06.2025       | 05.09.2025         | (44.492)     | (44.542)                                 | (3,67)               |
| MYI                                | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (271)        | (272)                                    | (0,02)               |
| SCX                                | 2,050      | 11.06.2025       | 11.07.2025         | (131.643)    | (131.793)                                | (10,87)              |
| SOG                                | 1,990      | 25.06.2025       | 05.09.2025         | (24.700)     | (24.709)                                 | (2,04)               |
|                                    | 2,040      | 20.06.2025       | 05.09.2025         | (4.745)      | (4.748)                                  | (0,39)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | € (326.771)                              | (26,95)              |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2024                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | € 49                             | € 0                                | € 49                            | € 23                             | € 0                                | € 23                            |
| BOA        | 1.399                            | (1.340)                            | 59                              | (114)                            | 0                                  | (114)                           |
| BPS        | 1.481                            | (1.150)                            | 331                             | (279)                            | 320                                | 41                              |
| BRC        | (223)                            | 87                                 | (136)                           | (84)                             | 0                                  | (84)                            |
| CBK        | 224                              | 0                                  | 224                             | (84)                             | (250)                              | (334)                           |
| DUB        | (31)                             | 0                                  | (31)                            | 139                              | 0                                  | 139                             |
| GLM        | (765)                            | 0                                  | (765)                           | (28)                             | 1                                  | (27)                            |
| GST        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (155)                            | 0                                  | (155)                           |
| JPM        | (262)                            | 323                                | 61                              | 204                              | 0                                  | 204                             |
| MBC        | (309)                            | 311                                | 2                               | 4                                | 0                                  | 4                               |
| MYC        | 319                              | (280)                              | 39                              | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| MYI        | (198)                            | 219                                | 21                              | (22)                             | 0                                  | (22)                            |
| RBC        | 4                                | 0                                  | 4                               | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| RYL        | 7                                | 0                                  | 7                               | (55)                             | 0                                  | (55)                            |
| SCX        | 373                              | (408)                              | (35)                            | (456)                            | 467                                | 11                              |
| SOG        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (18)                             | 0                                  | (18)                            |
| SSB        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (10)                             | 0                                  | (10)                            |
| UAG        | 19                               | 0                                  | 19                              | 50                               | 0                                  | 50                              |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 73,35             | 69,95             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 14,17             | 14,42             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,21              | 0,27              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,15              | 0,04              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,39              | 0,02              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 11,73             | 15,30             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                      | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                           | 3,43              | 5,09              |
| US-Regierungsbehörden                                      | 10,61             | 12,07             |
| US-Schatzobligationen                                      | 3,44              | 1,20              |
| Non-Agency-MBS                                             | 7,75              | 5,58              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                           | 14,20             | 12,51             |
| Staatsemissionen                                           | 95,91             | 97,21             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                   |                   |
| Futures                                                    | (0,15)            | (0,45)            |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                        |                   |                   |
| Zinsswaps                                                  | 0,16              | (0,14)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                 |                   |                   |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | 0,04              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | (0,08)            | (0,05)            |
| Devisenterminkontrakte                                     | 0,21              | (0,03)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                | (35,52)           | (32,99)           |
| Nettovermögen                                              | 100,00            | 100,00            |

Halbjahresbericht | 30. Juni 2025 449

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Hera SpA</b>                                    |                |                          |                                   | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                      |                |                          |                                   | <b>Silverstone Master Issuer PLC</b>                    |                |                          |                                   |
| 0,875 % fällig am 14.10.2026                       | € 300          | € 294                    | 0,08                              | AT&T, Inc.                                         | € 900          | € 878                    | 0,25                              | 4,748 % fällig am 21.01.2079                            | £ 1.300        | € 1.519                  | 0,42                              |
| 0,875 % fällig am 05.07.2027                       | 900            | 873                      | 0,24                              | 1,600 % fällig am 19.05.2028                       |                |                          |                                   | <b>Stratton BTL Mortgage Funding PLC</b>                |                |                          |                                   |
| <b>Holding d'Infrastructures de Transport SASU</b> |                |                          |                                   | British Telecommunications PLC                     | 1.300          | 1.278                    | 0,36                              | 5,028 % fällig am 20.01.2054                            | 298            | 348                      | 0,10                              |
| 0,625 % fällig am 14.09.2028                       | 900            | 840                      | 0,23                              | 1,500 % fällig am 23.06.2027                       | 600            | 604                      | 0,17                              | <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                    |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 04.05.2027                       | 700            | 698                      | 0,19                              | 2,750 % fällig am 30.08.2027                       |                |                          |                                   | 5,389 % fällig am 20.06.2060                            | 742            | 868                      | 0,24                              |
| <b>IMCD NV</b>                                     |                |                          |                                   | <b>E.ON International Finance BV</b>               |                |                          |                                   | <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                  |                |                          |                                   |
| 2,125 % fällig am 31.03.2027                       | 600            | 595                      | 0,17                              | 1,250 % fällig am 19.10.2027                       | 600            | 585                      | 0,16                              | 5,074 % fällig am 20.04.2051                            | 617            | 721                      | 0,20                              |
| <b>InterContinental Hotels Group PLC</b>           |                |                          |                                   | <b>Electricite de France S.A.</b>                  |                |                          |                                   | <b>Trinity Square PLC</b>                               |                |                          |                                   |
| 2,125 % fällig am 15.05.2027                       | 1.700          | 1.691                    | 0,47                              | 3,750 % fällig am 05.06.2028                       | 600            | 614                      | 0,17                              | 5,217 % fällig am 15.07.2059                            | 403            | 471                      | 0,13                              |
| <b>JDE Peet's NV</b>                               |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 12.01.2027                       | 600            | 611                      | 0,17                              | <b>Twin Bridges PLC</b>                                 |                |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am 09.02.2028                       | 1.881          | 1.784                    | 0,50                              | 4,125 % fällig am 25.03.2027                       | 600            | 617                      | 0,17                              | 5,417 % fällig am 15.05.2056                            | 211            | 248                      | 0,07                              |
| <b>Koninklijke Philips NV</b>                      |                |                          |                                   | <b>Enel Finance International NV</b>               |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
| 1,875 % fällig am 05.05.2027                       | 900            | 892                      | 0,25                              | 0,250 % fällig am 17.06.2027                       | 800            | 768                      | 0,21                              |                                                         |                |                          |                                   |
| <b>Kraft Heinz Foods Co.</b>                       |                |                          |                                   | 0,375 % fällig am 17.06.2027                       | 600            | 578                      | 0,16                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 25.05.2028                       | 1.100          | 1.088                    | 0,30                              | <b>Eurogrid GmbH</b>                               |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
| <b>LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE</b>         |                |                          |                                   | 3,075 % fällig am 18.10.2027                       | 800            | 810                      | 0,23                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                 |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 07.03.2029                       | 900            | 900                      | 0,25                              | <b>FLUVIUS System Operator C.V.</b>                |                |                          |                                   | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Mondelez International, Inc.</b>                |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 14.06.2028                       | 600            | 560                      | 0,16                              | <b>Asset-Backed European Securitisation Transaction</b> |                |                          |                                   |
| 0,250 % fällig am 17.03.2028                       | 900            | 848                      | 0,24                              | 1,750 % fällig am 04.12.2026                       | 300            | 297                      | 0,08                              | <b>Twenty-One BV</b>                                    |                |                          |                                   |
| 1,625 % fällig am 08.03.2027                       | 700            | 691                      | 0,19                              | <b>National Grid North America, Inc.</b>           |                |                          |                                   | 2,576 % fällig am 21.09.2031                            | € 120          | 120                      | 0,03                              |
| <b>Moody's Corp.</b>                               |                |                          |                                   | 4,151 % fällig am 12.09.2027                       | 600            | 620                      | 0,17                              | <b>Asset-Backed European Securitisation Transaction</b> |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 09.03.2027                       | 700            | 693                      | 0,19                              | <b>National Grid PLC</b>                           |                |                          |                                   | <b>Twenty-Three SARL</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>Motability Operations Group PLC</b>             |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 01.09.2028                       | 900            | 835                      | 0,23                              | 2,506 % fällig am 21.03.2034                            | 425            | 426                      | 0,12                              |
| 0,125 % fällig am 20.07.2028                       | 900            | 836                      | 0,23                              | <b>Orsted A/S</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Auto ABS French Loans</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>National Grid Electricity Transmission PLC</b>  |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 01.03.2026                       | 700            | 705                      | 0,20                              | 2,421 % fällig am 24.07.2036                            | 549            | 550                      | 0,15                              |
| 4,000 % fällig am 08.06.2027                       | £ 500          | 579                      | 0,16                              | <b>RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR</b> |                |                          |                                   | <b>Auto ABS Italian Stella Loans SRL</b>                |                |                          |                                   |
| <b>Netflix, Inc.</b>                               |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 09.09.2027 (b)                   | 800            | 759                      | 0,21                              | 2,659 % fällig am 29.12.2036                            | 1.475          | 1.479                    | 0,41                              |
| 3,625 % fällig am 15.05.2027                       | € 1.500        | 1.533                    | 0,43                              |                                                    |                |                          |                                   | <b>Auto1 Car Funding SARL</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Novo Nordisk Finance Netherlands BV</b>         |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   | 2,592 % fällig am 15.12.2033                            | 386            | 387                      | 0,11                              |
| 2,340 % fällig am 27.05.2027                       | 500            | 501                      | 0,14                              | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel             |                | 11.119                   | 3,10                              | <b>Autonoria Spain</b>                                  |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 27.05.2028                       | 400            | 400                      | 0,11                              |                                                    |                | 218.220                  | 60,83                             | 2,530 % fällig am 30.04.2043                            | 1.500          | 1.502                    | 0,42                              |
| <b>Rentokil Initial Finance BV</b>                 |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                              |                |                          |                                   | 2,589 % fällig am 30.09.2041                            | 677            | 678                      | 0,19                              |
| 3,875 % fällig am 27.06.2027                       | 800            | 821                      | 0,23                              | <b>Atlas Funding PLC</b>                           |                |                          |                                   | <b>Bavarian Sky S.A.</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>REWE International Finance BV</b>               |                |                          |                                   | 5,074 % fällig am 20.09.2061                       | £ 424          | 496                      | 0,14                              | 0,000 % fällig am 20.08.2032 (a)                        | 1.800          | 1.800                    | 0,50                              |
| 2,750 % fällig am 03.07.2028 (a)                   | 1.000          | 1.001                    | 0,28                              | <b>Barley Hill PLC</b>                             |                |                          |                                   | 2,327 % fällig am 20.03.2032                            | 534            | 534                      | 0,15                              |
| <b>Robert Bosch Finance LLC</b>                    |                |                          |                                   | 5,144 % fällig am 27.08.2058                       | 21             | 24                       | 0,01                              | 2,367 % fällig am 21.02.2033                            | 800            | 800                      | 0,22                              |
| 2,489 % fällig am 28.11.2026                       | 900            | 901                      | 0,25                              | <b>Bowbell Master Issuer PLC</b>                   |                |                          |                                   | 2,457 % fällig am 20.05.2033                            | 900            | 901                      | 0,25                              |
| <b>Robert Bosch GmbH</b>                           |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 23.07.2071                       | 1.300          | 1.519                    | 0,42                              | <b>Bavarian Sky UK PLC</b>                              |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 02.06.2027                       | 700            | 716                      | 0,20                              | <b>Braccan Mortgage Funding PLC</b>                |                |                          |                                   | 4,844 % fällig am 20.04.2031                            | £ 154          | 180                      | 0,05                              |
| <b>Sage Group PLC</b>                              |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 17.05.2067                       | 800            | 938                      | 0,26                              | <b>BBVA Consumer Auto</b>                               |                |                          |                                   |
| 3,820 % fällig am 15.02.2028                       | 1.500          | 1.543                    | 0,43                              | <b>Cheshire PLC</b>                                |                |                          |                                   | 2,723 % fällig am 19.03.2038                            | € 688          | 691                      | 0,19                              |
| <b>Sartorius Finance BV</b>                        |                |                          |                                   | 5,137 % fällig am 20.08.2045                       | 436            | 509                      | 0,14                              | <b>Bumper NL BV</b>                                     |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 14.09.2026                       | 800            | 816                      | 0,23                              | <b>Curzon Mortgages PLC</b>                        |                |                          |                                   | 2,539 % fällig am 21.03.2036                            | 1.500          | 1.502                    | 0,42                              |
| <b>Siemens Financieringsmaatschappij NV</b>        |                |                          |                                   | 5,482 % fällig am 28.07.2049                       | 1.117          | 1.308                    | 0,37                              | <b>Cars Alliance Auto Loans France</b>                  |                |                          |                                   |
| 2,340 % fällig am 27.05.2027                       | 900            | 901                      | 0,25                              | <b>Dilosk RMBS DAC</b>                             |                |                          |                                   | 2,499 % fällig am 23.10.2034                            | 700            | 701                      | 0,20                              |
| <b>Sika Capital BV</b>                             |                |                          |                                   | 2,786 % fällig am 24.09.2060                       | € 264          | 264                      | 0,07                              | <b>Cars Alliance Auto Loans Germany</b>                 |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 03.11.2026                       | 800            | 814                      | 0,23                              | 3,106 % fällig am 20.07.2061                       | 617            | 619                      | 0,17                              | 2,421 % fällig am 18.03.2035                            | 498            | 499                      | 0,14                              |
| <b>Smurfit Kappa Treasury ULC</b>                  |                |                          |                                   | <b>Domi BV</b>                                     |                |                          |                                   | 2,431 % fällig am 18.01.2036                            | 934            | 935                      | 0,26                              |
| 1,500 % fällig am 15.09.2027                       | 1.400          | 1.373                    | 0,38                              | 3,023 % fällig am 15.11.2052                       | 623            | 623                      | 0,17                              | 2,531 % fällig am 20.07.2037                            | 800            | 802                      | 0,22                              |
| <b>Stryker Corp.</b>                               |                |                          |                                   | <b>Dutch Property Finance BV</b>                   |                |                          |                                   | <b>Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC</b>         |                |                          |                                   |
| 2,125 % fällig am 30.11.2027                       | 600            | 596                      | 0,17                              | 2,861 % fällig am 28.04.2059                       | 433            | 434                      | 0,12                              | 2,742 % fällig am 15.12.2032                            | 174            | 175                      | 0,05                              |
| <b>Suez SACA</b>                                   |                |                          |                                   | 2,911 % fällig am 28.10.2059                       | 970            | 971                      | 0,27                              | <b>Compartment Private Driver UK</b>                    |                |                          |                                   |
| 1,875 % fällig am 24.05.2027                       | 1.600          | 1.580                    | 0,44                              | <b>Economic Master Issuer PLC</b>                  |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.04.2031                            | £ 689          | 806                      | 0,23                              |
| <b>Toyota Finance Australia Ltd.</b>               |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 25.04.2075 (a)                   | £ 1.500        | 1.752                    | 0,49                              | <b>Compartment VCL</b>                                  |                |                          |                                   |
| 2,280 % fällig am 21.10.2027                       | 700            | 698                      | 0,19                              | <b>Elstree Funding</b>                             |                |                          |                                   | 2,359 % fällig am 21.12.2029                            | € 449          | 449                      | 0,13                              |
| <b>Toyota Motor Finance Netherlands BV</b>         |                |                          |                                   | 4,943 % fällig am 21.01.2065                       | 489            | 572                      | 0,16                              | 2,389 % fällig am 22.07.2030                            | 566            | 567                      | 0,16                              |
| 3,125 % fällig am 21.04.2028                       | 1.100          | 1.119                    | 0,31                              | <b>Eurosail PLC</b>                                |                |                          |                                   | 2,431 % fällig am 21.04.2031                            | 1.700          | 1.701                    | 0,47                              |
| <b>Universal Music Group NV</b>                    |                |                          |                                   | 5,308 % fällig am 13.06.2045                       | 304            | 355                      | 0,10                              | <b>E-Carat DE</b>                                       |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 30.06.2027                       | 600            | 606                      | 0,17                              | <b>Holmes Master Issuer PLC</b>                    |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 25.05.2034                            | 1.500          | 1.502                    | 0,42                              |
| <b>Veolia Environnement S.A.</b>                   |                |                          |                                   | 4,847 % fällig am 15.10.2072                       | 700            | 818                      | 0,23                              | 2,321 % fällig am 25.11.2035                            | 600            | 600                      | 0,17                              |
| 1,590 % fällig am 10.01.2028                       | 900            | 883                      | 0,25                              | <b>Kinbane DAC</b>                                 |                |                          |                                   | <b>FACT S.A.</b>                                        |                |                          |                                   |
| <b>Volkswagen International Finance NV</b>         |                |                          |                                   | 2,739 % fällig am 25.09.2062                       | € 868          | 880                      | 0,25                              | 2,547 % fällig am 22.09.2031                            | 564            | 565                      | 0,16                              |
| 1,875 % fällig am 30.03.2027                       | 600            | 593                      | 0,17                              | <b>Lanark Master Issuer PLC</b>                    |                |                          |                                   | <b>FCT Autonoria DE</b>                                 |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.02.2028                       | 700            | 726                      | 0,20                              | 4,707 % fällig am 22.12.2069                       | £ 500          | 584                      | 0,16                              | 2,359 % fällig am 26.01.2043                            | 362            | 362                      | 0,10                              |
| <b>Werfen S.A.</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Lanebrook Mortgage Transaction PLC</b>          |                |                          |                                   | <b>FCT CA Leasing</b>                                   |                |                          |                                   |
| 0,500 % fällig am 28.10.2026                       | 700            | 681                      | 0,19                              | 5,039 % fällig am 15.03.2061                       | 581            | 680                      | 0,19                              | 2,794 % fällig am 26.02.2042                            | 90             | 90                       | 0,03                              |
| <b>Worley U.S. Finance Sub Ltd.</b>                |                |                          |                                   | <b>Mansard Mortgages PLC</b>                       |                |                          |                                   | <b>FTA Santander Consumer Spain Auto</b>                |                |                          |                                   |
| 0,875 % fällig am 09.06.2026                       | 700            | 689                      | 0,19                              | 5,008 % fällig am 15.12.2049                       | 283            | 328                      | 0,09                              | 2,886 % fällig am 22.09.2039                            | 852            | 857                      | 0,24                              |
| <b>Zimmer Biomet Holdings, Inc.</b>                |                |                          |                                   | <b>Mortimer BTL PLC</b>                            |                |                          |                                   | <b>Ginkgo Auto Loans</b>                                |                |                          |                                   |
| 1,164 % fällig am 15.11.2027                       | 1.400          | 1.354                    | 0,38                              | 5,409 % fällig am 22.12.2056                       | 295            | 346                      | 0,10                              | 2,788 % fällig am 25.07.2043                            | 222            | 223                      | 0,06                              |
|                                                    |                | 52.879                   | 14,74                             | <b>Precise Mortgage Funding PLC</b>                |                |                          |                                   | <b>Globaldrive Auto Receivables BV</b>                  |                |                          |                                   |
|                                                    |                |                          |                                   | 5,203 % fällig am 16.07.2060                       | 488            | 572                      | 0,16                              | 2,327 % fällig am 22.06.2032                            | 428            | 428                      | 0,12                              |
|                                                    |                |                          |                                   | <b>Rochester Financing PLC</b>                     |                |                          |                                   | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>                    |                |                          |                                   |
|                                                    |                |                          |                                   | 4,939 % fällig am 18.12.2044                       | 428            | 499                      | 0,14                              | 2,747 % fällig am 20.12.2044                            | 1.500          | 1.503                    | 0,42                              |
|                                                    |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   | <b>Hill FL BV</b>                                       |                |                          |                                   |
|                                                    |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   | 2,641 % fällig am 18.02.2032                            | 2.029          | 2.031                    | 0,57                              |

## PENSIONSGESCHÄFTE

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month EURIBOR December Futures     | Short | 12.2025     | 1.173                | € (320)                                  | (0,09)               |
| 3-Month EURIBOR September Futures    | Short | 09.2025     | 104                  | 22                                       | 0,01                 |
| 3-Month EURIBOR September Futures    | Long  | 09.2026     | 104                  | (3)                                      | (0,01)               |
| 3-Month SONIA Index December Futures | Long  | 03.2028     | 178                  | 21                                       | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures          | Short | 09.2025     | 88                   | 43                                       | 0,01                 |
| Euro-Schatz September Futures        | Short | 09.2025     | 1                    | 0                                        | 0,00                 |
|                                      |       |             |                      | € (237)                                  | (0,07)               |

### OPTIONSKAUF

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|--------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,938      | 15.12.2025    | 75                   | € 36   | € 3       | 0,00                 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|---------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,813      | 12.12.2025    | 75                   | € (48)  | € (12)    | 0,00                 |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

€ (246) (0,07)

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|----------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                           | 3,650 %       | 04.12.2025    | 39.900                    | € 79   | € 109     | 0,03                 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-SONIA       | Erhalt                            | 3,150 %       | 04.12.2025    | 39.900                    | € (26)  | € (30)    | (0,01)               |

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

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | € 47                | CHF 44                | € 0                           | € 0                           | € 0                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 7.721            | € 6.790               | 213                           | 0                             | 213                                           | 0,06                 |
| BPS        | 07.2025          | DKK 13.835          | 1.855                 | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | € 18.750            | £ 15.982              | 0                             | (92)                          | (92)                                          | (0,03)               |
|            | 07.2025          | £ 13.912            | € 16.563              | 322                           | 0                             | 322                                           | 0,09                 |
|            | 08.2025          | 16.015              | 18.750                | 92                            | 0                             | 92                                            | 0,03                 |
|            | 04.2026          | DKK 14.515          | 1.953                 | 2                             | 0                             | 2                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | £ 1.868             | 2.187                 | 6                             | 0                             | 6                                             | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | \$ 10               | CAD 14                | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 6.790             | \$ 7.877              | 0                             | (80)                          | (80)                                          | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$ 7.877            | € 6.775               | 79                            | 0                             | 79                                            | 0,02                 |
| GLM        | 07.2025          | DKK 143             | 19                    | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | 9.404               | 1.261                 | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | € 22                | CHF 21                | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 01.2026          | DKK 10.995          | € 1.476               | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 04.2026          | 17.544              | 2.358                 | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,00                 |
| RYL        | 07.2025          | 900                 | 121                   | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | AUD 3.812           | 2.164                 | 36                            | 0                             | 36                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          | € 2.125             | AUD 3.812             | 3                             | 0                             | 3                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD 3.812           | € 2.122               | 0                             | (3)                           | (3)                                           | 0,00                 |



| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung |    | Zu erhaltende Währung |    | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|----|-----------------------|----|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| UAG                              | 07.2025          | CHF                 | 57 | €                     | 60 | € 0                           | € 0                             | € 0                                           | € 0,00               |
|                                  | 08.2025          | €                   | 60 | CHF                   | 57 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|                                  |                  |                     |    |                       |    | € 756                         | € (175)                         | € 581                                         | 0,16                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |    |                       |    |                               |                                 | € 660                                         | 0,18                 |
| Summe Anlagen                    |                  |                     |    |                       |    |                               |                                 | € 358.670                                     | 99,98                |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                     |    |                       |    |                               |                                 | € 74                                          | 0,02                 |
| Nettovermögen                    |                  |                     |    |                       |    |                               |                                 | € 358.744                                     | 100,00               |

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

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

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.  
 (b) Nullkuponwertpapier.  
 (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

Barmittel in Höhe von 877 EUR (31. Dezember 2024: 920 EUR) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                         | € 323.356                                                       | € 900                                                        | € 324.256 |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 34.000                                                          | 0                                                            | 34.000    |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (246)                                                                       | 660                                                             | 0                                                            | 414       |
| Summen                        | € (246)                                                                     | € 358.016                                                       | € 900                                                        | € 358.670 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | € 0                                                                         | € 256.728                                                       | € 0                                                          | € 256.728 |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 24.500                                                          | 0                                                            | 24.500    |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (230)                                                                       | (94)                                                            | 0                                                            | (324)     |
| Summen                        | € (230)                                                                     | € 281.134                                                       | € 0                                                          | € 280.904 |

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

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

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

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| BOA        | € 213                               | € 0                                   | € 213                           | € k. A.                             | € k. A.                               | € k. A.                         |
| BPS        | 325                                 | (260)                                 | 65                              | (3)                                 | 0                                     | (3)                             |
| BRC        | 6                                   | 0                                     | 6                               | 3                                   | 0                                     | 3                               |
| DUB        | (1)                                 | 0                                     | (1)                             | 57                                  | 0                                     | 57                              |
| JPM        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | 77                                  | 0                                     | 77                              |
| MBC        | 2                                   | 0                                     | 2                               | (171)                               | 0                                     | (171)                           |
| MYC        | 79                                  | 0                                     | 79                              | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | 50                                  | 0                                     | 50                              |
| SCX        | 36                                  | 0                                     | 36                              | (101)                               | 0                                     | (101)                           |
| UAG        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (6)                                 | 0                                     | (6)                             |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 79,60             | 65,17             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 9,20              | 23,83             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,12              | 0,23              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 9,32              | 8,52              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,02              | 0,01              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,24              | 0,08              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 1,50              | 2,16              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                      | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                           | 60,83             | 52,35             |
| Non-Agency-MBS                                             | 5,37              | 5,15              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                           | 18,47             | 21,28             |
| Staatsemissionen                                           | 1,21              | 0,52              |
| Kurzfristige Instrumente                                   | 4,51              | 17,26             |
| Pensionsgeschäfte                                          | 9,48              | 9,22              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                   |                   |
| Futures                                                    | (0,07)            | (0,09)            |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                 |                   |                   |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | 0,03              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | (0,01)            | k. A.             |
| Devisenterminkontrakte                                     | 0,16              | (0,04)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                | 0,02              | (5,65)            |
| Nettovermögen                                              | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG<br>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÖSTERREICH</b>                              |                |                          |                                   | Atos SE                                 |                |                          |                                   | Bayer AG                                             |                |                          |                                   |
| <b>WANDELANLEIHEN &amp; WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | 9,000 % fällig am 18.12.2029            | € 1.700        | € 1.903                  | 0,41                              | 7,000 % fällig am 25.09.2083                         | € 5.100        | € 5.496                  | 1,17                              |
| ams-OSRAM AG                                   |                |                          |                                   | Bertrand Franchise Finance S.A.S.       | 400            | 394                      | 0,08                              | C-TEC GmbH                                           |                |                          |                                   |
| 2,125 % fällig am 03.11.2027                   | € 2.200        | € 2.076                  | 0,44                              | 5,986 % fällig am 18.07.2030            | 300            | 305                      | 0,06                              | 5,250 % fällig am 15.02.2030                         | 100            | 86                       | 0,02                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 18.07.2030            |                |                          |                                   | Cheplapharm Arzneimittel GmbH                        |                |                          |                                   |
| ams-OSRAM AG                                   |                |                          |                                   | CAB SELAS                               | 4.700          | 4.478                    | 0,96                              | 3,500 % fällig am 11.02.2027                         | 1.700          | 1.706                    | 0,36                              |
| 10,500 % fällig am 30.03.2029                  | 1.200          | 1.259                    | 0,27                              | 3,375 % fällig am 01.02.2028            |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.01.2028                         | 600            | 594                      | 0,13                              |
| Benteler International AG                      |                |                          |                                   | CMA CGM S.A.                            | 800            | 800                      | 0,17                              | 5,500 % fällig am 15.01.2028                         | \$ 300         | 247                      | 0,05                              |
| 7,250 % fällig am 15.06.2031 (a)               | 500            | 517                      | 0,11                              | 5,000 % fällig am 15.01.2031            | 600            | 621                      | 0,13                              | 7,125 % fällig am 15.06.2031 (a)                     | € 2.400        | 2.419                    | 0,52                              |
| Erste Group Bank AG                            |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.07.2029            |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 15.05.2030                         | 550            | 562                      | 0,12                              |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027 (e)(g)            | 600            | 591                      | 0,13                              | Electricite de France S.A.              | 700            | 706                      | 0,15                              | Clearstream Banking AG                               |                |                          |                                   |
|                                                |                | 2.367                    | 0,51                              | 5,000 % fällig am 22.01.2026 (e)        | £ 4.200        | 4.810                    | 1,03                              | 0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)                     | 100            | 99                       | 0,02                              |
| Summe Österreich                               |                | 4.443                    | 0,95                              | 5,875 % fällig am 22.01.2029 (e)        | 2.500          | 2.922                    | 0,62                              | Commerzbank AG                                       |                |                          |                                   |
| <b>BELGIEN</b>                                 |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 29.01.2026 (e)        | € 1.400        | 1.543                    | 0,33                              | 6,125 % fällig am 09.10.2025 (e)(g)                  | 2.200          | 2.219                    | 0,47                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 06.09.2028 (e)        | \$ 1.300       | 1.252                    | 0,27                              | Deutsche Bank AG                                     |                |                          |                                   |
| Azelis Finance NV                              |                |                          |                                   | 9,125 % fällig am 15.03.2033 (e)        |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 19.05.2031                         | 1.900          | 1.933                    | 0,41                              |
| 4,750 % fällig am 25.09.2029                   | 1.600          | 1.645                    | 0,35                              | ELO SACA                                | € 3.700        | 3.545                    | 0,76                              | Deutsche EuroShop AG                                 |                |                          |                                   |
| KBC Group NV                                   |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 17.04.2028            | 2.400          | 2.241                    | 0,48                              | 4,500 % fällig am 15.10.2030                         | 400            | 400                      | 0,09                              |
| 8,000 % fällig am 05.09.2028 (e)(g)            | 800            | 888                      | 0,19                              | 6,000 % fällig am 22.03.2029 (i)        |                |                          |                                   | DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH |                |                          |                                   |
| Manuchar Group SARL                            |                |                          |                                   | Eramet S.A.                             | 1.700          | 1.697                    | 0,36                              | 4,875 % fällig am 21.08.2030                         | 2.200          | 2.237                    | 0,48                              |
| 6,943 % fällig am 07.07.2032 (a)               | 2.800          | 2.744                    | 0,59                              | 6,500 % fällig am 30.11.2029            | 1.800          | 1.836                    | 0,39                              | Gruenthal GmbH                                       |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 30.06.2027                   | 4.000          | 4.079                    | 0,87                              | 7,000 % fällig am 22.05.2028            |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.05.2028                         | 1.200          | 1.205                    | 0,26                              |
| Sarens Finance Co. NV                          |                |                          |                                   | Forvia SE                               | 1.400          | 1.364                    | 0,29                              | Hornbach Baumarkt AG                                 |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 21.02.2027                   | 578            | 579                      | 0,12                              | 2,375 % fällig am 15.06.2027            | 1.000          | 986                      | 0,21                              | 3,250 % fällig am 25.10.2026                         | 800            | 803                      | 0,17                              |
| Summe Belgien                                  |                | 9.935                    | 2,12                              | 2,750 % fällig am 15.02.2027            | 1.800          | 1.805                    | 0,39                              | HT Troplast GmbH                                     |                |                          |                                   |
| <b>KAIMANINSELN</b>                            |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.06.2030            |                |                          |                                   | 9,375 % fällig am 15.07.2028                         | 300            | 317                      | 0,07                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | Getlink SE                              | 500            | 511                      | 0,11                              | IHO Verwaltungs GmbH (6,750 % bar oder 7,500 % PIK)  |                |                          |                                   |
| Health & Happiness International Holdings Ltd. |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.04.2030            |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.11.2029 (b)                     | 5.200          | 5.446                    | 1,16                              |
| 9,125 % fällig am 24.07.2028                   | \$ 500         | 435                      | 0,09                              | Iliad Holding SASU                      | 400            | 408                      | 0,09                              | IHO Verwaltungs GmbH (8,750 % bar oder 9,500 % PIK)  |                |                          |                                   |
| IHS Holding Ltd.                               |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.10.2028            |                |                          |                                   | 8,750 % fällig am 15.05.2028 (b)                     | 1.000          | 1.048                    | 0,22                              |
| 8,250 % fällig am 29.11.2031                   | 1.000          | 862                      | 0,19                              | Iliad S.A.                              | 400            | 400                      | 0,09                              | INEOS Styrolution Ludwigshafen GmbH                  |                |                          |                                   |
| Summe Kaimaninseln                             |                | 1.297                    | 0,28                              | 2,375 % fällig am 17.06.2026            | 2.500          | 2.535                    | 0,54                              | 2,250 % fällig am 16.01.2027                         | 800            | 778                      | 0,17                              |
| <b>CHINA</b>                                   |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.12.2029            | 600            | 624                      | 0,13                              | Mahle GmbH                                           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 14.06.2027            | 600            | 636                      | 0,14                              | 2,375 % fällig am 14.05.2028                         | 1.600          | 1.523                    | 0,33                              |
| Yango Justice International Ltd.               |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 02.05.2031            |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 02.05.2031                         | 2.100          | 2.139                    | 0,46                              |
| 8,250 % fällig am 25.11.2023 ^                 | 300            | 0                        | 0,00                              | Loxam S.A.S.                            | 400            | 405                      | 0,09                              | Motel One GmbH                                       |                |                          |                                   |
| <b>ZYPERN</b>                                  |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.02.2027            | 2.100          | 2.172                    | 0,46                              | 7,750 % fällig am 02.04.2031                         | 300            | 323                      | 0,07                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 15.05.2028            | 900            | 941                      | 0,20                              | Nidda Healthcare Holding GmbH                        |                |                          |                                   |
| Atrium Finance PLC                             |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 31.05.2029            |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 21.02.2030                         | 600            | 613                      | 0,13                              |
| 2,625 % fällig am 05.09.2027                   | € 1.450        | 1.335                    | 0,29                              | New Immo Holding S.A.                   | 1.400          | 1.381                    | 0,30                              | PrestigeBidCo GmbH                                   |                |                          |                                   |
| <b>TSSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                  |                |                          |                                   | Nexans S.A.                             | 600            | 616                      | 0,13                              | 6,029 % fällig am 01.07.2029                         | 400            | 403                      | 0,09                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 29.05.2029            |                |                          |                                   | Schaeffler AG                                        |                |                          |                                   |
| EP Infrastructure A/S                          |                |                          |                                   | Opal Bidco S.A.S.                       | 2.000          | 2.045                    | 0,44                              | 3,375 % fällig am 12.10.2028                         | 1.600          | 1.577                    | 0,34                              |
| 1,698 % fällig am 30.07.2026                   | 4.200          | 4.154                    | 0,89                              | 5,500 % fällig am 31.03.2032            |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 14.08.2026                         | 400            | 406                      | 0,09                              |
| <b>DÄNEMARK</b>                                |                |                          |                                   | RCI Banque S.A.                         | 1.600          | 1.615                    | 0,35                              | 5,375 % fällig am 01.04.2031                         | 800            | 819                      | 0,17                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | Renault S.A.                            | 300            | 298                      | 0,06                              | TK Elevator Midco GmbH                               |                |                          |                                   |
| TDC Net A/S                                    |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 28.11.2025            | 300            | 297                      | 0,06                              | 4,375 % fällig am 15.07.2027                         | 3.700          | 3.704                    | 0,79                              |
| 5,000 % fällig am 09.08.2032                   | 2.400          | 2.457                    | 0,53                              | 2,000 % fällig am 28.09.2026            | 300            | 299                      | 0,06                              | ZF Finance GmbH                                      |                |                          |                                   |
| <b>FINNLAND</b>                                |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 25.05.2026            |                |                          |                                   | 2,250 % fällig am 03.05.2028                         | 800            | 727                      | 0,16                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | Tereos Finance Groupe S.A.              | 1.000          | 1.008                    | 0,22                              |                                                      |                | 40.645                   | 8,69                              |
| Ahlstrom Holding Oy                            |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 30.04.2027            |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>            |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 04.02.2028                   | 1.000          | 983                      | 0,21                              | Ubisoft Entertainment S.A.              | 3.900          | 3.520                    | 0,75                              | CeramTec Acquico GmbH                                |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 04.02.2028                   | \$ 2.300       | 1.871                    | 0,40                              | 0,878 % fällig am 24.11.2027            |                |                          |                                   | 5,761 % fällig am 16.03.2029                         | 1.000          | 969                      | 0,21                              |
| Huhtamaki Oyj                                  |                |                          |                                   | Valeo SE                                | 800            | 790                      | 0,17                              | TK Elevator Midco GmbH                               |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 09.06.2027                   | € 700          | 717                      | 0,15                              | 1,625 % fällig am 18.03.2026            | 1.600          | 1.594                    | 0,34                              | 5,848 % fällig am 30.04.2030                         | 500            | 500                      | 0,11                              |
| Summe Finnland                                 |                | 3.571                    | 0,76                              | 4,500 % fällig am 11.04.2030            | 500            | 503                      | 0,11                              |                                                      |                | 1.469                    | 0,32                              |
| <b>FRANKREICH</b>                              |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 20.05.2031            |                |                          |                                   | Summe Deutschland                                    |                | 42.114                   | 9,01                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | Viridien                                | 500            | 497                      | 0,11                              | <b>GRIECHENLAND</b>                                  |                |                          |                                   |
| Altice France S.A.                             |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 15.10.2030            | \$ 1.100       | 923                      | 0,20                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 15.01.2029                   | 400            | 338                      | 0,07                              | 10,000 % fällig am 15.10.2030           |                |                          |                                   | Piraeus Bank S.A.                                    |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029                   | 1.400          | 1.178                    | 0,25                              | Worldline S.A.                          | € 600          | 527                      | 0,11                              | 3,875 % fällig am 03.11.2027                         | 700            | 713                      | 0,15                              |
| 5,875 % fällig am 01.02.2027                   | 100            | 90                       | 0,02                              | 5,500 % fällig am 10.06.2030            |                | 59.359                   | 12,69                             | <b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>      |                |                          |                                   | <b>DEUTSCHLAND</b>                      |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Altice France S.A.                             |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | Globalworth Real Estate Investments Ltd.             |                |                          |                                   |
| 9,756 % fällig am 15.08.2028                   | \$ 100         | 77                       | 0,02                              | Alstria Office AG                       |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 31.03.2030                         | 568            | 578                      | 0,12                              |
| Summe Frankreich                               |                | 59.436                   | 12,71                             | 5,500 % fällig am 20.03.2031            | € 800          | 816                      | 0,17                              | <b>HONGKONG</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                             |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | Fortune Star BVI Ltd.                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 02.10.2026                         | 2.800          | 2.716                    | 0,58                              |

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

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>IRLAND</b>                           |                |                          |                                   | <b>IRLAND</b>                           |                |                          |                                   | <b>IRLAND</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |
| Bank of Ireland Group PLC               |                |                          |                                   | UniCredit SpA                           | € 900          | € 952                    | 0,20                              | Motion Finco SARL                          | € 1.800        | € 1.693                  | 0,36                              |
| 6,375 % fällig am                       |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 16.04.2034            | \$ 400         | 361                      | 0,08                              | 7,375 % fällig am 15.06.2030               |                |                          |                                   |
| 10.03.2030 (e)(g)                       | € 800          | € 820                    | 0,18                              | 7,296 % fällig am 02.04.2034            |                |                          |                                   | Rossini SARL                               | 700            | 740                      | 0,16                              |
| 6,750 % fällig am 01.03.2033            | 200            | 216                      | 0,05                              | Webuild SpA                             | € 306          | 309                      | 0,07                              | 6,750 % fällig am 31.12.2029               |                |                          |                                   |
| 7,594 % fällig am 06.12.2032            | € 600          | 735                      | 0,16                              | 3,875 % fällig am 28.07.2026            |                |                          |                                   | Trafigura Funding S.A.                     | 2.100          | 2.104                    | 0,45                              |
| eircom Finance DAC                      |                |                          |                                   |                                         |                | 23.572                   | 5,04                              | 3,875 % fällig am 02.02.2026               |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 15.02.2027            | € 1.000        | 987                      | 0,21                              | Summe Italien                           |                | 24.364                   | 5,21                              |                                            |                | 38.773                   | 8,29                              |
| 3,500 % fällig am 15.05.2026            | 290            | 290                      | 0,06                              | <b>JAPAN</b>                            |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>  |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 30.04.2031            | 700            | 706                      | 0,15                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | Albion Financing SARL                      | 650            | 649                      | 0,14                              |
| Motion Bondco DAC                       |                |                          |                                   | SoftBank Group Corp.                    |                |                          |                                   | 5,236 % fällig am 16.08.2029               |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 15.11.2027            | \$ 1.100       | 885                      | 0,19                              | 2,875 % fällig am 06.01.2027            | 1.300          | 1.283                    | 0,27                              | Summe Luxemburg                            |                | 39.422                   | 8,43                              |
| Permanent TSB Group Holdings PLC        |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 06.07.2029            | 300            | 284                      | 0,06                              | <b>MULTINATIONAL</b>                       |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 19.08.2031            | € 2.500        | 2.489                    | 0,53                              | 4,000 % fällig am 19.09.2029            | 600            | 584                      | 0,13                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |
| Quercus Re DAC                          |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.04.2028            | 2.400          | 2.447                    | 0,52                              | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC     |                |                          |                                   |
| 10,176 % fällig am 06.01.2031           | 250            | 257                      | 0,05                              | 5,750 % fällig am 08.07.2032            | 1.100          | 1.100                    | 0,24                              | 2,000 % fällig am 01.09.2028               | 1.800          | 1.710                    | 0,37                              |
| Virgin Media Vendor Financing Notes DAC |                |                          |                                   | Summe Japan                             |                | 5.698                    | 1,22                              | <b>NIEDERLANDE</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 15.07.2028            | € 300          | 334                      | 0,07                              | <b>JERSEY, KANALINSELN</b>              |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |
| Summe Irland                            |                | 7.719                    | 1,65                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | ABN AMRO Bank NV                           |                |                          |                                   |
| <b>INSEL MAN</b>                        |                |                          |                                   | Aston Martin Capital Holdings Ltd.      | € 500          | 546                      | 0,12                              | 4,750 % fällig am                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | 10,375 % fällig am 31.03.2029           |                |                          |                                   | 22.09.2027 (e)(g)                          | 700            | 699                      | 0,15                              |
| Playtech PLC                            |                |                          |                                   | Avis Budget Finance PLC                 | € 2.400        | 2.445                    | 0,52                              | Boels Topholding BV                        |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 28.06.2028            | € 1.600        | 1.644                    | 0,35                              | 7,000 % fällig am 28.02.2029            |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.05.2030               | 500            | 520                      | 0,11                              |
| <b>ISRAEL</b>                           |                |                          |                                   | CPUK Finance Ltd.                       | € 200          | 228                      | 0,05                              | Citycon Treasury BV                        |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 28.08.2027            | 1.100          | 1.279                    | 0,27                              | 1,250 % fällig am 08.09.2026               | 608            | 594                      | 0,13                              |
| Energian Israel Finance Ltd.            |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 28.08.2026            |                |                          |                                   | Dufry One BV                               |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 30.03.2026            | \$ 800         | 675                      | 0,14                              | G City Europe Ltd.                      | € 1.300        | 1.049                    | 0,22                              | 4,500 % fällig am 23.05.2032               | 800            | 804                      | 0,17                              |
| 5,375 % fällig am 30.03.2028            | 2.000          | 1.627                    | 0,35                              | 3,625 % fällig am 04.08.2026 (e)        |                |                          |                                   | Flora Food Management BV                   |                |                          |                                   |
| Summe Israel                            |                | 2.302                    | 0,49                              | Kane Bidco Ltd.                         | 1.000          | 1.011                    | 0,22                              | 6,875 % fällig am 02.07.2029               | 2.600          | 2.644                    | 0,57                              |
| <b>ITALIEN</b>                          |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.02.2027            |                |                          |                                   | IGT Lottery Holdings BV                    |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |                |                          |                                   | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.  | 2.589          | 2.573                    | 0,55                              | 4,250 % fällig am 15.03.2030               | 2.400          | 2.449                    | 0,52                              |
| Golden Bar Securitisation SRL           | € 788          | 792                      | 0,17                              | 3,250 % fällig am 12.11.2025            |                | 9.131                    | 1,95                              | ING Groep NV                               |                |                          |                                   |
| 2,866 % fällig am 22.09.2043            |                |                          |                                   | Summe Jersey, Kanalinseln               |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am                          | \$ 700         | 555                      | 0,12                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | <b>LUXEMBURG</b>                        |                |                          |                                   | 16.05.2027 (e)(g)                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | IPD BV                                     |                |                          |                                   |
| Agrifarma SpA                           |                |                          |                                   | Albion Financing 1 SARL                 | 3.000          | 3.072                    | 0,66                              | 5,350 % fällig am 15.06.2031               | € 3.900        | 3.904                    | 0,84                              |
| 4,500 % fällig am 31.10.2028            | 400            | 401                      | 0,09                              | 5,375 % fällig am 21.05.2030            |                |                          |                                   | Nexus Newco BV                             |                |                          |                                   |
| Cerved Group SpA                        |                |                          |                                   | Aroundtown Finance SARL                 |                |                          |                                   | 8,479 % fällig am 04.06.2030               | 1.000          | 1.000                    | 0,21                              |
| 6,000 % fällig am 15.02.2029            | 1.700          | 1.650                    | 0,35                              | 7,125 % fällig am 16.01.2030 (e)        | 2.800          | 2.949                    | 0,63                              | Q-Park Holding BV                          |                |                          |                                   |
| doValue SpA                             |                |                          |                                   | 8,625 % fällig am 07.05.2029 (e)        | € 450          | 532                      | 0,11                              | 2,000 % fällig am 01.03.2027               | 1.100          | 1.080                    | 0,23                              |
| 7,000 % fällig am 28.02.2030            | 200            | 213                      | 0,04                              | Cidron Aida Finco SARL                  | € 2.500        | 2.561                    | 0,55                              | Sigma Holdco BV                            |                |                          |                                   |
| Fibercomp SpA                           |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 27.10.2031            |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.05.2026               | 465            | 464                      | 0,10                              |
| 1,625 % fällig am 18.01.2029            | 800            | 734                      | 0,16                              | Cirsa Finance International SARL        | 1.100          | 1.104                    | 0,24                              | Telefonica Europe BV                       |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 28.01.2026            | 800            | 800                      | 0,17                              | 4,500 % fällig am 15.03.2027            | 900            | 944                      | 0,20                              | 6,135 % fällig am 03.02.2030 (e)           | 3.500          | 3.755                    | 0,80                              |
| FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA     |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.03.2029            | 400            | 417                      | 0,09                              | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 01.08.2027            | 1.500          | 1.518                    | 0,32                              | 7,875 % fällig am 31.07.2028            |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 01.06.2031               | 4.400          | 4.419                    | 0,95                              |
| Flos B&B Italia SpA                     |                |                          |                                   | ContourGlobal Power Holdings S.A.       | 2.100          | 2.122                    | 0,45                              | 4,375 % fällig am 09.05.2030               | 5.100          | 5.208                    | 1,11                              |
| 10,000 % fällig am 15.11.2028           | 960            | 1.011                    | 0,22                              | 5,000 % fällig am 28.02.2030            |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 15.09.2029               | 761            | 865                      | 0,19                              |
| IMA Industria Macchine Automatiche SpA  |                |                          |                                   | CPI Property Group S.A.                 | € 1.200        | 1.337                    | 0,29                              | Trivium Packaging Finance BV               |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 15.01.2028            | 1.000          | 995                      | 0,21                              | 4,000 % fällig am 22.01.2028            | € 3.800        | 3.807                    | 0,81                              | 6,625 % fällig am 15.07.2030               | 1.900          | 1.968                    | 0,42                              |
| 6,029 % fällig am 15.04.2029            | 2.400          | 2.419                    | 0,52                              | 4,875 % fällig am 30.07.2025 (e)        | 300            | 297                      | 0,06                              | United Group BV                            |                |                          |                                   |
| Infrastrutture Wireless Italiane SpA    |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 18.08.2026 (e)        | 2.700          | 2.751                    | 0,59                              | 4,000 % fällig am 15.11.2027               | 668            | 667                      | 0,14                              |
| 1,875 % fällig am 08.07.2026            | 482            | 479                      | 0,10                              | 6,000 % fällig am 27.01.2032            |                |                          |                                   | VZ Secured Financing BV                    |                |                          |                                   |
| Intesa Sanpaolo SpA                     |                |                          |                                   | Cullinan Holdco SCSp                    | 400            | 346                      | 0,07                              | 3,500 % fällig am 15.01.2032               | 2.400          | 2.210                    | 0,47                              |
| 3,928 % fällig am 15.09.2026            | 700            | 710                      | 0,15                              | 4,625 % fällig am 15.10.2026            |                |                          |                                   | Wintershall Dea Finance BV                 |                |                          |                                   |
| Italmatch Chemicals SpA                 |                |                          |                                   | Ephios Subco SARL                       | 1.200          | 1.296                    | 0,28                              | 6,117 % fällig am 08.05.2030 (e)           | 2.600          | 2.659                    | 0,57                              |
| 7,480 % fällig am 06.02.2028            | 100            | 101                      | 0,02                              | 7,875 % fällig am 31.01.2031            |                |                          |                                   | ZF Europe Finance BV                       |                |                          |                                   |
| 10,000 % fällig am 06.02.2028           | 2.250          | 2.370                    | 0,51                              | Essendi S.A.                            | 1.200          | 1.226                    | 0,26                              | 7,000 % fällig am 12.06.2030               | 3.100          | 3.109                    | 0,66                              |
| Lottomatica Group SpA                   |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 15.05.2030            | 1.500          | 1.529                    | 0,33                              |                                            |                | 39.573                   | 8,46                              |
| 4,875 % fällig am 31.01.2031            | 1.200          | 1.232                    | 0,26                              | 6,375 % fällig am 15.10.2029            | 100            | 105                      | 0,02                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>  |                |                          |                                   |
| 5,246 % fällig am 01.06.2031            | 600            | 604                      | 0,13                              | LHMC Finco 2 SARL                       |                |                          |                                   | Nouryon Finance BV                         |                |                          |                                   |
| Mundys SpA                              |                |                          |                                   | 8,625 % fällig am 15.05.2030            | 500            | 521                      | 0,11                              | 5,736 % fällig am 03.04.2028               | 1.227          | 1.233                    | 0,27                              |
| 1,875 % fällig am 13.07.2027            | 800            | 787                      | 0,17                              | Loarre Investments SARL                 | 4.200          | 4.339                    | 0,93                              | Veon Amsterdam                             |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 24.01.2030            | 300            | 312                      | 0,07                              | 6,500 % fällig am 15.05.2029            |                |                          |                                   | 8,531 % - 10,750 % fällig am               | \$ 500         | 426                      | 0,09                              |
| TeamSystem SpA                          |                |                          |                                   | Luna 2 5SARL                            | 1.200          | 1.225                    | 0,26                              | 25.03.2027                                 |                | 1.659                    | 0,36                              |
| 5,000 % fällig am 01.07.2031 (a)        | 1.200          | 1.201                    | 0,26                              | 5,500 % fällig am 15.11.2031            |                |                          |                                   | Summe Niederlande                          |                | 41.232                   | 8,82                              |
| 5,194 % fällig am 01.07.2032 (a)        | 1.200          | 1.200                    | 0,26                              | 6,375 % fällig am 15.10.2029            |                |                          |                                   | <b>NORWEGEN</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,779 % fällig am 31.07.2031            | 2.400          | 2.407                    | 0,51                              | LHMC Finco 2 SARL                       |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |
| Telecom Italia SpA                      |                |                          |                                   | 8,625 % fällig am 15.05.2030            | 500            | 521                      | 0,11                              | Archer Norge A/S                           |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 12.10.2027            | 800            | 806                      | 0,17                              | Loarre Investments SARL                 | 4.200          | 4.339                    | 0,93                              | 9,500 % fällig am 25.02.2030               | 1.125          | 990                      | 0,21                              |
|                                         |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.05.2029            |                |                          |                                   |                                            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Luna 2 5SARL                            | 1.200          | 1.225                    | 0,26                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.07.2032 (a)        |                |                          |                                   |                                            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Matterhorn Telecom S.A.                 | 992            | 992                      | 0,21                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 15.09.2026            | 300            | 307                      | 0,07                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 30.01.2030            |                |                          |                                   |                                            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | Monitchem HoldCo S.A.                   | 450            | 457                      | 0,10                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   | 8,750 % fällig am 01.05.2028            |                |                          |                                   |                                            |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>BlueNord ASA</b>                              |                |                          |                                   | <b>Verve Group SE</b>                             |                |                          |                                   | <b>Pinnacle Bidco PLC</b>                   |                |                          |                                   |
| 12,000 % fällig am 10.07.2085 (a)                | \$ 1.800       | € 1.541                  | 0,33                              | 5,939 % fällig am 01.04.2029                      | € 1.100        | € 1.093                  | 0,23                              | 8,250 % fällig am 11.10.2028                | € 2.100        | € 2.207                  | 0,47                              |
| <b>Var Energi ASA</b>                            |                |                          |                                   |                                                   |                | 15.898                   | 3,40                              | 10,000 % fällig am 11.10.2028               | £ 1.100        | 1.361                    | 0,29                              |
| 7,862 % fällig am 15.11.2083                     | € 1.600        | 1.760                    | 0,38                              |                                                   |                |                          |                                   | <b>Travis Perkins PLC</b>                   |                |                          |                                   |
| Summe Norwegen                                   |                | 4.291                    | 0,92                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>         |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 17.02.2026                | 425            | 488                      | 0,10                              |
| <b>PANAMA</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Verisure Holding AB</b>                        |                |                          |                                   | <b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>     |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   | 4,980 % fällig am 27.03.2028                      | 5.300          | 5.310                    | 1,14                              | 4,250 % fällig am 15.01.2030                | 5.100          | 5.461                    | 1,17                              |
| <b>Carnival Corp.</b>                            |                |                          |                                   | Summe Schweden                                    |                | 21.208                   | 4,54                              | <b>Vmed O2 UK Financing PLC</b>             |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 15.01.2030                     | 400            | 427                      | 0,09                              | <b>SCHWEIZ</b>                                    |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 31.01.2029                | 3.400          | 3.699                    | 0,79                              |
| 7,000 % fällig am 15.08.2029                     | \$ 100         | 90                       | 0,02                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 31.01.2031                | \$ 800         | 625                      | 0,13                              |
| Summe Panama                                     |                | 517                      | 0,11                              | <b>UBS Group AG</b>                               |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.04.2032 (a)            | € 700          | 710                      | 0,15                              |
| <b>POLEN</b>                                     |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am                                 |                |                          |                                   | <b>Vodafone Group PLC</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   | 10.08.2034 (e)(g)                                 | \$ 250         | 213                      | 0,05                              | 3,000 % fällig am 27.08.2080                | 1.200          | 1.141                    | 0,24                              |
| <b>mBank S.A.</b>                                |                |                          |                                   | <b>TÜRKEI</b>                                     |                |                          |                                   | <b>WE Soda Investments Holding PLC</b>      |                |                          |                                   |
| 4,778 % fällig am 25.09.2035                     | € 100          | 101                      | 0,02                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 06.10.2028                | \$ 1.000       | 890                      | 0,19                              |
| <b>Synthos S.A.</b>                              |                |                          |                                   | <b>Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S</b> |                |                          |                                   |                                             |                | 71.674                   | 15,33                             |
| 2,500 % fällig am 07.06.2028                     | 2.500          | 2.363                    | 0,51                              | 3,375 % fällig am 29.06.2028                      | 300            | 231                      | 0,05                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>   |                |                          |                                   |
| Summe Polen                                      |                | 2.464                    | 0,53                              | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                            |                |                          |                                   | <b>INEOS Quattro Holdings U.K. Ltd.</b>     |                |                          |                                   |
| <b>SLOWENIEN</b>                                 |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |                |                          |                                   | 6,429 % fällig am 02.04.2029                | € 4.000        | 3.814                    | 0,82                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   | <b>Anglian Water Osprey Financing PLC</b>         |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Nova Ljubljanska Banka d.d.</b>               |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 31.07.2028                      | £ 1.700        | 1.746                    | 0,37                              | <b>Tower Bridge Funding PLC</b>             |                |                          |                                   |
| 10,750 % fällig am 28.11.2032                    | 300            | 346                      | 0,07                              | <b>Barclays PLC</b>                               |                |                          |                                   | 5,029 % fällig am 20.12.2066                | £ 694          | 811                      | 0,17                              |
| <b>SPANIEN</b>                                   |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am                                 |                |                          |                                   | Summe Großbritannien                        |                | 76.299                   | 16,32                             |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   | 15.09.2031 (e)(g)                                 | 600            | 723                      | 0,15                              | <b>USA</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>Aedas Homes Opco SL</b>                       |                |                          |                                   | 8,875 % fällig am                                 |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>     |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.08.2026                     | 162            | 162                      | 0,04                              | 15.09.2027 (e)(g)                                 | 600            | 739                      | 0,16                              | <b>American Airlines Pass-Through Trust</b> |                |                          |                                   |
| <b>Banco de Sabadell S.A.</b>                    |                |                          |                                   | <b>BCP Modular Services Finance PLC</b>           |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 01.11.2028                | \$ 774         | 643                      | 0,14                              |
| 5,625 % fällig am 06.05.2026                     | 700            | 718                      | 0,15                              | 4,750 % fällig am 30.11.2028                      | € 2.800        | 2.759                    | 0,59                              | 3,700 % fällig am 01.04.2028                | 1.517          | 1.270                    | 0,27                              |
| <b>Banco Santander S.A.</b>                      |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 30.11.2029                      | 500            | 448                      | 0,10                              | <b>Avantor Funding, Inc.</b>                |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am                                |                |                          |                                   | <b>Bellis Acquisition Co. PLC</b>                 |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.07.2028                | € 800          | 799                      | 0,17                              |
| 14.01.2026 (e)(g)                                | 800            | 801                      | 0,17                              | 8,000 % fällig am 01.07.2031 (a)                  | 700            | 703                      | 0,15                              | <b>Burford Capital Global Finance LLC</b>   |                |                          |                                   |
| <b>Bankinter S.A.</b>                            |                |                          |                                   | 8,125 % fällig am 14.05.2030                      | £ 2.700        | 2.977                    | 0,64                              | 9,250 % fällig am 01.07.2031                | \$ 300         | 269                      | 0,06                              |
| 6,000 % fällig am                                |                |                          |                                   | <b>Boparan Finance PLC</b>                        |                |                          |                                   | <b>Coty, Inc.</b>                           |                |                          |                                   |
| 30.06.2030 (e)(g)                                | 1.000          | 1.004                    | 0,22                              | 9,375 % fällig am 07.11.2029                      | 2.200          | 2.667                    | 0,57                              | 4,500 % fällig am 15.05.2027                | € 600          | 610                      | 0,13                              |
| <b>CaixaBank S.A.</b>                            |                |                          |                                   | <b>Burford Capital PLC</b>                        |                |                          |                                   | <b>IQVIA, Inc.</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am                                |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.12.2026 (i)                  | 2.300          | 2.657                    | 0,57                              | 1,750 % fällig am 15.03.2026                | 800            | 794                      | 0,17                              |
| 09.10.2027 (e)(g)                                | 600            | 623                      | 0,13                              | <b>Canary Wharf Group Investment Holdings PLC</b> |                |                          |                                   | <b>IWG U.S. Finance LLC</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Gestamp Automocion S.A.</b>                   |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 07.04.2026                      | € 1.000        | 986                      | 0,21                              | 6,500 % fällig am 28.06.2030                | 1.700          | 1.827                    | 0,39                              |
| 3,250 % fällig am 30.04.2026                     | 800            | 800                      | 0,17                              | 3,375 % fällig am 23.04.2028                      | £ 3.900        | 4.139                    | 0,89                              | <b>Kosmos Energy Ltd.</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>Grifols S.A.</b>                              |                |                          |                                   | <b>Deuce Finco PLC</b>                            |                |                          |                                   | 8,750 % fällig am 01.10.2031                | \$ 1.000       | 632                      | 0,13                              |
| 7,500 % fällig am 01.05.2030 (h)                 | 1.300          | 1.363                    | 0,29                              | 5,500 % fällig am 15.06.2027                      | 2.700          | 3.133                    | 0,67                              | <b>Kronos International, Inc.</b>           |                |                          |                                   |
| <b>Grupo Antolin-Irausa S.A.</b>                 |                |                          |                                   | <b>Drax Finco PLC</b>                             |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.09.2025                | € 271          | 271                      | 0,06                              |
| 3,500 % fällig am 30.04.2028                     | 800            | 532                      | 0,11                              | 5,875 % fällig am 15.04.2029                      | € 600          | 629                      | 0,13                              | 9,500 % fällig am 15.03.2029                | 2.239          | 2.418                    | 0,52                              |
| 10,375 % fällig am 30.01.2030                    | 600            | 427                      | 0,09                              | <b>EC Finance PLC</b>                             |                |                          |                                   | <b>Levi Strauss &amp; Co.</b>               |                |                          |                                   |
| <b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b>                 |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 15.10.2026                      | 3.000          | 2.936                    | 0,63                              | 3,375 % fällig am 15.03.2027                | 1.100          | 1.102                    | 0,24                              |
| 4,000 % fällig am 18.09.2027                     | 800            | 801                      | 0,17                              | <b>eG Global Finance PLC</b>                      |                |                          |                                   | <b>MPT Operating Partnership LP</b>         |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 30.04.2029                     | 200            | 209                      | 0,05                              | 11,000 % fällig am 30.11.2028                     | 2.400          | 2.652                    | 0,57                              | 7,000 % fällig am 15.02.2032                | 600            | 616                      | 0,13                              |
|                                                  |                | 7.440                    | 1,59                              | <b>Gatwick Airport Finance PLC</b>                |                |                          |                                   | <b>Olympus Water U.S. Holding Corp.</b>     |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>        |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 07.04.2026                      | £ 2.400        | 2.787                    | 0,60                              | 3,875 % fällig am 01.10.2028 (i)            | 2.500          | 2.454                    | 0,52                              |
| <b>Subcalidora</b>                               |                |                          |                                   | <b>Heathrow Finance PLC</b>                       |                |                          |                                   | 9,625 % fällig am 15.11.2028                | 300            | 316                      | 0,07                              |
| 7,730 % fällig am 14.08.2029                     | 2.000          | 2.010                    | 0,43                              | 3,875 % fällig am 01.03.2027                      | 3.000          | 3.400                    | 0,73                              | <b>Organon &amp; Co.</b>                    |                |                          |                                   |
| Summe Spanien                                    |                | 9.450                    | 2,02                              | <b>INEOS Finance PLC</b>                          |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 30.04.2028                | 3.700          | 3.615                    | 0,77                              |
| <b>SCHWEDEN</b>                                  |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.08.2030 (i)                  | € 1.500        | 1.462                    | 0,31                              | <b>Primo Water Holdings, Inc.</b>           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 15.04.2029                      | 1.600          | 1.623                    | 0,35                              | 3,875 % fällig am 31.10.2028                | 400            | 400                      | 0,08                              |
| <b>Castellum AB</b>                              |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 15.05.2028                      | 900            | 928                      | 0,20                              | <b>Rio Oil Finance Trust</b>                |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 02.12.2026 (e)                 | 3.500          | 3.431                    | 0,73                              | <b>International Game Technology PLC</b>          |                |                          |                                   | 8,200 % fällig am 06.04.2028                | \$ 945         | 840                      | 0,18                              |
| <b>Dometic Group AB</b>                          |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 15.06.2026                      | 400            | 400                      | 0,09                              | <b>SCIL LLC</b>                             |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 08.05.2026                     | 400            | 399                      | 0,08                              | <b>International Personal Finance PLC</b>         |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 15.07.2028                | € 1.900        | 2.005                    | 0,43                              |
| <b>Fastighets AB Balder</b>                      |                |                          |                                   | 10,750 % fällig am 14.12.2029                     | 1.700          | 1.884                    | 0,40                              | <b>Shift4 Payments LLC</b>                  |                |                          |                                   |
| 2,873 % fällig am 02.06.2081                     | 2.400          | 2.363                    | 0,51                              | <b>Lloyds Banking Group PLC</b>                   |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.05.2033                | 1.400          | 1.452                    | 0,31                              |
| <b>Heimstaden AB</b>                             |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am                                 |                |                          |                                   | <b>Silgan Holdings, Inc.</b>                |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 06.03.2027                     | 1.400          | 1.361                    | 0,29                              | 27.09.2025 (e)(g)                                 | \$ 600         | 514                      | 0,11                              | 2,250 % fällig am 01.06.2028                | 200            | 194                      | 0,04                              |
| <b>Heimstaden Bostad AB</b>                      |                |                          |                                   | <b>Market Bidco Finance PLC</b>                   |                |                          |                                   | <b>Standard Industries, Inc.</b>            |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.01.2026 (e)                 | 400            | 396                      | 0,08                              | 4,750 % fällig am 04.11.2027                      | € 2.000        | 1.995                    | 0,43                              | 2,250 % fällig am 21.11.2026                | 5.400          | 5.351                    | 1,14                              |
| 3,625 % fällig am 13.10.2026 (e)                 | 3.900          | 3.817                    | 0,82                              | 5,500 % fällig am 04.11.2027                      | € 1.650        | 1.895                    | 0,41                              | <b>UGI International LLC</b>                |                |                          |                                   |
| <b>Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB</b> |                |                          |                                   | <b>Miller Homes Group Finco PLC</b>               |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.12.2029                | 1.300          | 1.216                    | 0,26                              |
| 0,750 % fällig am 14.11.2028                     | 1.400          | 1.106                    | 0,24                              | 6,529 % fällig am 15.10.2030 (h)                  | € 1.900        | 1.934                    | 0,41                              | <b>VF Corp.</b>                             |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 04.08.2026                     | 1.600          | 1.532                    | 0,33                              | 7,000 % fällig am 15.05.2029                      | £ 800          | 942                      | 0,20                              | 0,250 % fällig am 25.02.2028                | 1.000          | 876                      | 0,19                              |
| <b>Verisure Holding AB</b>                       |                |                          |                                   | <b>Mobico Group PLC</b>                           |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 07.03.2026                | 1.300          | 1.296                    | 0,28                              |
| 3,875 % fällig am 15.07.2026                     | 400            | 400                      | 0,09                              | 3,625 % fällig am 20.11.2028                      | 1.000          | 997                      | 0,21                              | 4,250 % fällig am 07.03.2029                | 1.100          | 1.057                    | 0,23                              |
|                                                  |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 26.09.2031                      | € 1.200        | 974                      | 0,21                              |                                             |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | <b>NatWest Markets PLC</b>                        |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 04.11.2027                      | 500            | 503                      | 0,11                              |                                             |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | <b>Ocado Group PLC</b>                            |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | 10,500 % fällig am 08.08.2029                     | £ 1.500        | 1.707                    | 0,36                              |                                             |                |                          |                                   |
|                                                  |                |                          |                                   | 11,000 % fällig am 15.06.2030                     | 1.100          | 1.253                    | 0,27                              |                                             |                |                          |                                   |

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

| Beschreibung                                                                            | Pari<br>(000\$) | Markt-<br>wert<br>(000\$) | % Des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| Walgreens Boots Alliance, Inc.<br>2,125 % fällig am 20.11.2026                          | € 1.800         | € 1.776                   | 0,38                              |
| 3,600 % fällig am 20.11.2025                                                            | £ 2.386         | 2.756                     | 0,59                              |
|                                                                                         |                 | 36.855                    | 7,88                              |
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                      |                 |                           |                                   |
| Stepstone Group Midco GmbH<br>6,673 % fällig am 26.04.2032                              | € 0             | 0                         | 0,00                              |
| Twitter, Inc.<br>10,927 % fällig am 26.10.2029                                          | \$ 1.094        | 912                       | 0,20                              |
|                                                                                         |                 | 912                       | 0,20                              |
| Summe USA                                                                               |                 | 37.767                    | 8,08                              |
| Beschreibung                                                                            | Pari<br>(000\$) | Markt-<br>wert<br>(000\$) | % Des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
| Kurzfristige Instrumente                                                                |                 |                           |                                   |
| FRANCE TREASURY BILLS                                                                   |                 |                           |                                   |
| 1,978 % fällig am<br>17.09.2025 (c)(d)                                                  | € 50            | € 50                      | 0,01                              |
| 1,981 % fällig am 01.10.2025 (c)(d)                                                     | 400             | 398                       | 0,08                              |
| 1,989 % fällig am 17.09.2025 (c)(d)                                                     | 2.700           | 2.689                     | 0,58                              |
| 1,994 % fällig am 17.09.2025 (c)(d)                                                     | 1.400           | 1.394                     | 0,30                              |
| 1,995 % fällig am 17.09.2025 (c)(d)                                                     | 240             | 239                       | 0,05                              |
| 1,998 % fällig am 17.09.2025 (c)(d)                                                     | 600             | 597                       | 0,13                              |
| 2,000 % fällig am 17.09.2025 (c)(d)                                                     | 4.780           | 4.760                     | 1,02                              |
| 2,060 % fällig am 20.08.2025 (c)(d)                                                     | 400             | 399                       | 0,09                              |
| 2,082 % fällig am 20.08.2025 (c)(d)                                                     | 6.490           | 6.472                     | 1,38                              |
| 2,091 % fällig am 20.08.2025 (c)(d)                                                     | 2.030           | 2.025                     | 0,43                              |
| Summe kurzfristige Instrumente                                                          |                 | 19.023                    | 4,07                              |
| Summe Übertragbare Wertpapiere                                                          |                 | € 437.780                 | 93,64                             |
| Beschreibung                                                                            | Aktien          | Markt-<br>wert<br>(000\$) | % Des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
| Investmentfonds                                                                         |                 |                           |                                   |
| Börsengehandelte Fonds                                                                  |                 |                           |                                   |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>Euro Short Maturity<br>UCITS ETF (f)                          | 141.900         | € 14.837                  | 3,17                              |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>Euro Short-Term High<br>Yield Corporate Bond<br>UCITS ETF (f) | 674.500         | 8.087                     | 1,73                              |
| Summe Investmentfonds                                                                   |                 | € 22.924                  | 4,90                              |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                       | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                     | 1,960 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | € 7.400       | Belgium Government International Bond<br>1,600 % fällig am 22.06.2047 | € (7.552)                  | € 7.400                        | € 7.400                                                        | 1,58                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                                       | € (7.552)                  | € 7.400                        | € 7.400                                                        | 1,58                         |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

## FUTURES

| Beschreibung                                | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Euro-Bobl September Futures                 | Long  | 09.2025     | 312                  | € (168)                                  | (0,04)               |
| Euro-Bund September Futures                 | Long  | 09.2025     | 12                   | (12)                                     | 0,00                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures    | Long  | 09.2025     | 1                    | (2)                                      | 0,00                 |
| Euro-Schatz September Futures               | Long  | 09.2025     | 231                  | (34)                                     | (0,01)               |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2025     | 42                   | (36)                                     | (0,01)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures  | Long  | 09.2025     | 18                   | 41                                       | 0,01                 |
|                                             |       |             |                      | € (211)                                  | (0,05)               |

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                          | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|---------|-----------|----------------------|
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                             | € 117,250     | 25.07.2025    | 8                    | € (2)   | € (1)     | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                            | 118,500       | 25.07.2025    | 8                    | (1)     | (1)       | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                             | 129,000       | 25.07.2025    | 5                    | (2)     | (2)       | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                            | 132,500       | 25.07.2025    | 5                    | (2)     | (1)       | 0,00                 |
|                                                                       |               |               |                      | € (7)   | € (5)     | 0,00                 |
| <b>Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate</b> |               |               |                      |         | € (216)   | (0,05)               |

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

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

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

| Referenzeinheit      | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| United Group BV      | 5,000 %                     | 20.12.2027       | € 700                     | € 203                                    | 0,05                 |
| ZF Europe Finance BV | 5,000                       | 20.12.2029       | 1.500                     | (88)                                     | (0,02)               |
|                      |                             |                  |                           | € 115                                    | 0,03                 |

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

| Index/Tranchen                   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.06.2030       | € 42.670                  | € 521                                           | 0,11                    |



**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz           | Variabler Zinssatzindex        | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                               | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 6.300    | € 92                                            | 0,02                    |
| Erhalt                                                | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2027       | 3.300      | (20)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                                | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2055       | 400        | 11                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000           | 19.03.2027       | \$ 9.800   | (76)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                                                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000           | 19.03.2028       | 3.300      | (48)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 19.03.2035       | 1.200      | (36)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung <sup>3</sup>                                  | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,000           | 17.09.2027       | € 52.900   | 273                                             | 0,06                    |
| Zahlung <sup>3</sup>                                  | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2030       | 5.180      | (14)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>3</sup>                                  | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2035       | 200        | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt <sup>3</sup>                                   | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2055       | 200        | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                                | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,350           | 29.04.2030       | 800        | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                                | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,400           | 09.04.2030       | 1.000      | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                                | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,450           | 05.05.2035       | 600        | 9                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                               | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,460           | 13.03.2035       | 600        | (5)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                               | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,460           | 01.04.2035       | 600        | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                                | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,510           | 09.04.2035       | 600        | 6                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                               | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,520           | 27.03.2035       | 600        | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                                | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,520           | 09.04.2035       | 600        | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                               | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,547           | 09.03.2033       | 1.500      | 40                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                                | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,550           | 16.04.2035       | 600        | 4                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                               | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,610           | 24.03.2035       | 600        | 3                                               | 0,00                    |
|                                                       |                                |                 |                  |            | € 234                                           | 0,05                    |
| <b>Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate</b> |                                |                 |                  |            | € 870                                           | 0,19                    |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN****ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380 %       | 03.07.2025    | 500                       | € (1)   | € 0       | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460         | 16.07.2025    | 700                       | (2)     | (1)       | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640         | 03.07.2025    | 500                       | (1)     | 0         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720         | 16.07.2025    | 700                       | (2)     | (1)       | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | € (6)   | € (2)     | 0,00                         |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| GST        | Eutelsat S.A.   | 5,000 %                        | 20.12.2025       | € 800                     | € (34)                                       | € 50                                            | € 16      | 0,00                         |
|            | Eutelsat S.A.   | 5,000                          | 20.12.2029       | 800                       | (69)                                         | 144                                             | 75        | 0,02                         |
|            |                 |                                |                  |                           | € (103)                                      | € 194                                           | € 91      | 0,02                         |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.



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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD                              | 07.2025          | € 19.515            | \$ 22.849             | € 0                           | € (49)                          | € (49)                                        | (0,01)               |
|                                  | 08.2025          | \$ 22.899           | € 19.515              | 49                            | 0                               | 49                                            | 0,01                 |
| BOA                              | 07.2025          | € 727               | £ 619                 | 0                             | (4)                             | (4)                                           | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 21.795           | € 19.168              | 601                           | 0                               | 601                                           | 0,13                 |
| BPS                              | 07.2025          | € 59.474            | £ 50.694              | 0                             | (294)                           | (294)                                         | (0,06)               |
|                                  | 07.2025          | £ 47.741            | € 56.837              | 1.105                         | 0                               | 1.105                                         | 0,24                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 128              | £ 111                 | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | £ 50.798            | 59.474                | 292                           | 0                               | 292                                           | 0,06                 |
| BRC                              | 07.2025          | 1.312               | 1.554                 | 22                            | 0                               | 22                                            | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 160              | 139                   | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,00                 |
| JPM                              | 07.2025          | £ 393               | 459                   | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 113              | 96                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| MBC                              | 07.2025          | £ 2.021             | 2.381                 | 21                            | 0                               | 21                                            | 0,00                 |
| SCX                              | 07.2025          | € 1.030             | £ 881                 | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | £ 883               | € 1.030               | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
|                                  |                  |                     |                       | € 2.098                       | € (349)                         | € 1.749                                       | 0,37                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 | € 1.838                                       | 0,39                 |

| BESCHREIBUNG                               | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|--------------------------------------------|-------------|------------------|----------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |             |                  |                      |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 800.000  | € 82             | 0,02                 |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |             | € 82             | 0,02                 |
| Summe Anlagen                              |             | € 470.678        | 100,67               |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |             | € (3.145)        | (0,67)               |
| Nettovermögen                              |             | € 467.533        | 100,00               |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,22 %):

| Emittentenbeschreibung       | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum  | Kosten  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------------------------|---------|------------------|------------|---------|-----------|----------------------|
| Grifols S.A.                 | 7,500 % | 01.05.2030       | 11.06.2025 | € 1.370 | € 1.363   | 0,29                 |
| Miller Homes Group Finco PLC | 6,529   | 15.10.2030       | 02.04.2025 | 1.900   | 1.934     | 0,41                 |
|                              |         |                  |            | € 3.270 | € 3.297   | 0,70                 |

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 5.932 EUR (31. Dezember 2024: 1.981 EUR) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 6.520 EUR (31. Dezember 2024: 3.900 EUR) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von null EUR (31. Dezember 2024: 460 EUR) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere            | € 0                                                                         | € 434.634                                                       | € 3.146                                                      | € 437.780 |
| Investmentfonds                     | 22.924                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 22.924    |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 7.400                                                           | 0                                                            | 7.400     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (180)                                                                       | 2.672                                                           | 0                                                            | 2.492     |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 82                                                              | 0                                                            | 82        |
| Summen                              | € 22.744                                                                    | € 444.788                                                       | € 3.146                                                      | € 470.678 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere            | € 0                                                                         | € 324.595                                                       | € 2.005                                                      | € 326.600 |
| Investmentfonds                     | 0                                                                           | 22.472                                                          | 0                                                            | 22.472    |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 25.900                                                          | 0                                                            | 25.900    |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (572)                                                                       | (86)                                                            | 0                                                            | (658)     |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 97                                                              | 0                                                            | 97        |
| Summen                              | € (572)                                                                     | € 372.978                                                       | € 2.005                                                      | € 374.411 |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| MYI                                | 0,500 %    | 25.06.2025       | 24.06.2027       | € (1.495)    | € (1.495)                                   | (0,32)                  |
|                                    | 1,250      | 11.06.2025       | 10.06.2027       | (1.179)      | (1.180)                                     | (0,25)                  |
|                                    | 1,250      | 24.06.2025       | 23.06.2027       | (590)        | (590)                                       | (0,13)                  |
|                                    | 1,300      | 11.06.2025       | 10.06.2027       | (2.343)      | (2.345)                                     | (0,50)                  |
|                                    | 3,400      | 09.05.2025       | 08.05.2027       | £ (390)      | (458)                                       | (0,10)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |              | € (6.068)                                   | (1,30)                  |

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

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| BOA        | € 597                               | € (360)                               | € 237                               | € k. A.                             | € k. A.                               | € k. A.                         |
| BPS        | 1.105                               | (870)                                 | 235                                 | (10)                                | 0                                     | (10)                            |
| BRC        | 25                                  | 0                                     | 25                                  | (28)                                | 0                                     | (28)                            |
| CBK        | (2)                                 | 0                                     | (2)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| GST        | 91                                  | 0                                     | 91                                  | (156)                               | 0                                     | (156)                           |
| JPM        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| MBC        | 21                                  | 0                                     | 21                                  | (299)                               | 0                                     | (299)                           |
| SCX        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (463)                               | 460                                   | (3)                             |

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

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 84,27             | 77,62             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 4,45              | 5,64              |
| Investmentfonds                                                        | 4,65              | 5,73              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 1,50              | 6,60              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,01              | 0,02              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,24              | 0,27              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,44              | 0,00              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,02              | 0,02              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 4,42              | 4,10              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------|-------------------|-------------------|
| Österreich            | 0,95              | 0,86              |
| Belgien               | 2,12              | 1,43              |
| Kaimaninseln          | 0,28              | 0,76              |
| China                 | 0,00              | 0,00              |
| Zypern                | 0,29              | 0,25              |
| Tschechische Republik | 0,89              | 0,96              |
| Dänemark              | 0,53              | k. A.             |
| Finnland              | 0,76              | 1,09              |
| Frankreich            | 12,71             | 10,20             |
| Deutschland           | 9,01              | 8,98              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Griechenland                                                                           | 0,15              | 1,10              |
| Guernsey, Kanalinseln                                                                  | 0,12              | k. A.             |
| Hongkong                                                                               | 0,58              | 0,59              |
| Irland                                                                                 | 1,65              | 1,06              |
| Insel Man                                                                              | 0,35              | 0,60              |
| Israel                                                                                 | 0,49              | 0,57              |
| Italien                                                                                | 5,21              | 5,38              |
| Japan                                                                                  | 1,22              | 1,25              |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 1,95              | 1,38              |
| Luxemburg                                                                              | 8,43              | 7,32              |
| Multinational                                                                          | 0,37              | k. A.             |
| Niederlande                                                                            | 8,82              | 8,49              |
| Norwegen                                                                               | 0,92              | 0,46              |
| Panama                                                                                 | 0,11              | 0,14              |
| Polen                                                                                  | 0,53              | k. A.             |
| Portugal                                                                               | k. A.             | 0,32              |
| Slowenien                                                                              | 0,07              | 0,09              |
| Spanien                                                                                | 2,02              | 2,54              |
| Schweden                                                                               | 4,54              | 3,14              |
| Schweiz                                                                                | 0,05              | k. A.             |
| Türkei                                                                                 | 0,05              | k. A.             |
| Großbritannien                                                                         | 16,32             | 15,19             |
| USA                                                                                    | 8,08              | 8,38              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 4,07              | 2,62              |
| Investmentfonds                                                                        | 4,90              | 5,86              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 1,58              | 6,75              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | (0,05)            | (0,13)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,03              | 0,05              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,11              | (0,03)            |
| Zinsswaps                                                                              | 0,05              | 0,19              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,02              | (0,04)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | 0,37              | (0,21)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,02              | 0,03              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (0,67)            | 2,38              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| Beschreibung                          | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                           | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                     | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |       |
|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------|
| Übertragbare Wertpapiere              |                |                          |                                   |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| Unternehmensanleihen und Wechsel      |                |                          |                                   |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| Banken und Finanzen                   |                |                          |                                   |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| ABN AMRO Bank NV                      |                |                          |                                   | Nykredit Realkredit A/S                |                |                          |                                   | Pacific Gas & Electric Co.       |                |                          |                                   |       |
| 4,375 % fällig am                     |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 01.10.2040           | DKK            | 0                        | 0,00                              | 4,550 % fällig am 01.07.2030     | \$             | 3.400                    | 2.828                             | 0,27  |
| 22.09.2025 (e)(g)                     | €              | 4.600                    | € 4.612                           | 0,500 % fällig am 01.10.2050           |                | 0                        | 0,00                              | TDC Net A/S                      |                |                          |                                   |       |
| Ageas S.A.                            |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050           |                | 2                        | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.06.2031     | €              | 3.700                    | 4.107                             | 0,40  |
| 3,250 % fällig am 02.07.2049          |                | 900                      | 890                               | 1,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 2                        | 0,00                              | Telefonica Europe BV             |                |                          |                                   |       |
| AMCO - Asset Management Co. SpA       |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2056           |                | 0                        | 0,00                              | 6,750 % fällig am 07.06.2031 (e) |                | 900                      | 991                               | 0,10  |
| 4,625 % fällig am 06.02.2027          |                | 6.600                    | 6.838                             | 1,500 % fällig am 01.10.2050           |                | 0                        | 0,00                              |                                  |                |                          | 14.664                            | 1,43  |
| American Express Co.                  |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2052           |                | 0                        | 0,00                              | Summe Unternehmensanleihen und   |                |                          | 220.177                           | 21,41 |
| 3,433 % fällig am 20.05.2032          |                | 2.100                    | 2.120                             | 1,500 % fällig am 01.10.2053           |                | 1.286                    | 121                               | Wechsel                          |                |                          |                                   |       |
| American Tower Corp.                  |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 01.10.2050           |                | 192                      | 22                                |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,100 % fällig am 15.06.2030          | \$             | 4.600                    | 3.482                             | 2,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 41                       | 5                                 |                                  |                |                          |                                   |       |
| ASR Nederland NV                      |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 1.165                    | 147                               |                                  |                |                          |                                   |       |
| 3,375 % fällig am 02.05.2049          | €              | 500                      | 496                               | 3,500 % fällig am 01.04.2053           |                | 115.410                  | 15.040                            |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,625 % fällig am                     |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.10.2056           |                | 79.178                   | 10.492                            |                                  |                |                          |                                   |       |
| 19.10.2027 (e)(g)                     |                | 500                      | 501                               | 5,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 39.605                   | 5.500                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA   |                |                          |                                   | Realcredit Danmark A/S                 |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026          |                | 1.200                    | 1.196                             | 1,000 % fällig am 01.01.2026           |                | 37.000                   | 4.936                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Banco Santander S.A.                  |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050           |                | 2                        | 0                                 |                                  |                |                          |                                   |       |
| 5,565 % fällig am 17.01.2030          | \$             | 1.800                    | 1.593                             | 1,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 2                        | 0                                 |                                  |                |                          |                                   |       |
| Barclays PLC                          |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2056           |                | 0                        | 0,00                              |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,918 % fällig am 08.08.2030          | €              | 900                      | 961                               | 1,500 % fällig am 01.10.2050           |                | 5                        | 1                                 |                                  |                |                          |                                   |       |
| 5,851 % fällig am 21.03.2035          | £              | 3.500                    | 4.132                             | 2,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 0                        | 0,00                              |                                  |                |                          |                                   |       |
| BNP Paribas S.A.                      |                |                          |                                   | 2,610 % fällig am 01.07.2025           |                | 1.268                    | 131                               |                                  |                |                          |                                   |       |
| 3,583 % fällig am 15.01.2031          | €              | 5.400                    | 5.497                             | 3,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 36.500                   | 4.892                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,750 % fällig am 13.11.2032          |                | 3.000                    | 3.220                             | 4,000 % fällig am 01.10.2056           |                | 28                       | 4                                 |                                  |                |                          |                                   |       |
| 7,000 % fällig am                     |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.10.2053           |                | 663                      | 88                                |                                  |                |                          |                                   |       |
| 16.08.2028 (e)(g)                     | \$             | 3.400                    | 2.960                             | Sirius Real Estate Ltd.                |                | 5.991                    | 835                               |                                  |                |                          |                                   |       |
| BPCE S.A.                             |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 22.06.2026           | €              | 3.100                    | 3.044                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 3,875 % fällig am 26.02.2036          | €              | 4.100                    | 4.088                             | Sumitomo Mitsui Banking Corp.          |                | 2.400                    | 2.401                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Canadian Imperial Bank of Commerce    |                |                          |                                   | 2,737 % fällig am 18.02.2030           |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,495 % fällig am 20.12.2027          | AUD            | 3.900                    | 2.205                             | Toronto-Dominion Bank                  |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| Cooperative Rabobank UA               |                |                          |                                   | 4,838 % fällig am 11.06.2029           | £              | 2.000                    | 2.335                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 3,250 % fällig am                     |                |                          |                                   | UBS Group AG                           |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 29.12.2026 (e)(g)                     | €              | 1.400                    | 1.377                             | 9,016 % fällig am 15.11.2033           | \$             | 3.200                    | 3.372                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,625 % fällig am                     |                |                          |                                   | UniCredit SpA                          |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 29.12.2025 (e)(g)                     |                | 2.200                    | 2.208                             | 5,850 % fällig am 15.11.2027           | €              | 1.450                    | 1.516                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,875 % fällig am                     |                |                          |                                   | Volkswagen Leasing GmbH                |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 29.06.2029 (e)(g)                     |                | 400                      | 400                               | 4,500 % fällig am 25.03.2026           |                | 3.400                    | 3.453                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Deutsche Bank AG                      |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.                      |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030          |                | 4.300                    | 4.035                             | 3,900 % fällig am 22.07.2032           |                | 3.900                    | 4.019                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| HSBC Holdings PLC                     |                |                          |                                   | 5,389 % fällig am 24.04.2034           | \$             | 1.800                    | 1.570                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,750 % fällig am                     |                |                          |                                   | 5,499 % fällig am 23.01.2035           |                | 1.700                    | 1.486                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 04.07.2029 (e)(g)                     |                | 1.600                    | 1.595                             | Yorkshire Building Society             |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| International Development Association |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 28.01.2030           | €              | 2.300                    | 2.313                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 3,250 % fällig am 24.01.2040          |                | 1.100                    | 1.086                             |                                        |                | 185.638                  | 18,05                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| JPMorgan Chase & Co.                  |                |                          |                                   | INDUSTRIEWERTE                         |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 3,588 % fällig am 23.01.2036          |                | 4.100                    | 4.083                             | Amprion GmbH                           |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| Jyske Realkredit A/S                  |                |                          |                                   | 3,450 % fällig am 22.09.2027           |                | 2.900                    | 2.955                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 0,500 % fällig am 01.10.2040          | DKK            | 0                        | 0                                 | Bayer U.S. Finance LLC                 |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050          |                | 0                        | 0                                 | 4,375 % fällig am 15.12.2028           | \$             | 4.200                    | 3.545                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053          |                | 0                        | 0                                 | Cofiroute S.A.                         |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,500 % fällig am 01.07.2050          |                | 0                        | 0                                 | 3,125 % fällig am 06.03.2033           | €              | 2.400                    | 2.365                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050          |                | 19                       | 2                                 | Entergy Louisiana LLC                  |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053          |                | 0                        | 0                                 | 5,350 % fällig am 15.03.2034           | \$             | 1.500                    | 1.312                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053          |                | 36.890                   | 3.796                             | Mercedes-Benz International Finance BV |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,360 % fällig am 01.07.2025          |                | 38.900                   | 5.214                             | 2,115 % fällig am 11.06.2026           | €              | 2.800                    | 2.797                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau       |                |                          |                                   | Mundys SpA                             |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,500 % fällig am 09.10.2030          | €              | 2.400                    | 2.409                             | 4,750 % fällig am 24.01.2029           |                | 1.500                    | 1.568                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,625 % fällig am 26.04.2029          |                | 200                      | 203                               | Southern Co.                           |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,625 % fällig am 10.01.2034          |                | 13.300                   | 13.148                            | 1,875 % fällig am 15.09.2081           |                | 1.100                    | 1.056                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Logicor Financing SARL                |                |                          |                                   | TotalEnergies SE                       |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 0,625 % fällig am 17.11.2025          |                | 3.700                    | 3.669                             | 3,250 % fällig am 17.07.2036 (e)       |                | 1.300                    | 1.146                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Lseg Netherlands BV                   |                |                          |                                   | Universal Music Group NV               |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,750 % fällig am 20.09.2027          |                | 1.700                    | 1.709                             | 4,000 % fällig am 13.06.2031           |                | 3.000                    | 3.131                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| Morgan Stanley                        |                |                          |                                   |                                        |                | 19.875                   | 1,93                              |                                  |                |                          |                                   |       |
| 3,955 % fällig am 21.03.2035          |                | 4.000                    | 4.093                             | VERSORGUNGSUNTERNEHMEN                 |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,656 % fällig am 02.03.2029          |                | 3.900                    | 4.093                             | BP Capital Markets PLC                 |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| NatWest Group PLC                     |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 22.03.2029 (e)       |                | 1.000                    | 995                               |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,500 % fällig am                     |                |                          |                                   | Electricite de France S.A.             |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 31.03.2028 (e)(g)                     | £              | 200                      | 221                               | 2,625 % fällig am 01.12.2027 (e)       |                | 200                      | 195                               |                                  |                |                          |                                   |       |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab  |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 15.12.2026 (e)       |                | 2.400                    | 2.366                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 0,500 % fällig am 01.10.2040          | DKK            | 0                        | 0                                 | 3,250 % fällig am 07.05.2032           |                | 2.800                    | 2.773                             |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,000 % fällig am 01.04.2026          |                | 40.000                   | 5.325                             | Enel Finance International NV          |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050          |                | 0                        | 0                                 | 3,375 % fällig am 23.07.2028           |                | 400                      | 409                               |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053          |                | 2                        | 0                                 |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050          |                | 0                        | 0                                 |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053          |                | 30                       | 3                                 |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053          |                | 61.785                   | 6.367                             |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 4,000 % fällig am 01.10.2056          |                | 994                      | 132                               |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| Nova Ljubljanska Banka d.d.           |                |                          |                                   |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |
| 10,750 % fällig am 28.11.2032         | €              | 6.900                    | 7.956                             |                                        |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   |       |

|                                                  |    |         |        |  |  |  |  |
|--------------------------------------------------|----|---------|--------|--|--|--|--|
| US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                            |    |         |        |  |  |  |  |
| Ginnie Mae, TBA                                  |    |         |        |  |  |  |  |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055                     | \$ | 41.000  | 31.759 |  |  |  |  |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA            |    |         |        |  |  |  |  |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055                     |    | 11.800  | 8.700  |  |  |  |  |
| 4,500 % fällig am 01.07.2055 -                   |    |         |        |  |  |  |  |
| 01.08.2055                                       |    | 57.700  | 47.010 |  |  |  |  |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055                     |    | 12.800  | 10.681 |  |  |  |  |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                     |    | 69.000  | 59.680 |  |  |  |  |
|                                                  |    | 157.830 | 15,35  |  |  |  |  |
| US-SCHATZOBIGATIONEN                             |    |         |        |  |  |  |  |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) |    |         |        |  |  |  |  |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026                     |    | 34.391  | 29.047 |  |  |  |  |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031                     |    | 4.787   | 3.754  |  |  |  |  |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028                     |    | 6.242   | 5.220  |  |  |  |  |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033                     |    | 11.723  | 9.703  |  |  |  |  |
| 1,625 % fällig am 15.10.2027                     |    | 21.007  | 18.121 |  |  |  |  |
| 1,625 % fällig am 15.10.2029                     |    | 16.209  | 13.982 |  |  |  |  |
|                                                  |    | 79.827  | 7,76   |  |  |  |  |
| NON-AGENCY-MBS                                   |    |         |        |  |  |  |  |
| Alba PLC                                         |    |         |        |  |  |  |  |
| 4,528 % fällig am 15.12.2038                     | £  | 444     | 510    |  |  |  |  |
| Atlas Funding PLC                                |    |         |        |  |  |  |  |
| 5,374 % fällig am 20.01.2061                     |    | 854     | 1.002  |  |  |  |  |
| Barley Hill PLC                                  |    |         |        |  |  |  |  |
| 5,144 % fällig am 27.08.2058                     |    | 64      | 75     |  |  |  |  |
| Bletchley Park Funding PLC                       |    |         |        |  |  |  |  |
| 0,000 % fällig am 27.01.2070                     |    | 4.300   | 5.029  |  |  |  |  |
| Bowbell Master Issuer PLC                        |    |         |        |  |  |  |  |
| 0,000 % fällig am 23.07.2071                     |    | 4.200   | 4.910  |  |  |  |  |
| Canada Square Funding PLC                        |    |         |        |  |  |  |  |
| 5,189 % fällig am 17.06.2058                     |    | 1.245   | 1.456  |  |  |  |  |
| Canterbury Finance PLC                           |    |         |        |  |  |  |  |
| 5,073 % fällig am 16.05.2058                     |    | 1.249   | 1.460  |  |  |  |  |
| Cheshire PLC                                     |    |         |        |  |  |  |  |
| 5,137 % fällig am 20.08.2045                     |    | 145     | 170    |  |  |  |  |
| Curzon Mortgages PLC                             |    |         |        |  |  |  |  |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                     |    | 5.339   | 6.252  |  |  |  |  |
| Dutch Property Finance BV                        |    |         |        |  |  |  |  |
| 2,811 % fällig am 28.07.2058                     | €  | 3.484   | 3.484  |  |  |  |  |
| 2,861 % fällig am 28.04.2059                     |    | 488     | 488    |  |  |  |  |
| 2,911 % fällig am 28.10.2059                     |    | 3.465   | 3.468  |  |  |  |  |
| Economic Master Issuer PLC                       |    |         |        |  |  |  |  |
| 0,000 % fällig am 25.04.2075 (a)                 | £  | 4.400   | 5.139  |  |  |  |  |
| Harbour PLC                                      |    |         |        |  |  |  |  |
| 5,332 % fällig am 28.10.2054                     |    | 2.861   | 3.341  |  |  |  |  |
| Harmony French Home Loans                        |    |         |        |  |  |  |  |
| 2,690 % fällig am 27.05.2062                     | €  | 1.512   | 1.515  |  |  |  |  |
| Holmes Master Issuer PLC                         |    |         |        |  |  |  |  |
| 4,847 % fällig am 15.10.2072                     | £  | 2.400   | 2.805  |  |  |  |  |
| Hops Hill PLC                                    |    |         |        |  |  |  |  |
| 0,000 % fällig am 21.06.2056 (a)                 |    | 2.400   | 2.804  |  |  |  |  |
| 5,103 % fällig am 21.04.2056                     |    | 439     | 514    |  |  |  |  |
| 5,524 % fällig am 27.11.2054                     |    | 1.989   | 2.339  |  |  |  |  |
| Jubilee Place BV                                 |    |         |        |  |  |  |  |
| 3,093 % fällig am 17.07.2058                     | €  | 314     | 314    |  |  |  |  |
| 3,263 % fällig am 17.10.2057                     |    | 932     | 934    |  |  |  |  |
| Lanark Master Issuer PLC                         |    |         |        |  |  |  |  |
| 4,737 % fällig am 22.12.2069                     | £  | 858     | 1.003  |  |  |  |  |
| Landmark Mortgage Securities PLC                 |    |         |        |  |  |  |  |
| 4,711 % fällig am 17.04.2044                     |    | 410     | 464    |  |  |  |  |
| Lanebrook Mortgage Transaction PLC               |    |         |        |  |  |  |  |
| 4,948 % fällig am 20.07.2058                     |    | 2.955   | 3.448  |  |  |  |  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

|                                 |  | PARI    | MARKT-  | % DES  |                                                |  | PARI   | MARKT- | % DES  |                                            |  | PARI     | MARKT-   | % DES  |  |
|---------------------------------|--|---------|---------|--------|------------------------------------------------|--|--------|--------|--------|--------------------------------------------|--|----------|----------|--------|--|
| BESCHREIBUNG                    |  | (000S)  | WERT    | NETTO- | BESCHREIBUNG                                   |  | (000S) | WERT   | NETTO- | BESCHREIBUNG                               |  | (000S)   | WERT     | NETTO- |  |
|                                 |  |         | (000S)  | VERMÖ- |                                                |  |        | (000S) | GENS   |                                            |  |          | (000S)   | GENS   |  |
| Polaris PLC                     |  |         |         |        | BNPP AM Euro CLO DAC                           |  |        |        |        | Europäische Finanzstabilisierungsfazilität |  |          |          |        |  |
| 5,014 % fällig am 23.12.2058    |  | £ 2.835 | € 3.310 | 0,32   | 2,929 % fällig am 15.10.2031                   |  | € 737  | € 735  | 0,07   | 2,625 % fällig am 16.07.2029               |  | € 15.200 | € 15.383 | 1,50   |  |
| 5,024 % fällig am 23.10.2059    |  | 1.840   | 2.149   | 0,21   | 3,056 % fällig am 22.07.2032                   |  | 799    | 797    | 0,08   | Europäische Union                          |  |          |          |        |  |
| Primrose Residential DAC        |  |         |         |        | Bosphorus CLO DAC                              |  |        |        |        | 2,500 % fällig am 04.12.2031               |  | 400      | 396      | 0,04   |  |
| 3,399 % fällig am 24.10.2061    |  | € 3.362 | 3.364   | 0,33   | 2,964 % fällig am 12.12.2032                   |  | 2.283  | 2.286  | 0,22   | 3,125 % fällig am 05.12.2028               |  | 14.500   | 14.917   | 1,45   |  |
| Resloc UK PLC                   |  |         |         |        | Bridgepoint CLO DAC                            |  |        |        |        | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro          |  |          |          |        |  |
| 4,518 % fällig am 15.12.2043    |  | £ 1.526 | 1.740   | 0,17   | 3,489 % fällig am 15.01.2034                   |  | 297    | 297    | 0,03   | 3,044 % fällig am 15.10.2028               |  | 7.400    | 7.529    | 0,73   |  |
| Silverstone Master Issuer PLC   |  |         |         |        | Cairn CLO DAC                                  |  |        |        |        | 3,150 % fällig am 15.11.2031               |  | 900      | 911      | 0,09   |  |
| 4,748 % fällig am 21.01.2079    |  | 2.500   | 2.921   | 0,28   | 2,856 % fällig am 31.01.2030                   |  | 1.573  | 1.569  | 0,15   | 3,394 % fällig am 15.10.2031               |  | 46.100   | 47.376   | 4,61   |  |
| Towd Point Mortgage Funding PLC |  |         |         |        | 3,046 % fällig am 30.10.2030                   |  | 1.490  | 1.489  | 0,15   | 4,000 % fällig am 15.11.2030               |  | 200      | 213      | 0,02   |  |
| 5,074 % fällig am 20.04.2051    |  | 2.115   | 2.471   | 0,24   | Carlyle Euro CLO DAC                           |  |        |        |        | 4,100 % fällig am 01.02.2029               |  | 21.000   | 22.245   | 2,16   |  |
| Tower Bridge Funding PLC        |  |         |         |        | 0,000 % fällig am 15.08.2038 (a)               |  | 1.000  | 1.000  | 0,10   | 4,300 % fällig am 01.10.2054               |  | 5.500    | 5.517    | 0,54   |  |
| 5,017 % fällig am 20.11.2063    |  | 2.193   | 2.561   | 0,25   | 2,979 % fällig am 15.01.2031                   |  | 1.659  | 1.659  | 0,16   | New South Wales Treasury Corp.             |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,033 % fällig am 15.08.2032                   |  | 770    | 767    | 0,07   | 1,750 % fällig am 20.03.2034 AUD           |  | 6.100    | 2.692    | 0,26   |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,089 % fällig am 15.01.2034                   |  | 2.000  | 1.991  | 0,19   | 2,000 % fällig am 08.03.2033               |  | 8.800    | 4.127    | 0,40   |  |
|                                 |  |         |         |        | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC  |  |        |        |        | 4,750 % fällig am 20.09.2035               |  | 3.300    | 1.832    | 0,18   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,888 % fällig am 25.01.2032                   |  | 614    | 613    | 0,06   | Queensland Treasury Corp.                  |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. |  |        |        |        | 2,000 % fällig am 22.08.2033               |  | 2.600    | 1.195    | 0,12   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,893 % fällig am 15.11.2031                   |  | 2.418  | 2.420  | 0,24   | Bundesrepublik Deutschland                 |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Contego CLO BV                                 |  |        |        |        | 2,200 % fällig am                          |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,049 % fällig am 15.10.2030                   |  | 361    | 362    | 0,04   | 15.02.2034 (i)                             |  | € 9.800  | 9.560    | 0,93   |  |
|                                 |  |         |         |        | CVC Cordatus Loan Fund DAC                     |  |        |        |        | Romania Government International Bond      |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,605 % fällig am 15.09.2031                   |  | 1.411  | 1.411  | 0,14   | 5,625 % fällig am                          |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,886 % fällig am 21.07.2030                   |  | 3.671  | 3.677  | 0,36   | 30.05.2037 (h)                             |  | 1.100    | 1.037    | 0,10   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,929 % fällig am 15.10.2031                   |  | 9.959  | 9.965  | 0,97   | Saudi Arabia Government International Bond |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Dryden Euro CLO DAC                            |  |        |        |        | 5,125 % fällig am 13.01.2028               |  | \$ 5.900 | 5.111    | 0,50   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,939 % fällig am 15.04.2033                   |  | 4.603  | 4.601  | 0,45   | 5,375 % fällig am 13.01.2031               |  | 1.100    | 972      | 0,09   |  |
|                                 |  |         |         |        | Griffith Park CLO DAC                          |  |        |        |        | Slovenia Government International Bond     |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,795 % fällig am 21.11.2031                   |  | 2.725  | 2.718  | 0,26   | 3,500 % fällig am 14.04.2055               |  | € 3.400  | 3.220    | 0,31   |  |
|                                 |  |         |         |        | Harvest CLO DAC                                |  |        |        |        | Spain Government International Bond        |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 1,040 % fällig am 15.07.2031                   |  | 1.413  | 1.371  | 0,13   | 3,150 % fällig am 30.04.2035               |  | 300      | 300      | 0,03   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,916 % fällig am 20.10.2031                   |  | 10.388 | 10.386 | 1,01   | 3,200 % fällig am 31.10.2035               |  | 2.900    | 2.893    | 0,28   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,919 % fällig am 15.10.2031                   |  | 2.738  | 2.738  | 0,27   | Treasury Corp. of Victoria                 |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,039 % fällig am 15.07.2031                   |  | 3.644  | 3.647  | 0,35   | 2,250 % fällig am 15.09.2033 AUD           |  | 8.500    | 3.981    | 0,39   |  |
|                                 |  |         |         |        | Henley CLO DAC                                 |  |        |        |        | 4,250 % fällig am 20.12.2032               |  | 6.900    | 3.813    | 0,37   |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,148 % fällig am 25.04.2034                   |  | 1.100  | 1.099  | 0,11   | United Kingdom Gilt                        |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Invesco Euro CLO DAC                           |  |        |        |        | 1,500 % fällig am 22.07.2026               |  | £ 30.300 | 34.559   | 3,36   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,929 % fällig am 15.07.2031                   |  | 777    | 776    | 0,08   | 4,250 % fällig am 07.12.2027               |  | 23.100   | 27.347   | 2,66   |  |
|                                 |  |         |         |        | Jubilee CLO DAC                                |  |        |        |        | 4,250 % fällig am 07.12.2046               |  | 400      | 410      | 0,04   |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,929 % fällig am 15.04.2031                   |  | 3.112  | 3.103  | 0,30   | 4,375 % fällig am 07.03.2030               |  | 43.200   | 51.334   | 4,98   |  |
|                                 |  |         |         |        | Madison Park Euro Funding DAC                  |  |        |        |        | 4,750 % fällig am 22.10.2043               |  | 9.400    | 10.493   | 1,02   |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,029 % fällig am 15.01.2032                   |  | 6.337  | 6.318  | 0,61   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Man GLG Euro CLO DAC                           |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,665 % fällig am 15.12.2031                   |  | 1.522  | 1.518  | 0,15   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Marzio Finance SRL                             |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,019 % fällig am 28.02.2048                   |  | 225    | 226    | 0,02   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Noria DE                                       |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,479 % fällig am 25.02.2043                   |  | 2.900  | 2.901  | 0,28   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Oak Hill European Credit Partners DAC          |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,966 % fällig am 20.01.2032                   |  | 634    | 634    | 0,06   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | OCP Euro CLO DAC                               |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,116 % fällig am 22.09.2034                   |  | 3.777  | 3.777  | 0,37   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Palmer Square European Loan Funding DAC        |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,999 % fällig am 15.10.2031                   |  | 361    | 360    | 0,04   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Sculptor European CLO DAC                      |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,055 % fällig am 14.01.2032                   |  | 564    | 564    | 0,06   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Segovia European CLO DAC                       |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,116 % fällig am 20.07.2032                   |  | 726    | 727    | 0,07   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Toro European CLO DAC                          |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 2,953 % fällig am 15.02.2034                   |  | 986    | 983    | 0,10   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,185 % fällig am 12.01.2032                   |  | 1.142  | 1.141  | 0,11   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | Trinitas Euro CLO DAC                          |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        | 3,166 % fällig am 20.10.2032                   |  | 146    | 146    | 0,01   |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |
|                                 |  |         |         |        |                                                |  |        |        |        |                                            |  |          |          |        |  |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                             | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|---------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                     | 1,970 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | € 77.900      | European Union 2,500 % fällig am 04.10.2052 | € (79.532)                 | € 77.900                       | € 77.904                                                       | 7,58                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                             | € (79.532)                 | € 77.900                       | € 77.904                                                       | 7,58                         |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month EURIBOR December Futures                     | Short | 12.2025     | 402                  | € (372)                                         | (0,04)                  |
| 3-Month EURIBOR December Futures                     | Long  | 12.2026     | 402                  | 288                                             | 0,03                    |
| 3-Month EURIBOR September Futures                    | Short | 09.2025     | 379                  | (31)                                            | 0,00                    |
| 3-Month EURIBOR September Futures                    | Long  | 09.2026     | 379                  | 163                                             | 0,02                    |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures  | Short | 09.2025     | 24                   | (14)                                            | 0,00                    |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025     | 81                   | 28                                              | 0,00                    |
| Euro-BTP September Futures                           | Long  | 09.2025     | 221                  | 75                                              | 0,01                    |
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025     | 125                  | 94                                              | 0,01                    |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures             | Short | 09.2025     | 179                  | 402                                             | 0,04                    |
| Euro-Oat September Futures                           | Short | 09.2025     | 265                  | 261                                             | 0,02                    |
| Euro-Schatz September Futures                        | Long  | 09.2025     | 3.043                | (327)                                           | (0,03)                  |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Short | 09.2025     | 497                  | (326)                                           | (0,03)                  |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 85                   | 66                                              | 0,01                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 78                   | 127                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Long  | 09.2025     | 16                   | 31                                              | 0,00                    |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025     | 12                   | (51)                                            | (0,01)                  |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2025     | 87                   | (197)                                           | (0,02)                  |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Short | 09.2025     | 10                   | (19)                                            | 0,00                    |
|                                                      |       |             |                      | € 198                                           | 0,02                    |

**OPTIONSKAUF****FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|--------|-----------|------------------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,938      | 15.12.2025    | 260                     | € 124  | € 10      | 0,00                         |

**VERKAUFSOPTIONEN****FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|---------|-----------|------------------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,813      | 12.12.2025    | 260                     | € (165) | € (42)    | 0,00                         |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

€ 166 0,02

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

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

| Index/Tranchen                   | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index | (5,000) %                      | 20.06.2030       | € 2.280                   | € (30)                                          | 0,00                         |

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

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 1.400                  | € 3                                             | 0,00                         |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 98.300                    | 88                                              | 0,01                         |
|                                    |                                |                  |                           | € 91                                            | 0,01                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex        | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 29.200   | € 175                                           | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2027       | 41.570     | 19                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2055       | 200        | 6                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,865           | 13.02.2054       | \$ 20.800  | 260                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 19.03.2035       | 4.500      | (139)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 19.03.2055       | 700        | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,620           | 30.11.2029       | 92.092     | (725)                                           | (0,07)                  |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,686           | 15.11.2034       | 32.100     | 60                                              | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,100           | 15.11.2052       | 16.940     | (305)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,250           | 20.12.2025       | 1.400      | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,750           | 18.01.2026       | 2.700      | 16                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,827           | 15.12.2025       | 2.700      | 15                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,000           | 17.09.2027       | € 45.500   | 119                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,112           | 02.09.2027       | 6.500      | (15)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2035       | 81.230     | 131                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2055       | 41.050     | 1.607                                           | 0,15                    |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                        | 2,125           | 15.03.2035       | 9.900      | (115)                                           | (0,01)                  |
|                                                |                                |                 |                  |            | € 1.100                                         | 0,10                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                |                 |                  |            | € 1.161                                         | 0,11                    |

- (1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|------------------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                                 | 3,650 %       | 04.12.2025    | 131.800                   | € 260  | € 360     | 0,04                         |

### VERKAUFSOPTIONS

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld   | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------|-----------|------------------------------|
| BRC        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,440 %       | 25.01.2027    | 3.500                     | € (30)    | € (29)    | 0,00                         |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,440         | 25.01.2027    | 3.500                     | (30)      | (18)      | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,740         | 08.09.2025    | 3.800                     | (81)      | (63)      | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,740         | 08.09.2025    | 3.800                     | (81)      | (22)      | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,350         | 07.01.2027    | 16.900                    | (148)     | (129)     | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,350         | 07.01.2027    | 16.900                    | (148)     | (101)     | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 2,500         | 14.01.2027    | 20.300                    | (181)     | (190)     | (0,02)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                 | 2,500         | 14.01.2027    | 20.300                    | (181)     | (100)     | (0,01)                       |
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 6-Month GBP-SONIA       | Erhalt                                  | 3,150         | 04.12.2025    | 131.800                   | (85)      | (98)      | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 0,008         | 17.12.2029    | 10.900                    | (352)     | (61)      | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                  | 0,008         | 17.12.2029    | 5.500                     | (342)     | (55)      | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                                 | 4,000         | 15.08.2025    | 35.100                    | (229)     | (27)      | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                         |               |               |                           | € (1.888) | € (893)   | (0,09)                       |

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

### DEVISETERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | \$ 5.004                 | \$ 695                           | € 0                                | € (4)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 113                      | NZD 187                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 13.379                   | \$ 1.867                         | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |



| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 08.2025          | NZD 187                | \$ 113                   | € 0                              | € (1)                              | € (1)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF 14.567             | € 15.559                 | 0                                | (31)                               | (31)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 798.027            | \$ 585                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 229.249             | € 201.617                | 6.321                            | 0                                  | 6.321                                                | 0,61                    |
|            | 07.2025          | 609                    | IDR 9.942.040            | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | 289                    | SGD 370                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 369                    | \$ 289                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 207                | 6                        | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF 9.537              | € 10.165                 | 0                                | (42)                               | (42)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK 166.320            | 22.303                   | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK 1.820              | 157                      | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB 762                | \$ 23                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 43.574             | 1.341                    | 0                                | (135)                              | (135)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 740                 | BRL 4.119                | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.460                  | IDR 23.813.077           | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 110                    | THB 3.603                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 418                    | TWD 12.446               | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 7.415              | \$ 1.038                 | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 36.310             | 1.114                    | 0                                | (126)                              | (126)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$ 810                 | INR 70.413               | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 08.2025          | 1.689                  | TWD 49.145               | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 01.2026          | DKK 79.100             | € 10.642                 | 24                               | 0                                  | 24                                                   | 0,00                    |
|            | 04.2026          | 36.200                 | 4.871                    | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF 28                 | 30                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 1.136                | ¥ 185.829                | 0                                | (40)                               | (40)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 976                    | \$ 1.131                 | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 10.762               | € 12.638                 | 75                               | 0                                  | 75                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | ILS 7.130              | \$ 2.048                 | 0                                | (59)                               | (59)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW 110.864            | 81                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK 774                | € 67                     | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN 57                 | \$ 15                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1.016               | ILS 3.429                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 12                     | KRW 17.142               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.050                  | ZAR 18.986               | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD 13.436             | € 8.598                  | 210                              | 0                                  | 210                                                  | 0,02                    |
| CBK        | 07.2025          | € 197                  | NOK 2.332                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 95.270                 | \$ 109.766               | 0                                | (1.760)                            | (1.760)                                              | (0,17)                  |
|            | 07.2025          | KRW 7.230.826          | 5.275                    | 0                                | (61)                               | (61)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | THB 39.853             | 1.198                    | 0                                | (24)                               | (24)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 75.056             | 2.307                    | 0                                | (236)                              | (236)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 11.684              | BRL 69.405               | 880                              | 0                                  | 880                                                  | 0,08                    |
|            | 07.2025          | 1.196                  | IDR 19.481.831           | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 658                    | TWD 19.507               | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 1.593              | \$ 222                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK 2.337              | € 197                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 83.910             | \$ 2.575                 | 0                                | (290)                              | (290)                                                | (0,03)                  |
|            | 08.2025          | \$ 6.066               | INR 522.825              | 17                               | (3)                                | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN 3.239              | \$ 169                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 104.820              | 121.602                  | 0                                | (1.228)                            | (1.228)                                              | (0,12)                  |
|            | 07.2025          | ILS 3.463              | 999                      | 0                                | (25)                               | (25)                                                 | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | KRW 122.726            | 90                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 38                 | 30                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 92                  | IDR 1.493.869            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 161                    | TWD 4.774                | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 10.838             | \$ 1.501                 | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 121.602             | € 104.591                | 1.224                            | 0                                  | 1.224                                                | 0,12                    |
|            | 08.2025          | 2.812                  | INR 242.616              | 10                               | (1)                                | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN 46                 | \$ 2                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL 77.039             | 13.854                   | 0                                | (223)                              | (223)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | CHF 369                | 461                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH 2.546              | 354                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 96                 | 75                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 448                 | CHF 369                  | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2.045                  | PLN 7.542                | 35                               | 0                                  | 35                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 232                    | SGD 296                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 08.2025          | CNH 7.826              | \$ 1.094                 | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 296                | 232                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 461                 | CHF 367                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 1.344                  | INR 116.198              | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 11.518                 | BRL 64.657               | 128                              | 0                                  | 128                                                  | 0,01                    |
|            | 09.2025          | 1.968                  | MXN 38.319               | 37                               | 0                                  | 37                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK 1.724              | € 231                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 8.598                | CAD 13.704               | 0                                | (42)                               | (42)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.837                  | ¥ 299.207                | 0                                | (72)                               | (72)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | TWD 7.077              | \$ 218                   | 0                                | (22)                               | (22)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 284                 | IDR 4.621.181            | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 90                     | SGD 115                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 27                     | TWD 871                  | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD 13.712             | € 8.598                  | 42                               | 0                                  | 42                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 115                | \$ 90                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | CNH 4.823              | 668                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 1.757                | 2.010                    | 0                                | (44)                               | (44)                                                 | 0,00                    |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |         |   |       |       |      |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|---------|---|-------|-------|------|
| MBC                              | 07.2025          | ¥                      | 350.626                  | €                                | 2.077                              | €                                                    | 9                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | KRW                    | 631.941                  | \$                               | 462                                | (5)                                                  | (5)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | NZD                    | 409                      | €                                | 215                                | 0                                                    | 4                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 187                      | \$                               | 112                                | (2)                                                  | (2)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | PLN                    | 612                      |                                  | 163                                | (5)                                                  | (5)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | SGD                    | 2.552                    |                                  | 1.987                              | (14)                                                 | (14)                    | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | TRY                    | 662                      |                                  | 16                                 | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | TWD                    | 44.106                   |                                  | 1.356                              | (138)                                                | (138)                   | (0,01)  |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 562                      | BRL                              | 3.286                              | 0                                                    | 34                      | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 3.680                    | PLN                              | 13.602                             | 0                                                    | 70                      | 0,01    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 189                      | SGD                              | 242                                | 0                                                    | 1                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 301                      | ZAR                              | 5.383                              | 0                                                    | 1                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 12.498                   | \$                               | 1.742                              | (8)                                                  | (8)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | €                      | 2.077                    | ¥                                | 350.084                            | (9)                                                  | (9)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | SGD                    | 242                      | \$                               | 189                                | (1)                                                  | (1)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 43.092                   |                                  | 1.322                              | (149)                                                | (149)                   | (0,01)  |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 906                      | INR                              | 78.532                             | 0                                                    | 7                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          |                        | 68                       | TWD                              | 2.217                              | 0                                                    | 8                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | AUD                    | 453                      | €                                | 258                                | 0                                                    | 5                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | CAD                    | 543                      | \$                               | 395                                | (2)                                                  | (2)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | CHF                    | 6.872                    | €                                | 7.369                              | 0                                                    | 15                      | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | CNH                    | 2.312                    | \$                               | 321                                | (2)                                                  | (2)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | DKK                    | 113.057                  | €                                | 15.160                             | 0                                                    | 6                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | €                      | 66                       | NOK                              | 776                                | (1)                                                  | (1)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 1.203                    | \$                               | 1.376                              | (31)                                                 | (31)                    | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | NZD                    | 215                      | €                                | 114                                | 0                                                    | 2                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | PLN                    | 438                      | \$                               | 117                                | (4)                                                  | (4)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | SGD                    | 6.130                    |                                  | 4.779                              | (29)                                                 | (29)                    | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | THB                    | 20.005                   |                                  | 604                                | (10)                                                 | (10)                    | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | TWD                    | 21.252                   |                                  | 652                                | (68)                                                 | (68)                    | (0,01)  |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 395                      | CAD                              | 543                                | 0                                                    | 2                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 291                      | IDR                              | 4.722.576                          | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 4.995                    | SGD                              | 6.460                              | 65                                                   | 65                      | 0,01    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 30                       | TWD                              | 905                                | 1                                                    | 1                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 6.663                    | \$                               | 927                                | (6)                                                  | (6)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | NOK                    | 778                      | €                                | 66                                 | 0                                                    | 1                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | SGD                    | 6.445                    | \$                               | 4.995                              | (66)                                                 | (66)                    | (0,01)  |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 32.861                   |                                  | 1.014                              | (109)                                                | (109)                   | (0,01)  |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 395                      | CAD                              | 542                                | 0                                                    | 3                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 01.2026          | DKK                    | 36.985                   | €                                | 4.966                              | 0                                                    | 1                       | 0,00    |   |       |       |      |
| MYI                              | 04.2026          |                        | 39.813                   |                                  | 5.350                              | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | €                      | 1.217                    | \$                               | 1.410                              | (16)                                                 | (16)                    | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | £                      | 5.532                    | €                                | 6.564                              | 0                                                    | 106                     | 0,01    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 11                       | PLN                              | 39                                 | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
| RBC                              | 08.2025          | CNH                    | 7.977                    | \$                               | 1.114                              | (3)                                                  | (3)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | SEK                    | 1.630                    | €                                | 149                                | 0                                                    | 3                       | 0,00    |   |       |       |      |
| RYL                              | 07.2025          | €                      | 183                      | \$                               | 211                                | (3)                                                  | (3)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | NOK                    | 1.215                    | €                                | 106                                | 0                                                    | 3                       | 0,00    |   |       |       |      |
| SCX                              | 07.2025          | AUD                    | 44.228                   |                                  | 25.106                             | 0                                                    | 413                     | 0,04    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | €                      | 24.913                   | AUD                              | 44.681                             | 0                                                    | 32                      | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | £                      | 139.983                  | €                                | 166.474                            | 0                                                    | 3.059                   | 0,30    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | ILS                    | 53                       | \$                               | 15                                 | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
| SOG                              | 07.2025          | TWD                    | 2.960                    |                                  | 102                                | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 1.319                    | IDR                              | 21.491.614                         | 4                                                    | 4                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 998                      | SGD                              | 1.287                              | 11                                                   | 11                      | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 272                      | TWD                              | 8.084                              | 5                                                    | 5                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | AUD                    | 44.681                   | €                                | 24.872                             | (35)                                                 | (35)                    | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | CNH                    | 16.647                   | \$                               | 2.329                              | (3)                                                  | (3)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | SGD                    | 1.284                    |                                  | 998                                | (11)                                                 | (11)                    | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | TWD                    | 49.644                   |                                  | 1.520                              | (174)                                                | (174)                   | (0,02)  |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 948                      | INR                              | 81.404                             | (1)                                                  | (1)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | €                      | 3.540                    | CHF                              | 3.310                              | 0                                                    | 3                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | CHF                    | 3.304                    | €                                | 3.540                              | (3)                                                  | (3)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 5                        | INR                              | 469                                | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | €                      | 188.082                  | £                                | 160.502                            | (713)                                                | (713)                   | (0,07)  |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | £                      | 2.059                    | €                                | 2.405                              | 0                                                    | 1                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 08.2025          |                        | 160.832                  |                                  | 188.082                            | 0                                                    | 709                     | 0,07    |   |       |       |      |
| UAG                              | 08.2025          | \$                     | 1.214                    | INR                              | 104.903                            | 5                                                    | 5                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | €                      | 29.006                   | CHF                              | 27.195                             | 98                                                   | 98                      | 0,01    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | ILS                    | 524                      | \$                               | 146                                | (8)                                                  | (8)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | KRW                    | 110.635                  |                                  | 82                                 | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | THB                    | 3.177                    |                                  | 96                                 | (2)                                                  | (2)                     | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 4.203                    | €                                | 3.626                              | 0                                                    | 46                      | 0,00    |   |       |       |      |
|                                  | 07.2025          |                        | 82                       | KRW                              | 110.688                            | 0                                                    | 0                       | 0,00    |   |       |       |      |
| 08.2025                          | CHF              | 27.142                 | €                        | 29.006                           | (99)                               | (99)                                                 | (0,01)                  |         |   |       |       |      |
|                                  |                  |                        |                          |                                  | €                                  | 13.874                                               | €                       | (6.258) | € | 7.616 | 0,74  |      |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |         |   | €     | 7.083 | 0,69 |

| BESCHREIBUNG                               | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|-------------|------------------|-----------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |             |                  |                       |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 12.611   | € 1.289          | 0,13                  |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |             | € 1.289          | 0,13                  |
| Summe Anlagen                              |             | € 1.185.801      | 115,33                |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |             | € (157.657)      | (15,33)               |
| Nettvermögen                               |             | € 1.028.144      | 100,00                |

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

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

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 943 EUR (31. Dezember 2024: null EUR) als Sicherheiten verpfändet.
- (i) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 1.634 EUR (31. Dezember 2024: null EUR) und Barmittel in Höhe von 307 EUR (31. Dezember 2024: 2.860 EUR) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 14.656 EUR (31. Dezember 2024: 13.569 EUR) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert   |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | € 0                                                                         | € 996.715                                                       | € 1.000                                                      | € 997.715   |
| Investmentfonds                     | 100.487                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 100.487     |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 77.900                                                          | 0                                                            | 77.900      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 515                                                                         | 7.895                                                           | 0                                                            | 8.410       |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 1.289                                                           | 0                                                            | 1.289       |
| Summen                              | € 101.002                                                                   | € 1.083.799                                                     | € 1.000                                                      | € 1.185.801 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert   |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | € 0                                                                      | € 944.601                                                       | € 0                                                          | € 944.601   |
| Investmentfonds                     | 0                                                                        | 92.956                                                          | 0                                                            | 92.956      |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                        | 22.100                                                          | 0                                                            | 22.100      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 813                                                                      | (3.331)                                                         | 0                                                            | (2.518)     |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                        | 85                                                              | 0                                                            | 85          |
| Summen                              | € 813                                                                    | € 1.056.411                                                     | € 0                                                          | € 1.057.224 |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettvermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|------------------------|
| MYI                                | 1,500 %    | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (905)      | € (905)                                     | (0,09)                 |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | € (905)                                     | (0,09)                 |

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

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | € (11)                              | € 0                                   | € (11)                          | € 7                                 | € 0                                   | € 7                             |
| BOA        | 6.287                               | (6.050)                               | 237                             | (1.085)                             | 520                                   | (565)                           |
| BPS        | (208)                               | 282                                   | 74                              | (229)                               | 270                                   | 41                              |
| BRC        | (152)                               | 0                                     | (152)                           | (43)                                | 0                                     | (43)                            |
| CBK        | (1.255)                             | 1.240                                 | (15)                            | 135                                 | 0                                     | 135                             |
| DUB        | (33)                                | 0                                     | (33)                            | 181                                 | (251)                                 | (70)                            |
| FAR        | (8)                                 | 0                                     | (8)                             | 1                                   | 0                                     | 1                               |
| GLM        | (610)                               | 0                                     | (610)                           | (98)                                | 0                                     | (98)                            |
| JPM        | (246)                               | 264                                   | 18                              | 173                                 | 0                                     | 173                             |
| MBC        | (227)                               | 112                                   | (115)                           | (1.554)                             | 1.080                                 | (474)                           |
| MYC        | 146                                 | (682)                                 | (536)                           | (190)                               | (512)                                 | (702)                           |
| MYI        | 60                                  | 43                                    | 103                             | (23)                                | 10                                    | (13)                            |
| RBC        | 3                                   | 0                                     | 3                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (50)                                | 0                                     | (50)                            |
| SCX        | 3.300                               | (2.922)                               | 378                             | (475)                               | 430                                   | (45)                            |
| SOG        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (17)                                | 0                                     | (17)                            |
| SSB        | 2                                   | 0                                     | 2                               | 2                                   | 0                                     | 2                               |
| UAG        | 35                                  | 0                                     | 35                              | (505)                               | 550                                   | 45                              |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 49,21             | 50,42             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 21,92             | 25,64             |
| Investmentfonds                                                        | 7,16              | 7,48              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 5,55              | 1,78              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,11              | 0,23              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,18              | 0,19              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,01              | 0,04              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,09              | 0,13              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 14,77             | 14,09             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                      | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                           | 21,41             | 33,12             |
| US-Regierungsbehörden                                      | 15,35             | 14,24             |
| US-Schatzobligationen                                      | 7,76              | 7,09              |
| Non-Agency-MBS                                             | 6,95              | 5,88              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                           | 14,52             | 17,39             |
| Staatsemissionen                                           | 27,78             | 20,81             |
| Vorzugswertpapiere                                         | 0,33              | 0,37              |
| Kurzfristige Instrumente                                   | 2,93              | k. A.             |
| Investmentfonds                                            | 9,77              | 9,73              |
| Pensionsgeschäfte                                          | 7,58              | 2,31              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                   |                   |
| Futures                                                    | 0,02              | 0,21              |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                        |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf        | 0,00              | 0,01              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf     | 0,01              | (0,01)            |
| Zinsswaps                                                  | 0,10              | (0,08)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                 |                   |                   |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | 0,04              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | (0,09)            | (0,04)            |
| Devisenterminkontrakte                                     | 0,74              | (0,35)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                        | 0,13              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                | (15,33)           | (10,69)           |
| Nettovermögen                                              | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S)                                 | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S)                      | MARKT-<br>WERT<br>(000S)         | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |       |      |      |
|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------|------------------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------|-------|------|------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                    |                |                          |                                   | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE             |                                                |                          |                                   | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                 |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| ARGENTINIEN                                 |                |                          |                                   | KAIMANINSELN                                 |                                                |                          |                                   | DOMINIKANISCHE REPUBLIK                          |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| STAATSEMISSIONEN                            |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |                                                |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                                 |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Argentina Government International Bond     |                |                          |                                   | Atlas Senior Loan Fund Ltd.                  |                                                |                          |                                   | Dominican Republic Government International Bond |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| 0,750 % fällig am 09.07.2030                | \$             | 224                      | 163                               | 0,04                                         | 5,608 % fällig am 15.01.2031                   | \$                       | 88                                | 88                                               | 0,02                                | 4,875 % fällig am 23.09.2032     | \$                                | 600   | 556  | 0,13 |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029                |                | 2                        | 2                                 | 0,00                                         | Barings CLO Ltd.                               |                          |                                   |                                                  |                                     | 6,600 % fällig am 01.06.2036     | 1.000                             | 1.008 | 0,23 |      |
| 4,125 % fällig am 09.07.2035                |                | 91                       | 59                                | 0,01                                         | 5,521 % fällig am 20.01.2031                   |                          | 317                               | 317                                              | 0,07                                | 7,050 % fällig am 03.02.2031     |                                   | 400   | 420  | 0,09 |
| Summe Argentinien                           |                | 224                      | 0,05                              | Summe Kanada                                 |                                                | 14.516                   | 3,29                              | Summe Dänemark                                   |                                     | 3.558                            | 0,81                              |       |      |      |
| AUSTRALIEN                                  |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |                                                |                          |                                   | Ecuador Government International Bond            |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Bank of Queensland Ltd.                     |                |                          |                                   | Gaci First Investment Co.                    |                                                |                          |                                   | ÄGYPTEN                                          |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| 3,300 % fällig am 30.07.2029                | €              | 1.400                    | 1.686                             | 0,38                                         | 4,750 % fällig am 14.02.2030                   | 1.400                    | 1.407                             | 0,32                                             | STAATSEMISSIONEN                    |                                  |                                   |       |      |      |
| Commonwealth Bank of Australia              |                | 900                      | 1.067                             | 0,24                                         | 4,875 % fällig am 14.02.2035                   | 1.200                    | 1.176                             | 0,27                                             | Egypt Government International Bond |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,907 % fällig am 11.11.2030                |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 29.01.2029                 | 1.500                                          | 1.517                    | 0,34                              | 21,954 % fällig am                               |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Macquarie Bank Ltd.                         |                | 500                      | 591                               | 0,13                                         | 5,125 % fällig am 14.02.2053                   | 700                      | 600                               | 0,14                                             | 04.03.2028                          |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,778 % fällig am 25.02.2030                |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 29.01.2030                 | 1.800                                          | 1.839                    | 0,42                              | EGP                                              |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| National Australia Bank Ltd.                |                | 1.100                    | 1.289                             | 0,29                                         | 5,250 % fällig am 29.01.2034                   | 1.000                    | 1.010                             | 0,23                                             | 45.900                              |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,845 % fällig am 03.03.2032                |                | 2.600                    | 3.112                             | 0,71                                         | 5,625 % fällig am 29.07.2034                   | 1.000                    | 1.035                             | 0,23                                             | 914                                 |                                  |                                   |       |      |      |
| 3,146 % fällig am 05.02.2031                |                |                          |                                   | Summe Kaimaninseln                           |                                                | 12.171                   | 2,76                              | 0,21                                             |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Westpac Banking Corp.                       |                | 2.600                    | 3.109                             | 0,71                                         | Summe Australien                               |                          | 20.721                            | 4,70                                             | FINNLAND                            |                                  |                                   |       |      |      |
| 3,131 % fällig am 15.04.2031                |                | 700                      | 703                               | 0,16                                         |                                                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                 |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| 4,184 % fällig am 22.05.2028                | \$             |                          |                                   |                                              |                                                |                          |                                   | SP-Kiinnitysluottopankki Oyj                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Summe Argentinien                           |                | 224                      | 0,05                              |                                              |                                                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 02.05.2031                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| STAATSEMISSIONEN                            |                |                          |                                   |                                              |                                                |                          |                                   | €                                                |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Australia Government International Bond     |                | 1.218                    | 1.735                             | 0,39                                         | CHILE                                          |                          |                                   |                                                  | 400                                 |                                  |                                   |       |      |      |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027                | AUD            | 700                      | 249                               | 0,06                                         | STAATSEMISSIONEN                               |                          |                                   |                                                  | 481                                 |                                  |                                   |       |      |      |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051                |                | 500                      | 314                               | 0,07                                         | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos |                          |                                   |                                                  | 0,11                                |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,500 % fällig am 21.05.2030                |                |                          |                                   | Chile Government International Bond          |                                                |                          |                                   | FRANKREICH                                       |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| New South Wales Treasury Corp.              |                | 1.300                    | 673                               | 0,15                                         | 4,850 % fällig am 22.01.2029                   | \$                       | 800                               | 812                                              | 0,19                                | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL |                                   |       |      |      |
| 1,750 % fällig am 20.03.2034                |                | 600                      | 330                               | 0,08                                         | Summe Chile                                    |                          | 2.012                             | 0,46                                             | BNP Paribas S.A.                    |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,000 % fällig am 08.03.2033                |                |                          |                                   | KOLUMBIEN                                    |                                                |                          |                                   | 3,583 % fällig am 15.01.2031                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Queensland Treasury Corp.                   |                | 500                      | 270                               | 0,06                                         | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |                          |                                   |                                                  | 1.100                               |                                  |                                   |       |      |      |
| 1,500 % fällig am 20.08.2032                |                | 1.500                    | 764                               | 0,17                                         | Ecopetrol S.A.                                 |                          |                                   |                                                  | 1.315                               |                                  |                                   |       |      |      |
| 1,750 % fällig am 20.07.2034                |                | 4.200                    | 2.267                             | 0,52                                         | 8,375 % fällig am 19.01.2036                   | 1.250                    | 1.207                             | 0,27                                             | 0,30                                |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,000 % fällig am 22.08.2033                |                | 800                      | 533                               | 0,12                                         | Summe Kolumbien                                |                          | 3.229                             | 0,73                                             | BPCE S.A.                           |                                  |                                   |       |      |      |
| 5,250 % fällig am 21.07.2036                |                |                          |                                   | TSCHECHISCHE REPUBLIK                        |                                                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 11.01.2029                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Treasury Corp. of Victoria                  |                | 1.000                    | 500                               | 0,11                                         | STAATSEMISSIONEN                               |                          |                                   |                                                  | 3,875 % fällig am 26.02.2036        |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,000 % fällig am 17.09.2035                |                | 1.600                    | 880                               | 0,20                                         | Czech Republic Government International Bond   |                          |                                   |                                                  | 5,936 % fällig am 30.05.2035        |                                  |                                   |       |      |      |
| 2,250 % fällig am 15.09.2033                |                | 1.000                    | 649                               | 0,15                                         | 0,950 % fällig am 15.05.2030                   | CZK                      | 12.100                            | 504                                              | 0,11                                | \$                               |                                   |       |      |      |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032                |                |                          |                                   | DÄNEMARK                                     |                                                |                          |                                   | Cie de Financement Foncier S.A.                  |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Summe Australien                            |                | 20.721                   | 4,70                              | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |                                                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 24.04.2032                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| BELGIEN                                     |                |                          |                                   | Jyske Realkredit A/S                         |                                                |                          |                                   | €                                                |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL            |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.04.2026                 |                                                |                          |                                   | 800                                              |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Belfius Bank S.A.                           | €              | 900                      | 1.063                             | 0,24                                         | 1,000 % fällig am 01.10.2050                   |                          | 0                                 | 0                                                | 0,00                                | 941                              |                                   |       |      |      |
| ING Belgium S.A.                            |                | 800                      | 953                               | 0,22                                         | TSCHECHISCHE REPUBLIK                          |                          |                                   |                                                  | 0,21                                |                                  |                                   |       |      |      |
| 3,000 % fällig am 15.02.2031                |                |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                             |                                                |                          |                                   | Credit Agricole Home Loan SFH S.A.               |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Summe Belgien                               |                | 2.016                    | 0,46                              | Czech Republic Government International Bond |                                                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.12.2030                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| KANADA                                      |                |                          |                                   | Czech Republic Government International Bond |                                                |                          |                                   | Credit Agricole S.A.                             |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL            |                |                          |                                   | DÄNEMARK                                     |                                                |                          |                                   | 5,862 % fällig am 09.01.2036                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Air Canada Pass-Through Trust               | \$             | 334                      | 313                               | 0,07                                         | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL               |                          |                                   |                                                  | \$                                  |                                  |                                   |       |      |      |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031                |                |                          |                                   | Jyske Realkredit A/S                         |                                                |                          |                                   | 1.800                                            |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Fairfax Financial Holdings Ltd.             | €              | 400                      | 467                               | 0,11                                         | 1,000 % fällig am 01.04.2026                   | DKK                      | 13.500                            | 2.111                                            | 0,48                                | 1.867                            |                                   |       |      |      |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028                |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050                 |                                                | 0                        | 0                                 | 0,00                                             | 0,43                                |                                  |                                   |       |      |      |
| Federation des Caisses Desjardins du Quebec | \$             | 1.000                    | 1.037                             | 0,23                                         | TSCHECHISCHE REPUBLIK                          |                          |                                   |                                                  | 6.915                               |                                  |                                   |       |      |      |
| 5,147 % fällig am 27.11.2028                |                |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                             |                                                |                          |                                   | 1,57                                             |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Toronto-Dominion Bank                       | €              | 1.600                    | 1.924                             | 0,44                                         | France Government International Bond           |                          |                                   |                                                  | STAATSEMISSIONEN                    |                                  |                                   |       |      |      |
| 3,191 % fällig am 16.02.2029                |                |                          |                                   | 0,100 % fällig am                            |                                                |                          |                                   | France Government International Bond             |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| 5,298 % fällig am 30.01.2032                | \$             | 1.600                    | 1.643                             | 0,37                                         | 25.07.2031 (e)                                 |                          |                                   |                                                  | 0,100 % fällig am                   |                                  |                                   |       |      |      |
| Summe Kanada                                |                |                          |                                   | 5,384                                        | 1,22                                           | €                        |                                   |                                                  |                                     | 0,46                             |                                   |       |      |      |
| STAATSEMISSIONEN                            |                |                          |                                   | France Government International Bond         |                                                |                          |                                   | Credit Agricole S.A.                             |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Canadian Government Real Return Bond        |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 25.05.2072                 |                                                |                          |                                   | Credit Agricole S.A.                             |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| 1,500 % fällig am                           |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 25.02.2028                 |                                                |                          |                                   | 5,862 % fällig am 09.01.2036                     |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| 01.12.2044 (e)                              | CAD            | 2.686                    | 1.936                             | 0,44                                         | 0,750 % fällig am 25.05.2052                   |                          |                                   |                                                  | \$                                  |                                  |                                   |       |      |      |
| Export Development Canada                   | INR            | 62.600                   | 743                               | 0,17                                         |                                                |                          |                                   |                                                  | 1.800                               |                                  |                                   |       |      |      |
| 7,130 % fällig am 11.03.2029                |                |                          |                                   |                                              |                                                |                          |                                   | 1.867                                            |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| Province of British Columbia                |                |                          |                                   |                                              |                                                |                          |                                   | 0,43                                             |                                     |                                  |                                   |       |      |      |
| 4,150 % fällig am 18.06.2034                | CAD            | 900                      | 680                               | 0,15                                         |                                                |                          |                                   |                                                  | 6.915                               |                                  |                                   |       |      |      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

|                                                |             |                   |                       | % DES NETTO-VERMÖGENS                   |                               |                   |                       |        |      |
|------------------------------------------------|-------------|-------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------------------------|-------------------|-----------------------|--------|------|
| BESCHREIBUNG                                   | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS | BESCHREIBUNG                            | PARI (000S)                   | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |        |      |
| 2,750 % fällig am 25.10.2027                   | €           | 2.650             | \$ 3.159              | 0,72                                    | OCF Euro CLO DAC              | €                 | 593                   | \$ 695 | 0,16 |
| 2,750 % fällig am 25.02.2030                   |             | 9.900             | 11.742                | 2,66                                    | 3,116 % fällig am 22.09.2034  |                   |                       |        |      |
|                                                |             |                   | 20.632                | 4,68                                    | Rockford Tower Europe CLO DAC |                   |                       |        |      |
|                                                |             |                   | 27.547                | 6,25                                    | 3,561 % fällig am 24.04.2037  | 500               | 587                   | 0,13   |      |
| Summe Frankreich                               |             |                   |                       |                                         | Sculptor European CLO DAC     |                   |                       |        |      |
|                                                |             |                   |                       |                                         | 3,055 % fällig am 14.01.2032  | 887               | 1.040                 | 0,24   |      |
|                                                |             |                   |                       |                                         |                               | 16.199            | 3,67                  |        |      |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                             |             |                   |                       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Deutsche Bank AG</b>                        |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 3,035 % fällig am 28.05.2032                   | \$          | 1.050             | 942                   | 0,21                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>GUATEMALA</b>                               |             |                   |                       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Guatemala Government International Bond</b> |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 5,375 % fällig am 24.04.2032                   |             | 400               | 392                   | 0,09                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>UNGARN</b>                                  |             |                   |                       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Hungary Government International Bond</b>   |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 4,500 % fällig am 16.06.2034                   | €           | 200               | 237                   | 0,05                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 4,875 % fällig am 22.03.2040                   |             | 300               | 345                   | 0,08                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 5,375 % fällig am 12.09.2033                   |             | 1.300             | 1.645                 | 0,37                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 5,500 % fällig am 26.03.2036                   | \$          | 800               | 773                   | 0,18                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 6,250 % fällig am 22.09.2032                   |             | 900               | 941                   | 0,21                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 6,750 % fällig am 25.09.2052                   |             | 500               | 510                   | 0,12                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Magyar Export-Import Bank</b>               |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 4,500 % fällig am 27.11.2031                   | €           | 700               | 836                   | 0,19                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 6,125 % fällig am 04.12.2027                   | \$          | 900               | 922                   | 0,21                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>MTB Magyar Fejlesztési Bank Zrt</b>         |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 4,375 % fällig am 27.06.2030                   | €           | 1.000             | 1.191                 | 0,27                                    |                               |                   |                       |        |      |
| Summe Ungarn                                   |             |                   | 7.400                 | 1,68                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>INDIEN</b>                                  |             |                   |                       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                               |                   |                       |        |      |
| <b>IRB Infrastructure Developers Ltd.</b>      |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 7,110 % fällig am 11.03.2032                   | \$          | 1.100             | 1.104                 | 0,25                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>INDONESIEN</b>                              |             |                   |                       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Indonesia Government International Bond</b> |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 4,125 % fällig am 15.01.2037                   | €           | 400               | 476                   | 0,11                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 5,600 % fällig am 15.01.2035                   | \$          | 400               | 418                   | 0,09                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 8,375 % fällig am 15.03.2034                   | IDR         | 22.982.000        | 1.576                 | 0,36                                    |                               |                   |                       |        |      |
| Summe Indonesien                               |             |                   | 2.470                 | 0,56                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>IRLAND</b>                                  |             |                   |                       | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Accunia European CLO DAC</b>                |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 3,229 % fällig am 15.07.2030                   | €           | 110               | 129                   | 0,03                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Ares European CLO DAC</b>                   |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 3,059 % fällig am 15.10.2031                   |             | 544               | 638                   | 0,14                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Aurium CLO DAC</b>                          |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,982 % fällig am 16.01.2031                   |             | 1.053             | 1.235                 | 0,28                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>                    |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 3,056 % fällig am 22.07.2032                   |             | 999               | 1.169                 | 0,27                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Carlyle Euro CLO DAC</b>                    |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,979 % fällig am 15.01.2031                   |             | 572               | 672                   | 0,15                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Dryden Euro CLO DAC</b>                     |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,939 % fällig am 15.04.2033                   |             | 528               | 620                   | 0,14                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 3,003 % fällig am 15.05.2034                   |             | 720               | 844                   | 0,19                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Euro-Galaxy CLO DAC</b>                     |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,988 % fällig am 25.07.2035                   |             | 800               | 935                   | 0,21                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Harvest CLO DAC</b>                         |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,916 % fällig am 20.10.2031                   |             | 573               | 673                   | 0,15                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 3,039 % fällig am 15.07.2031                   |             | 818               | 961                   | 0,22                                    |                               |                   |                       |        |      |
| 3,129 % fällig am 15.01.2032                   |             | 1.034             | 1.213                 | 0,28                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Invesco Euro CLO DAC</b>                    |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 3,299 % fällig am 15.01.2034                   |             | 1.800             | 2.109                 | 0,48                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Jubilee CLO DAC</b>                         |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,929 % fällig am 15.04.2031                   |             | 389               | 456                   | 0,10                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Madison Park Euro Funding DAC</b>           |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 3,079 % fällig am 15.07.2032                   |             | 1.097             | 1.284                 | 0,29                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Man GLG Euro CLO DAC</b>                    |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,665 % fällig am 15.12.2031                   |             | 261               | 305                   | 0,07                                    |                               |                   |                       |        |      |
| <b>Oak Hill European Credit Partners DAC</b>   |             |                   |                       |                                         |                               |                   |                       |        |      |
| 2,976 % fällig am 20.10.2031                   |             | 540               | 634                   | 0,14                                    |                               |                   |                       |        |      |

|                                               |             |                   |                       | % DES NETTO-VERMÖGENS                   |             |                   |                       |  |
|-----------------------------------------------|-------------|-------------------|-----------------------|-----------------------------------------|-------------|-------------------|-----------------------|--|
| BESCHREIBUNG                                  | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS | BESCHREIBUNG                            | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |  |
| 1,500 % fällig am 20.09.2043                  | ¥           | 186.000           | \$ 1.142              | 0,26                                    |             |                   |                       |  |
| 1,800 % fällig am 20.03.2054                  |             | 9.000             | 50                    | 0,01                                    |             |                   |                       |  |
| 2,000 % fällig am 20.12.2044                  |             | 190.000           | 1.246                 | 0,28                                    |             |                   |                       |  |
| 2,200 % fällig am 20.06.2054                  |             | 93.000            | 567                   | 0,13                                    |             |                   |                       |  |
| 2,200 % fällig am 20.03.2064                  |             | 193.000           | 1.074                 | 0,24                                    |             |                   |                       |  |
| 2,300 % fällig am 20.12.2054                  |             | 422.000           | 2.626                 | 0,60                                    |             |                   |                       |  |
| 2,400 % fällig am 20.03.2045                  |             | 338.000           | 2.356                 | 0,54                                    |             |                   |                       |  |
| 2,400 % fällig am 20.03.2055                  |             | 325.000           | 2.067                 | 0,47                                    |             |                   |                       |  |
|                                               |             |                   | 30.218                | 6,86                                    |             |                   |                       |  |
| Summe Japan                                   |             |                   | 37.326                | 8,47                                    |             |                   |                       |  |
| <b>KASACHSTAN</b>                             |             |                   |                       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |             |                   |                       |  |
| <b>KazMunayGas National Co. JSC</b>           |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 3,500 % fällig am 14.04.2033                  | \$          | 1.550             | 1.346                 | 0,31                                    |             |                   |                       |  |
| 5,750 % fällig am 19.04.2047                  |             | 200               | 174                   | 0,04                                    |             |                   |                       |  |
| 6,375 % fällig am 24.10.2048                  |             | 400               | 371                   | 0,08                                    |             |                   |                       |  |
| Summe Kasachstan                              |             |                   | 1.891                 | 0,43                                    |             |                   |                       |  |
|                                               |             |                   |                       | <b>AKTIEN</b>                           |             |                   |                       |  |
| <b>LUXEMBURG</b>                              |             |                   |                       | <b>STAMMAKTIONEN</b>                    |             |                   |                       |  |
| <b>DrillCo Holding Lux S.A. (h)</b>           |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
|                                               |             | 16.048            | 329                   | 0,08                                    |             |                   |                       |  |
| <b>Foresea Holding S.A. 'A'</b>               |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
|                                               |             | 6.700             | 137                   | 0,03                                    |             |                   |                       |  |
|                                               |             |                   | 466                   | 0,11                                    |             |                   |                       |  |
|                                               |             |                   |                       | <b>PARI (000S)</b>                      |             |                   |                       |  |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| <b>Chile Electricity Lux MPC SARL</b>         |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 6,010 % fällig am 20.01.2033                  | \$          | 930               | 965                   | 0,22                                    |             |                   |                       |  |
| <b>FORESEA Holding S.A.</b>                   |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 7,500 % fällig am 15.06.2030                  |             | 284               | 270                   | 0,06                                    |             |                   |                       |  |
|                                               |             |                   | 1.235                 | 0,28                                    |             |                   |                       |  |
| Summe Luxemburg                               |             |                   | 1.701                 | 0,39                                    |             |                   |                       |  |
| <b>MALAYSIA</b>                               |             |                   |                       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |             |                   |                       |  |
| <b>Petronas Capital Ltd.</b>                  |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 2,480 % fällig am 28.01.2032                  |             | 500               | 436                   | 0,10                                    |             |                   |                       |  |
| 3,500 % fällig am 21.04.2030                  |             | 200               | 192                   | 0,04                                    |             |                   |                       |  |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050                  |             | 200               | 170                   | 0,04                                    |             |                   |                       |  |
| 4,800 % fällig am 21.04.2060                  |             | 200               | 172                   | 0,04                                    |             |                   |                       |  |
|                                               |             |                   | 970                   | 0,22                                    |             |                   |                       |  |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| <b>Malaysia Government International Bond</b> |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 2,632 % fällig am 15.04.2031MYR               |             | 2.100             | 481                   | 0,11                                    |             |                   |                       |  |
| 3,519 % fällig am 20.04.2028                  |             | 4.621             | 1.109                 | 0,25                                    |             |                   |                       |  |
| 4,762 % fällig am 07.04.2037                  |             | 1.000             | 263                   | 0,06                                    |             |                   |                       |  |
|                                               |             |                   | 1.853                 | 0,42                                    |             |                   |                       |  |
| Summe Malaysia                                |             |                   | 2.823                 | 0,64                                    |             |                   |                       |  |
| <b>MEXIKO</b>                                 |             |                   |                       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |             |                   |                       |  |
| <b>Mexico Government International Bond</b>   |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 4,490 % fällig am 25.05.2032                  | €           | 1.800             | 2.141                 | 0,49                                    |             |                   |                       |  |
| 5,850 % fällig am                             |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 02.07.2032 (b)                                | \$          | 900               | 912                   | 0,21                                    |             |                   |                       |  |
| 6,625 % fällig am                             |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 29.01.2038 (b)                                |             | 800               | 813                   | 0,18                                    |             |                   |                       |  |
| Summe Mexiko                                  |             |                   | 3.866                 | 0,88                                    |             |                   |                       |  |
| <b>MULTINATIONAL</b>                          |             |                   |                       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |             |                   |                       |  |
| <b>Preferred Term Securities Ltd.</b>         |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 4,972 % fällig am 23.06.2035                  |             | 516               | 492                   | 0,11                                    |             |                   |                       |  |
| <b>NIEDERLANDE</b>                            |             |                   |                       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |             |                   |                       |  |
| <b>Cooperatieve Rabobank UA</b>               |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033                  |             | 400               | 374                   | 0,08                                    |             |                   |                       |  |
| 5,447 % fällig am 05.03.2030                  |             | 1.300             | 1.341                 | 0,30                                    |             |                   |                       |  |
| <b>de Volksbank NV</b>                        |             |                   |                       |                                         |             |                   |                       |  |
| 3,000 % fällig am 26.03.2031                  | €           | 1.100             | 1.309                 | 0,30                                    |             |                   |                       |  |



| BESCHREIBUNG                  |    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------|----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Enel Finance International NV |    |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 23.07.2028  | €  | 500            | \$ 601                   | 0,14                              |
| ING Groep NV                  |    |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 12.02.2035  |    | 300            | 364                      | 0,08                              |
| Prosus NV                     |    |                |                          |                                   |
| 1,207 % fällig am 19.01.2026  |    | 600            | 700                      | 0,16                              |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027  | \$ | 1.600          | 1.567                    | 0,36                              |
|                               |    |                | 6.256                    | 1,42                              |

**NON-AGENCY-MBS**

|                              |   |     |       |      |
|------------------------------|---|-----|-------|------|
| Jubilee Place BV             |   |     |       |      |
| 3,263 % fällig am 17.10.2057 | € | 291 | 342   | 0,08 |
| Summe Niederlande            |   |     | 6.598 | 1,50 |

**NEUSEELAND****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                              |  |       |       |      |
|------------------------------|--|-------|-------|------|
| ASB Bank Ltd.                |  |       |       |      |
| 2,971 % fällig am 27.03.2030 |  | 1.300 | 1.547 | 0,35 |

**STAATSEMISSIONEN**

|                                           |     |     |       |      |
|-------------------------------------------|-----|-----|-------|------|
| New Zealand Government International Bond |     |     |       |      |
| 1,500 % fällig am 15.05.2031              | NZD | 200 | 105   | 0,02 |
| Summe Neuseeland                          |     |     | 1.652 | 0,37 |

**NORWEGEN****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                              |   |     |       |      |
|------------------------------|---|-----|-------|------|
| SR-Boligkredit A/S           |   |     |       |      |
| 3,125 % fällig am 19.02.2032 | € | 900 | 1.075 | 0,24 |

**STAATSEMISSIONEN**

|                              |     |     |       |      |
|------------------------------|-----|-----|-------|------|
| Kommunalbanken A/S           |     |     |       |      |
| 1,900 % fällig am 19.01.2027 | AUD | 400 | 256   | 0,06 |
| Summe Norwegen               |     |     | 1.331 | 0,30 |

**PERU****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                                              |     |       |       |      |
|----------------------------------------------|-----|-------|-------|------|
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |     |       |       |      |
| 10,100 % fällig am 15.12.2043                | PEN | 8.000 | 2.395 | 0,54 |

**STAATSEMISSIONEN**

|                                    |     |        |       |      |
|------------------------------------|-----|--------|-------|------|
| Peru Government International Bond |     |        |       |      |
| 5,375 % fällig am 08.02.2035       | \$  | 500    | 500   | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 08.08.2054       |     | 900    | 870   | 0,20 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032       | PEN | 3.900  | 1.137 | 0,26 |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033       |     | 12.800 | 3.936 | 0,89 |
| 7,600 % fällig am 12.08.2039       |     | 2.400  | 722   | 0,17 |
|                                    |     |        | 7.165 | 1,63 |
| Summe Peru                         |     |        | 9.560 | 2,17 |

**PHILIPPINEN****STAATSEMISSIONEN**

|                                           |     |        |     |      |
|-------------------------------------------|-----|--------|-----|------|
| Philippines Government International Bond |     |        |     |      |
| 6,250 % fällig am 14.01.2036              | PHP | 21.000 | 365 | 0,08 |

**POLEN****STAATSEMISSIONEN**

|                                      |    |       |       |      |
|--------------------------------------|----|-------|-------|------|
| Bank Gospodarstwa Krajowego          |    |       |       |      |
| 4,000 % fällig am 13.03.2032         | €  | 300   | 363   | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 18.03.2037         |    | 500   | 591   | 0,14 |
| Poland Government International Bond |    |       |       |      |
| 3,625 % fällig am 11.01.2034 (i)     |    | 600   | 721   | 0,16 |
| 3,875 % fällig am 14.02.2033         |    | 1.300 | 1.601 | 0,36 |
| 4,125 % fällig am 11.01.2044         |    | 300   | 349   | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 14.02.2043         |    | 900   | 1.060 | 0,24 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2030         | \$ | 900   | 919   | 0,21 |
| 5,375 % fällig am 12.02.2035         |    | 600   | 612   | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 04.04.2053         |    | 300   | 280   | 0,06 |
| Summe Polen                          |    |       | 6.496 | 1,47 |

**PORTUGAL****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                                |   |       |     |      |
|--------------------------------|---|-------|-----|------|
| Banco Espírito Santo S.A.      |   |       |     |      |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € | 1.900 | 524 | 0,12 |

|                                |   |                |                          |                                   |
|--------------------------------|---|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| BESCHREIBUNG                   |   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | € | 600            | \$ 166                   | 0,04                              |
| Summe Portugal                 |   |                | 690                      | 0,16                              |

**RUMÄNIEN****STAATSEMISSIONEN**

|                                       |  |       |       |      |
|---------------------------------------|--|-------|-------|------|
| Romania Government International Bond |  |       |       |      |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029          |  | 360   | 370   | 0,08 |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030          |  | 1.300 | 1.312 | 0,30 |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032          |  | 100   | 95    | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033          |  | 600   | 541   | 0,12 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040          |  | 100   | 73    | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041          |  | 400   | 293   | 0,07 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042          |  | 300   | 220   | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 24.09.2031          |  | 1.600 | 1.856 | 0,42 |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030          |  | 500   | 600   | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 22.02.2036          |  | 100   | 112   | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 10.09.2034          |  | 400   | 475   | 0,11 |
| 6,375 % fällig am 18.09.2033          |  | 500   | 605   | 0,14 |
| 6,625 % fällig am 27.09.2029          |  | 500   | 633   | 0,14 |
| Summe Rumänien                        |  |       | 7.185 | 1,63 |

**SAUDI-ARABIEN****STAATSEMISSIONEN**

|                                            |    |       |       |      |
|--------------------------------------------|----|-------|-------|------|
| Saudi Arabia Government International Bond |    |       |       |      |
| 3,375 % fällig am 05.03.2032               |    | 1.100 | 1.287 | 0,29 |
| 3,750 % fällig am 05.03.2037 (i)           |    | 500   | 572   | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 18.07.2033               | \$ | 600   | 603   | 0,14 |
| 5,000 % fällig am 16.01.2034               |    | 1.200 | 1.203 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 18.01.2053               |    | 400   | 342   | 0,08 |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028               |    | 1.100 | 1.119 | 0,25 |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031               |    | 600   | 623   | 0,14 |
| Summe Saudi-Arabien                        |    |       | 5.749 | 1,30 |

**SENEGAL****STAATSEMISSIONEN**

|                                       |  |       |       |      |
|---------------------------------------|--|-------|-------|------|
| Senegal Government International Bond |  |       |       |      |
| 7,750 % fällig am 10.06.2031          |  | 1.400 | 1.028 | 0,23 |

**SERBIEN****STAATSEMISSIONEN**

|                                      |    |       |       |      |
|--------------------------------------|----|-------|-------|------|
| Serbia Government International Bond |    |       |       |      |
| 1,650 % fällig am 03.03.2033         | €  | 700   | 675   | 0,15 |
| 2,050 % fällig am 23.09.2036         |    | 400   | 357   | 0,08 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2027         |    | 2.500 | 2.924 | 0,67 |
| 6,000 % fällig am 12.06.2034         | \$ | 1.700 | 1.719 | 0,39 |
| Summe Serbien                        |    |       | 5.675 | 1,29 |

**SINGAPUR****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                                        |   |       |       |      |
|----------------------------------------|---|-------|-------|------|
| CapitaLand Ascendas REIT               |   |       |       |      |
| 0,750 % fällig am 23.06.2028           | € | 1.000 | 1.088 | 0,25 |
| Standard Chartered Bank Singapore Ltd. |   |       |       |      |
| 2,595 % fällig am 02.10.2028           |   | 800   | 944   | 0,21 |
|                                        |   |       | 2.032 | 0,46 |

**STAATSEMISSIONEN**

|                                         |     |       |       |      |
|-----------------------------------------|-----|-------|-------|------|
| Singapore Government International Bond |     |       |       |      |
| 2,375 % fällig am 01.07.2039            | SGD | 190   | 150   | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 01.03.2035            |     | 1.740 | 1.430 | 0,33 |
| 3,250 % fällig am 01.06.2054            |     | 2.369 | 2.214 | 0,50 |
|                                         |     |       | 3.794 | 0,86 |
| Summe Singapur                          |     |       | 5.826 | 1,32 |

**SÜDAFRIKA****STAATSEMISSIONEN**

|                                            |     |         |       |      |
|--------------------------------------------|-----|---------|-------|------|
| South Africa Government International Bond |     |         |       |      |
| 5,375 % fällig am 24.07.2044               | \$  | 300     | 229   | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2049               |     | 200     | 151   | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030               | ZAR | 48.200  | 2.667 | 0,61 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035               |     | 102.500 | 5.386 | 1,22 |
| Summe Südafrika                            |     |         | 8.433 | 1,91 |

**SÜDKOREA****STAATSEMISSIONEN**

|                              |    |       |       |      |
|------------------------------|----|-------|-------|------|
| Korea Development Bank       |    |       |       |      |
| 4,625 % fällig am 15.02.2027 | \$ | 1.300 | 1.309 | 0,30 |

|                              |    |                |                          |                                   |
|------------------------------|----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| BESCHREIBUNG                 |    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
| Korea Housing Finance Corp.  |    |                |                          |                                   |
| 3,124 % fällig am 18.03.2029 | €  | 1.700          | \$ 2.034                 | 0,46                              |
| 4,875 % fällig am 27.08.2027 | \$ | 1.700          | 1.725                    | 0,39                              |

**South Korea Government International Bond**

|                              |     |           |       |      |
|------------------------------|-----|-----------|-------|------|
| 1,375 % fällig am 10.06.2030 | KRW | 908.220   | 634   | 0,14 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2028 |     | 2.656.710 | 1.959 | 0,45 |
| 2,625 % fällig am 10.06.2028 |     | 3.023.160 | 2.248 | 0,51 |
| Summe Südkorea               |     |           | 9.909 | 2,25 |

**SPANIEN****STAATSEMISSIONEN**

|                                     |   |       |        |      |
|-------------------------------------|---|-------|--------|------|
| Autonomous Community of Catalonia   |   |       |        |      |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035        | € | 300   | 362    | 0,08 |
| Spain Government International Bond |   |       |        |      |
| 0,000 % fällig am 31.01.2028 (c)    |   | 3.500 | 3.897  | 0,89 |
| 2,400 % fällig am 31.05.2028        |   | 2.400 | 2.837  | 0,64 |
| 3,150 % fällig am 30.04.2035        |   | 1.160 | 1.360  | 0,31 |
| 3,200 % fällig am 31.10.2035        |   | 900   | 1.054  | 0,24 |
| 3,550 % fällig am 31.10.2033        |   | 5.100 | 6.232  | 1,41 |
| Summe Spanien                       |   |       | 15.742 | 3,57 |

**SUPRANATIONAL****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                              |     |         |       |      |
|------------------------------|-----|---------|-------|------|
| Asian Development Bank       |     |         |       |      |
| 6,150 % fällig am 25.02.2030 | INR | 252.300 | 2.905 | 0,66 |

**SCHWEIZ****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                              |    |       |       |      |
|------------------------------|----|-------|-------|------|
| UBS Group AG                 |    |       |       |      |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | \$ | 1.200 | 1.175 | 0,27 |
| 6,327 % fällig am 22.12.2027 |    | 300   | 308   | 0,07 |
| 6,373 % fällig am 15.07.2026 |    | 500   | 501   | 0,11 |
| 6,537 % fällig am 12.08.2033 |    | 300   | 327   | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 30.09.2027 | £  | 300   | 422   | 0,10 |
| 9,016 % fällig am 15.11.2033 | \$ | 500   | 618   | 0,14 |
| UBS Switzerland AG           |    |       |       |      |
| 2,583 % fällig am 23.09.2027 | €  | 2.000 | 2.364 | 0,54 |
| 3,146 % fällig am 21.06.2031 |    | 1.400 | 1.671 | 0,38 |
| 3,304 % fällig am 05.03.2029 |    | 1.500 | 1.807 | 0,41 |
| Summe Schweiz                |    |       | 9.193 | 2,09 |

**THAILAND****STAATSEMISSIONEN**

|                                        |     |        |       |      |
|----------------------------------------|-----|--------|-------|------|
| Thailand Government International Bond |     |        |       |      |
| 2,410 % fällig am 17.03.2035           | THB | 13.330 | 440   | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 17.11.2029           |     | 54.410 | 1.750 | 0,39 |
| 3,775 % fällig am 25.06.2032           |     | 7.240  | 256   | 0,06 |
| Summe Thailand                         |     |        | 2.446 | 0,55 |

**VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                                          |    |       |       |      |
|------------------------------------------|----|-------|-------|------|
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC |    |       |       |      |
| 4,375 % fällig am 02.10.2031             | \$ | 2.100 | 2.072 | 0,47 |
| 4,500 % fällig am 06.05.2030             |    | 300   | 299   | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 06.05.2035             |    | 500   | 500   | 0,11 |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.       |    |       |       |      |
| 4,875 % fällig am 25.07.2033             |    | 1.800 | 1.785 | 0,40 |
| MDGH GMTN RSC Ltd.                       |    |       |       |      |
| 5,500 % fällig am 28.04.2033             |    | 200   | 208   | 0,05 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate       |    |       | 4.864 | 1,10 |

**GROSSBRITANNIEN****UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

|                              |    |       |       |      |
|------------------------------|----|-------|-------|------|
| Antofagasta PLC              |    |       |       |      |
| 2,375 % fällig am 14.10.2030 |    | 400   | 354   | 0,08 |
| Barclays PLC                 |    |       |       |      |
| 4,506 % fällig am 31.01.2033 | €  | 300   | 371   | 0,08 |
| 5,851 % fällig am 21.03.2035 | £  | 500   | 693   | 0,16 |
| 6,224 % fällig am 09.05.2034 | \$ | 400   | 425   | 0,10 |
| 7,437 % fällig am 02.11.2033 |    | 300   | 341   | 0,08 |
| HSBC Holdings PLC            |    |       |       |      |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 |    | 200   | 198   | 0,05 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 |    | 1.000 | 1.002 | 0,23 |
| 5,597 % fällig am 17.05.2028 |    | 400   | 408   | 0,09 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,887 % fällig am 14.08.2027                   | \$ 400         | \$ 406                   | 0,09                              | <b>USA</b>                                        |                |                          |                                   | Bank of America Corp.                                                                |                |                          |                                   |
| Lloyds Banking Group PLC                       |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   | 1,949 % fällig am 27.10.2026                                                         | € 700          | \$ 821                   | 0,19                              |
| 3,875 % fällig am 14.05.2032                   | € 700          | 844                      | 0,19                              | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust       |                |                          |                                   | 5,288 % fällig am 25.04.2034                                                         | \$ 400         | 408                      | 0,09                              |
| 5,250 % fällig am 04.10.2030                   | £ 1.200        | 1.673                    | 0,38                              | 4,714 % fällig am 25.07.2036                      | \$ 78          | \$ 63                    | 0,01                              | 5,365 % fällig am 24.01.2031                                                         | 1.200          | 1.197                    | 0,27                              |
| Nationwide Building Society                    |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.02.2036                      | 36             | 36                       | 0,01                              | 5,511 % fällig am 24.01.2036                                                         | 900            | 926                      | 0,21                              |
| 2,972 % fällig am 16.02.2028                   | \$ 1.300       | 1.270                    | 0,29                              | 5,094 % fällig am 25.11.2035                      | 63             | 68                       | 0,02                              | Bayer U.S. Finance LLC                                                               |                |                          |                                   |
| NatWest Group PLC                              |                |                          |                                   | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust        |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.12.2025                                                         | 400            | 399                      | 0,09                              |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030                   | 1.100          | 1.116                    | 0,25                              | 5,199 % fällig am 25.07.2036                      | 1              | 1                        | 0,00                              | Boeing Co.                                                                           |                |                          |                                   |
| NatWest Markets PLC                            |                |                          |                                   | Carrington Mortgage Loan Trust                    |                |                          |                                   | 6,259 % fällig am 01.05.2027                                                         | 400            | 412                      | 0,09                              |
| 5,596 % fällig am 21.03.2030                   | 1.400          | 1.405                    | 0,32                              | 4,654 % fällig am 25.01.2037                      | 1.100          | 827                      | 0,19                              | Bristol-Myers Squibb Co.                                                             |                |                          |                                   |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                |                          |                                   | Citigroup Mortgage Loan Trust                     |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 22.02.2034                                                         | 600            | 615                      | 0,14                              |
| 0,000 % fällig am 05.04.2032 (c)               | 1.200          | 854                      | 0,19                              | 4,954 % fällig am 25.03.2036                      | 836            | 763                      | 0,17                              | Charter Communications Operating LLC                                                 |                |                          |                                   |
| Santander UK Group Holdings PLC                |                |                          |                                   | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.               |                |                          |                                   | 3,900 % fällig am 01.06.2052                                                         | 600            | 412                      | 0,09                              |
| 2,469 % fällig am 11.01.2028                   | 500            | 484                      | 0,11                              | 4,162 % fällig am 25.10.2037                      | 418            | 404                      | 0,09                              | 3,950 % fällig am 30.06.2062                                                         | 800            | 516                      | 0,12                              |
| 6,534 % fällig am 10.01.2029                   | 1.300          | 1.357                    | 0,31                              | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. |                |                          |                                   | Citibank N.A.                                                                        |                |                          |                                   |
| 7,482 % fällig am 29.08.2029                   | £ 1.000        | 1.473                    | 0,33                              | 4,574 % fällig am 25.08.2037                      | 708            | 643                      | 0,15                              | 4,838 % fällig am 06.08.2029                                                         | 1.100          | 1.123                    | 0,26                              |
| Santander UK PLC                               |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.06.2047                      | 872            | 771                      | 0,17                              | Citigroup, Inc.                                                                      |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 12.03.2029                   | € 1.700        | 2.031                    | 0,46                              | 4,714 % fällig am 25.06.2047                      | 200            | 180                      | 0,04                              | 3,750 % fällig am 14.05.2032                                                         | € 700          | 842                      | 0,19                              |
| Skipton Building Society                       |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.04.2047                      | 1.171          | 1.056                    | 0,24                              | Doctors Co. An Interinsurance Exchange                                               |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 18.06.2029                   | 1.200          | 1.443                    | 0,33                              | 4,954 % fällig am 25.12.2036                      | 2.341          | 2.237                    | 0,51                              | 4,500 % fällig am 18.01.2032                                                         | \$ 100         | 89                       | 0,02                              |
| Standard Chartered PLC                         |                |                          |                                   | First Franklin Mortgage Loan Trust                |                |                          |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC                                                            |                |                          |                                   |
| 2,608 % fällig am 12.01.2028                   | \$ 600         | 583                      | 0,13                              | 5,154 % fällig am 25.11.2035                      | 83             | 78                       | 0,02                              | 3,375 % fällig am 13.11.2025                                                         | 500            | 497                      | 0,11                              |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032                   | 400            | 353                      | 0,08                              | First NLC Trust                                   |                |                          |                                   | GA Global Funding Trust                                                              |                |                          |                                   |
| 4,196 % fällig am 04.03.2032                   | € 1.300        | 1.584                    | 0,36                              | 4,504 % fällig am 25.08.2037                      | 353            | 177                      | 0,04                              | 2,250 % fällig am 06.01.2027                                                         | 300            | 290                      | 0,07                              |
| TP ICAP Finance PLC                            |                |                          |                                   | GSAMP Trust                                       |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                                                            |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028                   | £ 400          | 505                      | 0,12                              | 4,734 % fällig am 25.12.2046                      | 168            | 83                       | 0,02                              | 3,500 % fällig am 23.01.2033                                                         | € 1.000        | 1.184                    | 0,27                              |
| TSB Bank PLC                                   |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.12.2046                      | 84             | 41                       | 0,01                              | 3,615 % fällig am 15.03.2028                                                         | \$ 100         | 98                       | 0,02                              |
| 3,319 % fällig am 05.03.2029                   | € 700          | 844                      | 0,19                              | 4,914 % fällig am 25.09.2036                      | 2.884          | 996                      | 0,23                              | 5,218 % fällig am 23.04.2031                                                         | 900            | 923                      | 0,21                              |
| Vmed O2 UK Financing PLC                       |                |                          |                                   | Home Equity Asset Trust                           |                |                          |                                   | 5,536 % fällig am 28.01.2036                                                         | 800            | 821                      | 0,19                              |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032 (b)               | 900            | 1.072                    | 0,24                              | 5,529 % fällig am 25.05.2035                      | 134            | 133                      | 0,03                              | 5,727 % fällig am 25.04.2030                                                         | 1.500          | 1.562                    | 0,35                              |
| Yorkshire Building Society                     |                |                          |                                   | HSI Asset Securitization Corp. Trust              |                |                          |                                   | JPMorgan Chase & Co.                                                                 |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 16.04.2031                   | 2.900          | 3.452                    | 0,78                              | 4,774 % fällig am 25.12.2036                      | 191            | 46                       | 0,01                              | 3,588 % fällig am 23.01.2036                                                         | € 800          | 935                      | 0,21                              |
|                                                |                | 26.541                   | 6,02                              | 5,049 % fällig am 25.01.2036                      | 2.300          | 2.199                    | 0,50                              | 5,012 % fällig am 23.01.2030                                                         | \$ 800         | 815                      | 0,19                              |
|                                                |                |                          |                                   | Massachusetts Educational Financing Authority     |                |                          |                                   | Morgan Stanley                                                                       |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | 5,575 % fällig am 25.04.2038                      | 17             | 17                       | 0,00                              | 3,790 % fällig am 21.03.2030                                                         | € 1.000        | 1.209                    | 0,27                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                          |                |                          |                                   | MASTR Asset-Backed Securities Trust               |                |                          |                                   | 3,955 % fällig am 21.03.2035                                                         | 1.800          | 2.162                    | 0,49                              |
| Alba PLC                                       |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.08.2036                      | 262            | 96                       | 0,02                              | 5,656 % fällig am 18.04.2030                                                         | \$ 900         | 935                      | 0,21                              |
| 4,528 % fällig am 17.03.2039                   | £ 550          | 742                      | 0,17                              | 4,854 % fällig am 25.05.2037                      | 168            | 163                      | 0,04                              | Organon & Co.                                                                        |                |                          |                                   |
| Atlas Funding PLC                              |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.06.2036                      | 3.376          | 1.173                    | 0,27                              | 2,875 % fällig am 30.04.2028                                                         | € 100          | 115                      | 0,03                              |
| 5,074 % fällig am 20.09.2061                   | 593            | 815                      | 0,18                              | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust            |                |                          |                                   | Pacific Gas & Electric Co.                                                           |                |                          |                                   |
| Canada Square Funding PLC                      |                |                          |                                   | 4,564 % fällig am 25.10.2036                      | 573            | 508                      | 0,11                              | 2,100 % fällig am 01.08.2027                                                         | \$ 100         | 95                       | 0,02                              |
| 5,019 % fällig am 17.06.2058                   | 469            | 643                      | 0,15                              | 4,564 % fällig am 25.01.2037                      | 1.752          | 807                      | 0,18                              | 3,950 % fällig am 01.12.2047                                                         | 100            | 71                       | 0,02                              |
| Curzon Mortgages PLC                           |                |                          |                                   | 4,684 % fällig am 25.03.2037                      | 651            | 277                      | 0,06                              | 4,000 % fällig am 01.12.2046                                                         | 100            | 72                       | 0,02                              |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                   | 931            | 1.280                    | 0,29                              | 4,914 % fällig am 25.06.2036                      | 1.211          | 605                      | 0,14                              | 4,500 % fällig am 01.07.2040                                                         | 100            | 83                       | 0,02                              |
| Elstree Funding                                |                |                          |                                   | New Century Home Equity Loan Trust                |                |                          |                                   | 4,550 % fällig am 01.07.2030                                                         | 100            | 98                       | 0,02                              |
| 4,943 % fällig am 21.01.2065                   | 1.664          | 2.282                    | 0,52                              | 5,154 % fällig am 25.03.2035                      | 354            | 356                      | 0,08                              | PacifiCorp                                                                           |                |                          |                                   |
| London Bridge Mortgages PLC                    |                |                          |                                   | NovaStar Mortgage Funding Trust                   |                |                          |                                   | 5,300 % fällig am 15.02.2031                                                         | 400            | 412                      | 0,09                              |
| 0,000 % fällig am 20.03.2067                   | 600            | 824                      | 0,19                              | 4,734 % fällig am 25.09.2036                      | 176            | 68                       | 0,02                              | Philip Morris International, Inc.                                                    |                |                          |                                   |
| London Wall Mortgage Capital PLC               |                |                          |                                   | Option One Mortgage Loan Trust                    |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.01.2031                                                         | € 300          | 364                      | 0,08                              |
| 5,227 % fällig am 15.05.2057                   | 876            | 1.205                    | 0,27                              | 4,574 % fällig am 25.03.2037                      | 257            | 235                      | 0,05                              | 5,125 % fällig am 13.02.2031                                                         | \$ 400         | 412                      | 0,09                              |
| Polaris PLC                                    |                |                          |                                   | RAAC Trust                                        |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.                                                                    |                |                          |                                   |
| 5,014 % fällig am 23.12.2058                   | 295            | 405                      | 0,09                              | 5,934 % fällig am 25.09.2047                      | 334            | 332                      | 0,08                              | 3,900 % fällig am 22.07.2032                                                         | € 1.200        | 1.452                    | 0,33                              |
| Resloc UK PLC                                  |                |                          |                                   | Residential Asset Mortgage Products Trust         |                |                          |                                   | 5,211 % fällig am 03.12.2035                                                         | \$ 900         | 904                      | 0,21                              |
| 4,518 % fällig am 15.12.2043                   | 353            | 472                      | 0,11                              | 5,074 % fällig am 25.01.2036                      | 262            | 242                      | 0,05                              | 5,499 % fällig am 23.01.2035                                                         | 600            | 615                      | 0,14                              |
| RMAC PLC                                       |                |                          |                                   | 5,484 % fällig am 25.09.2035                      | 1.300          | 1.196                    | 0,27                              |                                                                                      |                | 25.297                   | 5,74                              |
| 5,437 % fällig am 15.02.2047                   | 1.002          | 1.378                    | 0,31                              | Residential Asset Securities Corp. Trust          |                |                          |                                   | <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                  |                |                          |                                   |
| RMAC Securities PLC                            |                |                          |                                   | 4,994 % fällig am 25.04.2036                      | 25             | 25                       | 0,01                              | Maricopa County, Arizona Industrial Development Authority Revenue Notes, Series 2024 |                |                          |                                   |
| 4,528 % fällig am 12.06.2044                   | 389            | 521                      | 0,12                              | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust    |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 01.10.2029                                                         | 400            | 415                      | 0,09                              |
| Stratton Mortgage Funding PLC                  |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.05.2036                      | 366            | 189                      | 0,04                              | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                                |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.06.2049                   | 411            | 564                      | 0,13                              | 5,094 % fällig am 25.08.2035                      | 483            | 359                      | 0,08                              | Ashford Hospitality Trust                                                            |                |                          |                                   |
|                                                |                | 11.131                   | 2,53                              | 5,394 % fällig am 25.01.2036                      | 23             | 22                       | 0,00                              | 5,384 % fällig am 15.04.2035                                                         | 422            | 420                      | 0,10                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   | Soundview Home Loan Trust                         |                |                          |                                   | Banc of America Funding Trust                                                        |                |                          |                                   |
| United Kingdom Gilt                            |                |                          |                                   | 4,994 % fällig am 25.05.2036                      | 313            | 306                      | 0,07                              | 4,812 % fällig am 20.10.2036                                                         | 39             | 30                       | 0,01                              |
| 0,125 % fällig am 22.03.2051 (e)               | 314            | 258                      | 0,06                              | Structured Asset Investment Loan Trust            |                |                          |                                   | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust                                        |                |                          |                                   |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 (e)               | 177            | 115                      | 0,02                              | 4,584 % fällig am 25.09.2036                      | 5              | 5                        | 0,00                              | 5,609 % fällig am 15.07.2037                                                         | 1.361          | 1.330                    | 0,30                              |
| 0,625 % fällig am 22.11.2042 (e)               | 189            | 208                      | 0,05                              | 5,054 % fällig am 25.01.2036                      | 1.580          | 1.488                    | 0,34                              | Chase Mortgage Finance Trust                                                         |                |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050                   | 1.300          | 655                      | 0,15                              | 5,484 % fällig am 25.08.2033                      | 9              | 9                        | 0,00                              | 4,939 % fällig am 25.07.2037                                                         | 32             | 26                       | 0,01                              |
| 1,250 % fällig am 31.07.2051                   | 370            | 222                      | 0,05                              | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.    |                |                          |                                   | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                  |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053                   | 300            | 186                      | 0,04                              | 5,102 % fällig am 01.04.2035                      | 177            | 181                      | 0,04                              | 4,485 % fällig am 25.05.2035                                                         | 16             | 16                       | 0,00                              |
| 4,375 % fällig am 31.07.2054                   | 1.500          | 1.782                    | 0,40                              |                                                   |                | 19.461                   | 4,41                              | Countrywide Alternative Loan Trust                                                   |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 31.01.2056                   | 400            | 557                      | 0,13                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |                |                          |                                   | 4,852 % fällig am 20.03.2046                                                         | 17             | 16                       | 0,00                              |
|                                                |                | 3.983                    | 0,90                              | American Tower Corp.                              |                |                          |                                   | 4,852 % fällig am 20.05.2046                                                         | 21             | 18                       | 0,00                              |
| Summe Großbritannien                           |                | 41.655                   | 9,45                              | 3,900 % fällig am 16.05.2030                      | € 500          | 607                      | 0,14                              | 6,000 % fällig am 25.03.2036                                                         | 370            | 166                      | 0,04                              |
|                                                |                |                          |                                   | Athene Global Funding                             |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.05.2037                                                         | 197            | 84                       | 0,02                              |
|                                                |                |                          |                                   | 5,622 % fällig am 25.03.2027                      | \$ 800         | 806                      | 0,18                              |                                                                                      |                |                          |                                   |

Halbjahresbericht | 30. Juni 2025 475

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|---------|-----------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 109,500    | 25.07.2025    | 13                   | \$ (4)  | \$ (1)    | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250       | 25.07.2025    | 20                   | (5)     | (2)       | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500       | 25.07.2025    | 13                   | (4)     | (7)       | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750       | 25.07.2025    | 20                   | (6)     | (9)       | 0,00                 |
|                                                                |               |               |                      | \$ (19) | \$ (19)   | 0,00                 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                      |         | \$ 1.449  | 0,33                 |

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

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

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

| Index/Tranchen                      | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-43 10-Year Index             | (1,000) %                   | 20.12.2034       | \$ 5.500                  | \$ (28)                                  | (0,01)               |
| CDX.IG-44 5-Year Index              | (1,000)                     | 20.06.2030       | 2.200                     | (4)                                      | 0,00                 |
| CDX.IG-44 10-Year Index             | (1,000)                     | 20.06.2035       | 19.800                    | (116)                                    | (0,02)               |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index  | (1,000)                     | 20.06.2030       | € 10.600                  | (37)                                     | (0,01)               |
| iTraxx Europe Main 43 10-Year Index | (1,000)                     | 20.06.2035       | 6.900                     | (23)                                     | (0,01)               |
|                                     |                             |                  |                           | \$ (208)                                 | (0,05)               |

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

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-43 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.12.2029       | \$ 1.700                  | \$ 5                                     | 0,00                 |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex           | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,000 %         | 17.06.2027       | £ 11.700    | \$ (168)                                 | (0,04)               |
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2030       | 9.600       | 131                                      | 0,03                 |
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2035       | 900         | 5                                        | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 18.03.2031       | 7.400       | 8                                        | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2055       | 100         | (3)                                      | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 4,000           | 17.03.2028       | 23.900      | 241                                      | 0,05                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>            | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000           | 17.09.2030       | INR 742.490 | 77                                       | 0,02                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 17.03.2031       | ¥ 230.000   | (66)                                     | (0,02)               |
| Erhalt                            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400           | 19.06.2039       | 280.000     | 317                                      | 0,07                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,600           | 18.12.2029       | 260.000     | (18)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750           | 19.03.2030       | 130.000     | 1                                        | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 18.06.2030       | 130.000     | (6)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 19.03.2032       | 2.020.000   | 44                                       | 0,01                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 18.09.2034       | 1.436.900   | (77)                                     | (0,02)               |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 19.03.2035       | 1.630.000   | (21)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 19.06.2044       | 1.070.000   | (541)                                    | (0,12)               |
| Erhalt                            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,500           | 18.09.2054       | 238.200     | 222                                      | 0,05                 |
| Erhalt                            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,500           | 18.12.2054       | 30.000      | 21                                       | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>             | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 2,250           | 17.09.2055       | 30.000      | 1                                        | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>             | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500           | 17.09.2030       | SGD 1.400   | (23)                                     | (0,01)               |
| Erhalt                            | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750           | 18.09.2029       | 11.340      | (424)                                    | (0,10)               |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000           | 15.06.2027       | \$ 3.300    | 124                                      | 0,03                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,965           | 30.11.2026       | 14.700      | 269                                      | 0,06                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000           | 19.03.2027       | 16.820      | (115)                                    | (0,03)               |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000           | 19.03.2030       | 12.380      | (298)                                    | (0,07)               |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,232           | 10.09.2034       | 550         | 26                                       | 0,01                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2027       | 5.900       | (6)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2030       | 18.400      | (109)                                    | (0,02)               |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2035       | 18.360      | (476)                                    | (0,11)               |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2035       | 4.600       | (58)                                     | (0,01)               |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2055       | 170         | 5                                        | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2055       | 300         | 1                                        | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500           | 18.12.2025       | 400         | 1                                        | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,525           | 04.09.2034       | 600         | 13                                       | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,565           | 28.08.2034       | 1.600       | 30                                       | 0,01                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,600           | 28.08.2034       | 1.200       | 19                                       | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,611           | 28.08.2034       | 200         | 3                                        | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>             | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,620           | 30.11.2029       | 28.372      | (267)                                    | (0,06)               |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,655           | 31.05.2028       | 800         | (5)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,662           | 31.05.2028       | 2.300       | (15)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,691           | 31.05.2028       | 5.600       | (42)                                     | (0,01)               |

| Zahlung/Erhalt<br>variabler |                                     | Fester Zinssatz  |            | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) |       | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------|-------------------------------------|------------------|------------|------------|-------------------------------------------------|-------|-------------------------|
| Zinssatz                    | Variabler Zinssatzindex             | Fälligkeitsdatum |            |            |                                                 |       |                         |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,715 %          | 07.08.2034 | \$         | 1.560                                           | 13    | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750            | 18.12.2026 |            | 15.300                                          | (74)  | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750            | 17.09.2030 |            | 1.000                                           | (11)  | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750            | 15.05.2032 |            | 5.712                                           | (82)  | (0,02)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750            | 20.06.2034 |            | 7.880                                           | (282) | (0,06)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750            | 18.12.2034 |            | 4.200                                           | (60)  | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750            | 17.09.2035 |            | 500                                             | (9)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,765            | 15.02.2055 |            | 1.700                                           | 48    | 0,01                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,772            | 15.02.2055 |            | 500                                             | 13    | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,773            | 04.03.2055 |            | 800                                             | 21    | 0,01                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,804            | 15.02.2055 |            | 800                                             | 17    | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,806            | 15.02.2055 |            | 700                                             | 15    | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,807            | 31.05.2028 |            | 400                                             | (4)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,836            | 15.05.2034 |            | 1.600                                           | (24)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,840            | 30.06.2031 |            | 1.900                                           | (31)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,847            | 15.05.2034 |            | 900                                             | (14)  | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,851            | 28.02.2029 |            | 1.500                                           | (21)  | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,860            | 15.05.2034 |            | 1.600                                           | (27)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,861            | 15.02.2055 |            | 100                                             | 1     | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,862            | 28.02.2029 |            | 3.700                                           | (53)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,884            | 25.03.2035 |            | 1.100                                           | (14)  | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,900            | 15.02.2035 |            | 25.764                                          | (505) | (0,11)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,905            | 15.08.2026 |            | 4.500                                           | (8)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,930            | 25.06.2055 |            | 789                                             | (6)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,959            | 15.11.2054 |            | 2.000                                           | (12)  | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,960            | 27.06.2055 |            | 946                                             | (8)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,964            | 15.11.2054 |            | 1.500                                           | (10)  | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,998            | 15.11.2054 |            | 2.200                                           | (28)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000            | 26.02.2035 |            | 800                                             | (18)  | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,005            | 29.09.2055 |            | 374                                             | (3)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,020            | 15.05.2026 |            | 3.900                                           | (1)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,065            | 26.06.2055 |            | 532                                             | (5)   | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,100            | 15.11.2052 |            | 3.500                                           | (71)  | (0,02)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,115            | 15.11.2054 |            | 1.400                                           | (47)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,130            | 15.11.2054 |            | 730                                             | (26)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,228            | 30.08.2025 |            | 5.300                                           | 22    | 0,01                    |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250            | 20.12.2025 |            | 14.896                                          | (100) | (0,02)                  |
| Erhalt                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,750            | 17.07.2025 |            | 900                                             | (2)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 1-Year BRL-CDI                      | 6,291            | 04.01.2027 | BRL        | 1.600                                           | 53    | 0,01                    |
| Zahlung                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,402           | 02.01.2029 |            | 22.600                                          | 32    | 0,01                    |
| Zahlung                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,500            | 17.06.2030 | CAD        | 400                                             | 19    | 0,00                    |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,750            | 16.12.2046 |            | 1.400                                           | (44)  | (0,01)                  |
| Zahlung                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,900            | 18.12.2029 |            | 3.700                                           | 155   | 0,04                    |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,740            | 01.06.2034 |            | 600                                             | 6     | 0,00                    |
| Zahlung                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850            | 01.09.2029 |            | 3.900                                           | 39    | 0,01                    |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850            | 01.06.2033 |            | 400                                             | (4)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,880            | 01.09.2033 |            | 900                                             | (2)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000            | 01.06.2033 |            | 500                                             | (6)   | 0,00                    |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,180            | 01.06.2033 |            | 2.900                                           | (51)  | (0,01)                  |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250            | 15.03.2033 |            | 1.900                                           | (73)  | (0,02)                  |
| Erhalt                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250            | 21.06.2053 |            | 2.400                                           | (63)  | (0,01)                  |
| Zahlung                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500            | 19.03.2026 |            | 10.600                                          | 67    | 0,02                    |
| Zahlung                     | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,283            | 14.02.2027 | CHF        | 1.700                                           | 16    | 0,00                    |
| Zahlung                     | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,294            | 10.02.2027 |            | 4.400                                           | 50    | 0,01                    |
| Zahlung                     | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,300            | 15.02.2027 |            | 1.700                                           | 16    | 0,00                    |
| Zahlung                     | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,343            | 16.05.2027 |            | 1.300                                           | 15    | 0,00                    |
| Zahlung                     | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,500            | 15.09.2026 |            | 900                                             | (6)   | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>      | 3-Month CNY-CNREPOFIX               | 1,500            | 18.06.2030 | CNY        | 147.300                                         | 64    | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>      | 3-Month KRW-KORIBOR                 | 2,500            | 17.09.2035 | KRW        | 5.795.020                                       | (18)  | 0,00                    |
| Zahlung                     | 3-Month KRW-KORIBOR                 | 2,750            | 19.03.2035 |            | 1.322.290                                       | 9     | 0,00                    |
| Zahlung                     | 3-Month NZD-BBR                     | 4,750            | 19.06.2029 | NZD        | 4.400                                           | 96    | 0,02                    |
| Zahlung                     | 3-Month SEK-STIBOR                  | 2,265            | 10.01.2030 | SEK        | 10.200                                          | 17    | 0,00                    |
| Zahlung                     | 3-Month SEK-STIBOR                  | 2,474            | 03.02.2030 |            | 30.400                                          | 69    | 0,02                    |
| Zahlung                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 1,750            | 16.03.2027 | AUD        | 1.900                                           | (38)  | (0,01)                  |
| Zahlung <sup>(4)</sup>      | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,500            | 18.03.2031 |            | 28.100                                          | (5)   | 0,00                    |
| Zahlung                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,750            | 19.03.2030 |            | 8.500                                           | 96    | 0,02                    |
| Zahlung                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,000            | 18.06.2030 |            | 1.500                                           | 4     | 0,00                    |
| Zahlung                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250            | 15.03.2033 |            | 11.000                                          | 14    | 0,00                    |
| Zahlung                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250            | 19.03.2035 |            | 2.600                                           | 28    | 0,01                    |
| Zahlung                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500            | 19.03.2035 |            | 11.900                                          | 239   | 0,05                    |
| Zahlung                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500            | 18.06.2035 |            | 1.900                                           | 23    | 0,01                    |
| Erhalt                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,064            | 17.11.2052 | €          | 500                                             | 212   | 0,05                    |
| Zahlung                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,451            | 27.05.2050 |            | 700                                             | (348) | (0,08)                  |
| Zahlung                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,795            | 11.10.2029 |            | 900                                             | (10)  | 0,00                    |
| Zahlung                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,923            | 11.10.2029 |            | 3.700                                           | (17)  | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,000            | 17.09.2027 |            | 24.300                                          | (108) | (0,02)                  |
| Zahlung                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,028            | 11.10.2029 |            | 6.900                                           | (10)  | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,213            | 12.03.2055 |            | 5.300                                           | 267   | 0,06                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250            | 17.09.2030 |            | 1.400                                           | (6)   | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250            | 17.09.2035 |            | 46.530                                          | 126   | 0,03                    |
| Zahlung                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250            | 21.09.2037 |            | 1.400                                           | 20    | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250            | 17.09.2055 |            | 6.580                                           | 225   | 0,05                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,270            | 12.03.2055 |            | 2.800                                           | 125   | 0,03                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz        | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,282 %         | 12.03.2055       | € 500      | \$ 22                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,343           | 10.01.2030       | 4.200      | 10                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,000           | 15.03.2033       | 7.860      | (40)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,536           | 18.09.2025       | 26.000     | (701)                                           | (0,16)                  |
|                                                |                         |                 |                  |            | \$ (2.001)                                      | (0,45)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                 |                  |            | \$ (2.204)                                      | (0,50)                  |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

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

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

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

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENSOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,650    | 11.03.2026    | 438                       | \$ 3   | \$ 3      | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000   | 25.08.2025    | 551                       | 2      | 3         | 0,00                    |
| BRC        | Call - OTC USD versus SEK | SEK 10,200    | 26.11.2025    | 907                       | 6      | 6         | 0,00                    |
| GLM        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,100      | 17.12.2025    | 112                       | 13     | 9         | 0,01                    |
| JPM        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,600    | 22.12.2025    | 1.240                     | 6      | 6         | 0,00                    |
| MBC        | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 395,000   | 29.09.2025    | 667                       | 3      | 3         | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,098      | 23.12.2025    | 112                       | 13     | 9         | 0,00                    |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,750    | 09.12.2025    | 465                       | 3      | 4         | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,550        | 16.12.2025    | 1.129                     | 5      | 5         | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,700        | 16.12.2025    | 781                       | 5      | 5         | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,110      | 24.11.2025    | 2.828                     | 13     | 9         | 0,00                    |
|            |                           |               |               |                           | \$ 72  | \$ 62     | 0,01                    |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                        | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| BPS        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                  | 4,570 %       | 13.08.2025    | 25.100                    | \$ 35  | \$ 0      | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                  | 4,570         | 13.08.2025    | 600                       | 1      | 0         | 0,00                    |
|            |                                     |                            |                                         |               |               |                           | \$ 36  | \$ 0      | 0,00                    |

#### VERKAUFSOPTIONS

##### DEVIENSOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 53,500    | 11.12.2025    | 718                       | \$ (23) | \$ (19)   | (0,01)                  |
| UAG        | Call - OTC USD versus TRY | 54,000        | 16.12.2025    | 451                       | (15)    | (12)      | 0,00                    |
|            |                           |               |               |                           | \$ (38) | \$ (31)   | (0,01)                  |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| BRC        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,350 %       | 25.09.2025    | 1.500                     | \$ (14) | \$ 0      | 0,00                    |
| DUB        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,330         | 25.09.2025    | 1.900                     | (21)    | (1)       | 0,00                    |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680         | 07.07.2025    | 500                       | (2)     | (2)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775         | 07.07.2025    | 500                       | (1)     | (4)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030         | 07.07.2025    | 500                       | (2)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125         | 07.07.2025    | 500                       | (2)     | 0         | 0,00                    |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669         | 07.07.2025    | 1.100                     | (4)     | (4)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715         | 02.07.2025    | 1.600                     | (6)     | (7)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019         | 07.07.2025    | 1.100                     | (4)     | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065         | 02.07.2025    | 1.600                     | (6)     | 0         | 0,00                    |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | \$ (62) | \$ (18)   | 0,00                    |

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



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

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| GST        | South Korea Government International Bond | (1,000) %                      | 20.06.2030       | \$ 710                    | \$ (22)                                      | \$ (2)                                          | \$ (24)   | (0,01)                       |
| MYC        | South Korea Government International Bond | (1,000)                        | 20.06.2030       | 710                       | (23)                                         | (1)                                             | (24)      | 0,00                         |
|            |                                           |                                |                  |                           | \$ (45)                                      | \$ (3)                                          | \$ (48)   | (0,01)                       |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit                         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| GST        | Indonesia Government International Bond | 1,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 4.700                  | \$ 11                                        | \$ 38                                           | \$ 49     | 0,01                         |
|            | Petroleos Mexicanos                     | 4,850                          | 07.05.2026       | 1.920                     | 0                                            | 23                                              | 23        | 0,01                         |
|            |                                         |                                |                  |                           | \$ 11                                        | \$ 61                                           | \$ 72     | 0,02                         |

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

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

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                             | Zahlung                                                                                                                                        | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag<br>erhaltener<br>Währung | Nennbetrag<br>gelieferter<br>Währung | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| CBK        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM basierend auf<br>dem Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,410 % basierend<br>auf dem Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | 17.12.2026            | JPY 2.320.000                       | \$ 15.669                            | \$ 27                                        | \$ 2                                               | \$ 29     | 0,00                         |
|            | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM basierend auf<br>dem Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,470 % basierend<br>auf dem Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | 17.09.2030            | 1.310.000                           | 8.495                                | (60)                                         | 22                                                 | (38)      | 0,00                         |
| GST        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM basierend auf<br>dem Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,414 % basierend<br>auf dem Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | 15.10.2026            | 2.966.300                           | 18.739                               | (261)                                        | 7                                                  | (254)     | (0,06)                       |
|            |                                                                                                                    |                                                                                                                                                |                       |                                     |                                      | \$ (294)                                     | \$ 31                                              | \$ (263)  | (0,06)                       |

**ZINSSWAPS**

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex        | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|---------------------------|
| BPS        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500 %            | 18.03.2031            | CNY 81.700 | \$ (26)                                      | \$ 41                                              | \$ 15     | 0,01                      |
|            | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,500              | 19.03.2030            | MYR 1.890  | (1)                                          | 7                                                  | 6         | 0,00                      |
|            | Erhalt                                      | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,750              | 18.09.2034            | 2.310      | (7)                                          | (9)                                                | (16)      | 0,00                      |
| CBK        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500              | 18.03.2031            | CNY 42.000 | 0                                            | 8                                                  | 8         | 0,00                      |
| GST        | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,500              | 19.03.2030            | MYR 17.400 | 4                                            | 53                                                 | 57        | 0,01                      |
|            | Erhalt                                      | 3-Month MYR-KLIBOR             | 3,750              | 20.09.2033            | 13.530     | 86                                           | (179)                                              | (93)      | (0,02)                    |
| JPM        | Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,960              | 11.02.2029            | COP 15.800 | 0                                            | 0                                                  | 0         | 0,00                      |
| SCX        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX          | 1,500              | 18.03.2031            | CNY 9.400  | 4                                            | (2)                                                | 2         | 0,00                      |
|            |                                             |                                |                    |                       |            | \$ 60                                        | \$ (81)                                            | \$ (21)   | 0,00                      |

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

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | NZD                    | 1.554                    | \$ 935                           | \$ 0                               | \$ (8)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.923                    | AUD 6.039                        | 35                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.708                    | CNH 26.718                       | 26                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 408                      | € 349                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 6.039                    | \$ 3.925                         | 0                                  | (35)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | €                      | 338                      | 397                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 5.492                    | CNH 39.475                       | 40                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 936                      | NZD 1.554                        | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 407                      | \$ 265                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 3.352                    | 468                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | €                      | 41.295                   | 46.954                           | 0                                  | (1.521)                                              | (0,34)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 370.680                  | 272                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 203                      | IDR 3.314.013                    | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 182                      | SGD 233                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 1.452                    | \$ 203                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HUF                    | 62.372                   | € 154                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 233                      | \$ 182                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 93                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 400                      | MXN 7.583                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 15.398                   | \$ 2.152                         | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | €                      | 358                      | RON 1.807                        | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 710                      | \$ 70                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 4.205                    | 129                              | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 346                      | BRL 1.930                        | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.489                    | CNY 10.669                       | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 823                      | IDR 13.425.894                   | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 10                       | RON 44                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 64                       | THB 2.112                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 155                      | TWD 4.610                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 3.126                    | \$ 429                           | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 08.2025          | CNY                    | 10.643                   | 1.489                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 10.990                   | 365                              | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.243                    | CNH 16.024                       | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 426                      | CNY 3.049                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 79                       | CZK 1.755                        | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.082                    | INR 94.035                       | 12                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 271                      | MXN 5.162                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 124                      | TWD 4.063                        | 17                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025          |                        | 1.091                    | VND 28.683.182                   | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 04.2026          | DKK                    | 36.725                   | \$ 5.247                         | 0                                  | (643)                                                | (0,15)                  |
| BSH        | 07.2025          | €                      | 385                      | RON 1.948                        | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.030                    | \$ 1.175                         | 0                                  | (34)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 581                      | 786                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 1.142                    | 338                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 40.844                   | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.076                    | € 943                            | 31                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.232                    | £ 3.847                          | 40                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 682                      | ILS 2.376                        | 23                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 12                       | KRW 15.905                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 215                      | NOK 2.188                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        | 104                      | PLN 388                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.497                    | TRY 143.631                      | 54                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 67.438                   | \$ 3.730                         | 0                                  | (59)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CNH                    | 6.029                    | 838                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 3.496                    | 4.758                            | 0                                  | (34)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.024                    | CNH 7.365                        | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 779                      | CZK 17.321                       | 45                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.010                    | TRY 41.845                       | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MYR                    | 1.087                    | \$ 258                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 12.2025          | \$                     | 107                      | TRY 5.006                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BSH        | 07.2025          |                        | 2.760                    | DKK 18.125                       | 91                                 | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 09.2025          |                        | 703                      | PEN 2.573                        | 21                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025          | PEN                    | 7.427                    | \$ 2.021                         | 0                                  | (63)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNY                    | 7.005                    | 977                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 304                      | 348                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 28.600                   | 201                              | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 1.836.218                | 1.340                            | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PEN                    | 6.295                    | 1.726                            | 0                                  | (47)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | TWD                    | 10.517                   | 323                              | 0                                  | (39)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 11.382                   | BRL 67.554                       | 997                                | 0                                                    | 0,23                    |
| CBK        | 07.2025          |                        | 3.699                    | CNY 26.508                       | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.404                    | IDR 22.856.371                   | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 380                      | KRW 521.962                      | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 577                      | PEN 2.059                        | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.263                    | THB 41.984                       | 30                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 263                      | TWD 7.803                        | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 8.352                    | \$ 1.167                         | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNY                    | 706                      | 99                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | EGP                    | 2.040                    | 38                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PEN                    | 700                      | 186                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
| BSH        | 08.2025          | TWD                    | 12.881                   | 397                              | 0                                  | (51)                                                 | (0,01)                  |



| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |      |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|------|
| DUB        | 08.2025          | \$                     | 1.669 CNH                | 12.008                           | \$ 14                              | \$ 0                                                 | \$ 14                   | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 2.208 CNY                | 15.791                           | 4                                  | 0                                                    | 4                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 755 COP                  | 3.147.276                        | 12                                 | 0                                                    | 12                      | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 70 EGP                   | 3.854                            | 6                                  | 0                                                    | 6                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 8.101 INR                | 698.224                          | 26                                 | (5)                                                  | 21                      | 0,00   |      |
|            | 09.2025          | MXN                    | 1.143 \$                 | 60                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 09.2025          | PEN                    | 13.524                   | 3.686                            | 0                                  | (117)                                                | (117)                   | (0,03) |      |
|            | 01.2026          | ¥                      | 70.000                   | 516                              | 21                                 | 0                                                    | 21                      | 0,00   |      |
|            | 02.2026          | PEN                    | 2.555                    | 695                              | 0                                  | (20)                                                 | (20)                    | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | DKK                    | 13.641                   | 2.142                            | 0                                  | (4)                                                  | (4)                     | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | KRW                    | 54.545                   | 40                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | SGD                    | 24                       | 19                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 17 CNY                   | 120                              | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 51.731 €                 | 44.592                           | 614                                | 0                                                    | 614                     | 0,14   |      |
|            | 07.2025          |                        | 33 IDR                   | 543.231                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 333 ILS                  | 1.154                            | 10                                 | 0                                                    | 10                      | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 60 KZT                   | 31.725                           | 1                                  | 0                                                    | 1                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 138 TWD                  | 4.092                            | 3                                  | 0                                                    | 3                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          | €                      | 594 RON                  | 3.014                            | 0                                  | (4)                                                  | (4)                     | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 44.494 \$                | 51.731                           | 0                                  | (613)                                                | (613)                   | (0,14) |      |
|            | 08.2025          | THB                    | 31.160                   | 959                              | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     | 0,00   |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 241 CNH                  | 1.737                            | 3                                  | 0                                                    | 3                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 2.142 DKK                | 13.608                           | 4                                  | 0                                                    | 4                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 3.755 INR                | 324.010                          | 15                                 | (1)                                                  | 14                      | 0,00   |      |
| FAR        | 09.2025          | KZT                    | 55.361 \$                | 102                              | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     | 0,00   |      |
|            | 09.2025          | MXN                    | 131                      | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 09.2025          | \$                     | 839 KZT                  | 434.118                          | 0                                  | (21)                                                 | (21)                    | 0,00   |      |
|            | 12.2025          |                        | 442                      | 234.942                          | 0                                  | (12)                                                 | (12)                    | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | AUD                    | 5.284 \$                 | 3.409                            | 0                                  | (54)                                                 | (54)                    | (0,01) |      |
|            | 07.2025          | BRL                    | 75.147                   | 13.541                           | 0                                  | (229)                                                | (229)                   | (0,05) |      |
|            | 07.2025          | CHF                    | 2.130                    | 2.660                            | 0                                  | (15)                                                 | (15)                    | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | DKK                    | 18.540                   | 2.913                            | 0                                  | (4)                                                  | (4)                     | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 375.672                  | 2.581                            | 0                                  | (20)                                                 | (20)                    | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | SGD                    | 61                       | 47                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.590 CHF                | 2.132                            | 89                                 | 0                                                    | 89                      | 0,02   |      |
|            | 07.2025          |                        | 1.891 CNH                | 13.591                           | 8                                  | 0                                                    | 8                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 5.994 ¥                  | 859.909                          | 0                                  | (41)                                                 | (41)                    | (0,01) |      |
|            | 07.2025          |                        | 919 PLN                  | 3.389                            | 19                                 | 0                                                    | 19                      | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 3.086 SEK                | 29.554                           | 16                                 | 0                                                    | 16                      | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 147 SGD                  | 187                              | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          | SGD                    | 186 \$                   | 147                              | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.660 CHF                | 2.121                            | 15                                 | 0                                                    | 15                      | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 1.666 CNH                | 11.918                           | 5                                  | 0                                                    | 5                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 2.913 DKK                | 18.495                           | 4                                  | 0                                                    | 4                       | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 1.794 INR                | 155.181                          | 11                                 | 0                                                    | 11                      | 0,00   |      |
|            | 08.2025          |                        | 2.581 ¥                  | 374.290                          | 20                                 | 0                                                    | 20                      | 0,00   |      |
|            | GLM              | 09.2025                |                          | 12.050 BRL                       | 67.641                             | 158                                                  | 0                       | 158    | 0,04 |
|            |                  | 09.2025                |                          | 5.636 MXN                        | 109.744                            | 127                                                  | 0                       | 127    | 0,03 |
| 11.2025    |                  | PEN                    | 752 \$                   | 205                              | 0                                  | (6)                                                  | (6)                     | 0,00   |      |
| 07.2025    |                  | €                      | 426 RON                  | 2.151                            | 0                                  | (4)                                                  | (4)                     | 0,00   |      |
| 07.2025    |                  | TWD                    | 3.185 \$                 | 98                               | 0                                  | (12)                                                 | (12)                    | 0,00   |      |
| 07.2025    |                  | \$                     | 333 IDR                  | 5.421.624                        | 1                                  | 0                                                    | 1                       | 0,00   |      |
| 07.2025    |                  |                        | 57 SGD                   | 73                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
| 07.2025    |                  |                        | 20 THB                   | 660                              | 1                                  | 0                                                    | 1                       | 0,00   |      |
| 07.2025    |                  | ZAR                    | 253 \$                   | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
| 08.2025    |                  | €                      | 70 RON                   | 356                              | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
| 08.2025    |                  | SGD                    | 72 \$                    | 57                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
| 08.2025    |                  | TWD                    | 7.953                    | 243                              | 0                                  | (33)                                                 | (33)                    | (0,01) |      |
| 08.2025    |                  | \$                     | 210 EGP                  | 11.581                           | 19                                 | 0                                                    | 19                      | 0,00   |      |
| 08.2025    |                  |                        | 752 HUF                  | 268.851                          | 35                                 | 0                                                    | 35                      | 0,01   |      |
| 08.2025    |                  |                        | 4 THB                    | 133                              | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
| 09.2025    |                  | MYR                    | 1.402 \$                 | 333                              | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     | 0,00   |      |
| 09.2025    |                  | \$                     | 160 KZT                  | 83.640                           | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     | 0,00   |      |
| 12.2025    |                  | TRY                    | 3.869 \$                 | 83                               | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     | 0,00   |      |
| 01.2026    |                  | ¥                      | 200.000                  | 1.486                            | 73                                 | 0                                                    | 73                      | 0,02   |      |
| 07.2025    |                  | SEK                    | 27.248                   | 2.880                            | 21                                 | 0                                                    | 21                      | 0,00   |      |
| 08.2025    |                  | \$                     | 2.880 SEK                | 27.190                           | 0                                  | (21)                                                 | (21)                    | 0,00   |      |
| JPM        |                  | 08.2025                |                          | 219 TWD                          | 6.453                              | 5                                                    | 0                       | 5      | 0,00 |
|            |                  | 07.2025                | CAD                      | 494 \$                           | 360                                | 0                                                    | (2)                     | (2)    | 0,00 |
|            |                  | 07.2025                | ¥                        | 87.291                           | 608                                | 4                                                    | 0                       | 4      | 0,00 |
|            | 07.2025          | KRW                    | 203.175                  | 149                              | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | SGD                    | 1.609                    | 1.253                            | 0                                  | (11)                                                 | (11)                    | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | TWD                    | 4.264                    | 131                              | 0                                  | (16)                                                 | (16)                    | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 973 BRL                  | 5.424                            | 21                                 | 0                                                    | 21                      | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 3.568 CNH                | 25.750                           | 31                                 | 0                                                    | 31                      | 0,01   |      |
|            | 07.2025          |                        | 455 CNY                  | 3.263                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 2.127 DKK                | 14.045                           | 83                                 | 0                                                    | 83                      | 0,02   |      |
|            | 07.2025          |                        | 927 NZD                  | 1.554                            | 17                                 | 0                                                    | 17                      | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 652 PHP                  | 36.413                           | 0                                  | (7)                                                  | (7)                     | 0,00   |      |
|            | 07.2025          |                        | 2.764 PLN                | 10.284                           | 81                                 | 0                                                    | 81                      | 0,02   |      |
|            | 07.2025          |                        | 119 SGD                  | 153                              | 1                                  | 0                                                    | 1                       | 0,00   |      |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 22.356 \$                | 1.251                            | 0                                  | (5)                                                  | (5)                     | 0,00   |      |
|            | 08.2025          | BRL                    | 2.016                    | 353                              | 0                                  | (13)                                                 | (13)                    | 0,00   |      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MBC        | 08.2025          | SGD                    | 152                      | \$                               | 119                                | \$                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 11.606                   |                                  | 357                                |                                                      | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 5.490                    | CNH                              | 39.479                             |                                                      | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.210                    | INR                              | 104.879                            |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 30                       | TWD                              | 988                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 10.2025          | HUF                    | 64.501                   | €                                | 160                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 348                      | \$                               | 226                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 2.771                    |                                  | 2.018                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 2.268                    |                                  | 316                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 2.002                    |                                  | 2.301                              |                                                      | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 2.214                    |                                  | 3.003                              |                                                      | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 6.545                    |                                  | 46                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 3.865                    |                                  | 3.013                              |                                                      | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | TWD                    | 1.276                    |                                  | 39                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.812                    | CAD                              | 2.490                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.713                    | CNH                              | 12.344                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 279                      | €                                | 241                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.048                    | HKD                              | 8.196                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 299                      | IDR                              | 4.858.721                          |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 193                      | ¥                                | 27.659                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 368                      | PHP                              | 20.556                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 796                      | PLN                              | 2.982                              |                                                      | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.150                    | SGD                              | 4.073                              |                                                      | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 637                      | THB                              | 21.075                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 11                       | TWD                              | 335                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 2.486                    | \$                               | 1.812                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 12.419                   |                                  | 1.717                              |                                                      | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | SGD                    | 4.064                    |                                  | 3.150                              |                                                      | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | THB                    | 53.097                   |                                  | 1.644                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 7.502                    |                                  | 234                                |                                                      | (0,01)                  |
| MYI        | 08.2025          | \$                     | 3.747                    | CNH                              | 26.961                             |                                                      | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 316                      | CNY                              | 2.261                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 529                      | \$                               | 609                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 183.901                  |                                  | 1.268                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 20.058                   |                                  | 1.988                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 134                      | ¥                                | 19.425                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5                        | PLN                              | 18                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.697                    | CNH                              | 12.148                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 25                       | CNY                              | 182                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 815                      | ¥                                | 118.464                            |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.988                    | NOK                              | 20.054                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 09.2025          | CAD                    | 1.192                    | \$                               | 838                                |                                                      | (0,01)                  |
|            | 09.2025          | \$                     | 177                      | KZT                              | 91.891                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 12.2025          | CZK                    | 4.971                    | €                                | 197                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 2.340                    | \$                               | 247                                |                                                      | 0,00                    |
| RYL        | 08.2025          | \$                     | 542                      | CNH                              | 3.916                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 1.184                    | \$                               | 41                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 816                      | CNY                              | 5.856                              |                                                      | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          |                        | 100                      | EGP                              | 5.411                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.547                    | IDR                              | 25.214.289                         |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5                        | ILS                              | 18                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 629                      | SGD                              | 811                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 408                      | TWD                              | 12.125                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 2.133                    | \$                               | 295                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 809                      |                                  | 629                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 617                      |                                  | 19                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.930                    | CNH                              | 20.929                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.266                    | INR                              | 108.714                            |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 232                      | TWD                              | 7.320                              |                                                      | 0,01                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 17.362                   | \$                               | 120                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 2.088                    |                                  | 208                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 411                      | RON                              | 1.805                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 27                       | HUF                              | 9.768                              |                                                      | 0,00                    |
| SOG        | 08.2025          |                        | 7                        | INR                              | 627                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 120                      | ¥                                | 17.298                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 208                      | NOK                              | 2.088                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 12.2025          |                        | 100                      | EGP                              | 5.455                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 4.211                    | \$                               | 588                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 1.052                    |                                  | 1.425                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 567                      | CAD                              | 776                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 26.500                   | \$                               | 309                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 10.2025          | PEN                    | 1.295                    |                                  | 353                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 01.2026          | ¥                      | 210.000                  |                                  | 1.402                              |                                                      | (0,02)                  |
| UAG        | 07.2025          | CLP                    | 484.079                  |                                  | 516                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 7.140                    |                                  | 49                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 40.760                   |                                  | 30                                 |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 49                       | ILS                              | 175                                |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 30                       | KRW                              | 40.780                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.035                    | NOK                              | 20.668                             |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 312                      | RON                              | 1.369                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 101                      | THB                              | 3.347                              |                                                      | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 7.700                    | CNH                              | 55.169                             |                                                      | 0,01                    |
|            | 09.2025          |                        | 838                      | CAD                              | 1.191                              |                                                      | 0,01                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| WST        | 12.2025          | €                      | 197                      | CZK                              | 4.971                              | \$ 4                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025          | TRY                    | 2.441                    | \$                               | 52                                 | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 965                      |                                  | 1.090                              | (1)                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 199.497                  |                                  | 1.385                              | (43)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.385                    | ¥                                | 198.763                            | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    | (4)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 3.564                         | \$ (4.494)                         | \$ (930)                                             | (0,21)                  |

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                    | 24.396                   | \$                               | 30.545                             | \$ 0                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.663                    | AUD                              | 2.560                              | 15                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 939                      | €                                | 826                                | 31                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 392                      | NZD                              | 651                                | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 2.560                    | \$                               | 1.664                              | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 08.2025          | NZD                    | 651                      |                                  | 392                                | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 30.545                   | CHF                              | 24.295                             | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 18.683                   | \$                               | 21.244                             | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 87                       | AUD                              | 134                                | (688)                                                | (0,16)                  |
|            | 07.2025          |                        | 636                      | CHF                              | 515                                | 1                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          |                        | 126                      | £                                | 93                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 112                      | CAD                              | 154                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 7.739                    | \$                               | 9.434                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 110                      |                                  | 125                                | (289)                                                | (0,07)                  |
|            | 07.2025          | NOK                    | 622                      |                                  | 61                                 | (3)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | \$                     | 3.575                    | £                                | 2.629                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 7                        | ¥                                | 1.039                              | 28                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 0                        | NZD                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 2.380                    | \$                               | 3.239                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 1.945                    |                                  | 296                                | (23)                                                 | (0,01)                  |
| BSH        | 07.2025          | CHF                    | 254                      |                                  | 312                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 347                      |                                  | 406                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 2                        |                                  | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 65                       | AUD                              | 100                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 85                       | CAD                              | 116                                | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        | 112                      | DKK                              | 732                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 133                      | £                                | 99                                 | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 0                        | NOK                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 148                      | SEK                              | 1.409                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 86                       | AUD                              | 134                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          |                        | 181                      | DKK                              | 1.154                              | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 18.392                   | €                                | 15.854                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 1.151                    | \$                               | 181                                | 218                                                  | 0,05                    |
|            | 08.2025          | €                      | 15.819                   |                                  | 18.392                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 3.036                    |                                  | 1.959                              | (218)                                                | (0,05)                  |
| FAR        | 07.2025          | CHF                    | 23.751                   |                                  | 29.667                             | (31)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 814.777                  |                                  | 5.680                              | (170)                                                | (0,04)                  |
|            | 07.2025          | SEK                    | 8.705                    |                                  | 909                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 27.925                   | CHF                              | 22.995                             | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 246                      | DKK                              | 1.568                              | 964                                                  | 0,22                    |
| GLM        | 07.2025          |                        | 2.694                    | ¥                                | 392.195                            | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 1.564                    | \$                               | 246                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 390.753                  |                                  | 2.694                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 29.667                   | CHF                              | 23.653                             | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 91                       | CAD                              | 125                                | 0                                                    | 0,04                    |
| IND        | 07.2025          |                        | 772                      | SEK                              | 7.305                              | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK                    | 7.290                    | \$                               | 772                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 1.507                    |                                  | 228                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 652                      |                                  | 389                                | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 3.525                    |                                  | 2.567                              | (9)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | ¥                      | 26.207                   |                                  | 182                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 69                       | AUD                              | 108                                | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.165                    | CAD                              | 2.975                              | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 32.792                   | CHF                              | 26.948                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.425                    | €                                | 2.113                              | 1.062                                                | 0,24                    |
| MYI        | 07.2025          |                        | 462                      | ¥                                | 67.102                             | 55                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 2.970                    | \$                               | 2.164                              | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 2.257                    |                                  | 2.760                              | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 18.406                   |                                  | 127                                | (75)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.177                    | ¥                                | 170.939                            | 0                                                    | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025          |                        | 583                      | NOK                              | 5.883                              | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 131.402                  | \$                               | 905                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 5.882                    |                                  | 583                                | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 16.779                   | CHF                              | 13.761                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 10                       | ¥                                | 1.469                              | 509                                                  | 0,12                    |
| SCX        | 08.2025          | ¥                      | 1.464                    | \$                               | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.508                    | ¥                                | 217.675                            | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          |                        |                          |                                  |                                    | (1)                                                  | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
|            | 07.2025          | \$ 61               | NOK 613               | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥ 216.877           | \$ 1.508              | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK 612             | 61                    | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £ 2.821             | 3.820                 | 0                             | (46)                            | (46)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 114              | CAD 156               | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | NOK 5.874           | \$ 578                | 0                             | (2)                             | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 58               | ¥ 8.447               | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 3.285                      | \$ (1.782)                      | \$ 1.503                                       | 0,34                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 39.840            | \$ 46.648             | \$ 0                          | \$ (117)                        | \$ (117)                                       | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$ 4.861            | AUD 7.483             | 43                            | 0                               | 43                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          | 20                  | € 18                  | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 739                 | NZD 1.227             | 6                             | 0                               | 6                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD 7.483           | \$ 4.864              | 0                             | (43)                            | (43)                                           | (0,01)               |
|            | 08.2025          | NZD 1.227           | 739                   | 0                             | (7)                             | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 46.751           | € 39.840              | 118                           | 0                               | 118                                            | 0,03                 |
| BOA        | 07.2025          | 88.479              | 77.814                | 2.863                         | 0                               | 2.863                                          | 0,65                 |
| BPS        | 07.2025          | € 11                | \$ 12                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 1.633               | 1.869                 | 0                             | (47)                            | (47)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | NOK 1.382           | 136                   | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 47.641           | € 41.951              | 1.603                         | 0                               | 1.603                                          | 0,36                 |
|            | 07.2025          | 9.180               | £ 6.747               | 66                            | 0                               | 66                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          | 1                   | NZD 1                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £ 6.747             | \$ 9.181              | 0                             | (66)                            | (66)                                           | (0,01)               |
| BSH        | 07.2025          | DKK 3.630           | 553                   | 0                             | (18)                            | (18)                                           | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | CHF 3               | 3                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK 2               | 0                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK 52              | 5                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 5                | € 5                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 0                   | ¥ 3                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 0                   | NOK 1                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 78.267            | \$ 90.798             | 0                             | (1.075)                         | (1.075)                                        | (0,24)               |
|            | 08.2025          | \$ 90.798           | € 78.095              | 1.074                         | 0                               | 1.074                                          | 0,24                 |
| FAR        | 07.2025          | AUD 7.483           | \$ 4.828              | 0                             | (76)                            | (76)                                           | (0,02)               |
|            | 07.2025          | CHF 1.832           | 2.224                 | 0                             | (77)                            | (77)                                           | (0,02)               |
|            | 07.2025          | ¥ 1.931.307         | 13.463                | 92                            | 0                               | 92                                             | 0,02                 |
|            | 07.2025          | SEK 19.115          | 1.996                 | 0                             | (10)                            | (10)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 2.288            | CHF 1.832             | 13                            | 0                               | 13                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 584                 | DKK 3.714             | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 7.577               | ¥ 1.102.948           | 58                            | 0                               | 58                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | CHF 1.825           | \$ 2.288              | 0                             | (13)                            | (13)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | DKK 3.705           | 584                   | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥ 1.098.892         | 7.577                 | 0                             | (59)                            | (59)                                           | (0,01)               |
| IND        | 07.2025          | \$ 2.029            | SEK 19.191            | 0                             | (15)                            | (15)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SEK 19.150          | \$ 2.029              | 15                            | 0                               | 15                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | DKK 2.813           | 426                   | 0                             | (17)                            | (17)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD 1.228           | 733                   | 0                             | (13)                            | (13)                                           | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CAD 8.481           | 6.175                 | 0                             | (41)                            | (41)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | € 46                | 53                    | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥ 88.213            | 614                   | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 6.172            | CAD 8.484             | 46                            | 0                               | 46                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          | 11                  | € 9                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD 8.470           | \$ 6.172              | 0                             | (46)                            | (46)                                           | (0,01)               |
| MYI        | 07.2025          | ¥ 43.628            | 302                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 2.545            | ¥ 370.897             | 23                            | 0                               | 23                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          | 1.297               | NOK 13.080            | 0                             | (4)                             | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥ 369.534           | \$ 2.545              | 0                             | (23)                            | (23)                                           | (0,01)               |
|            | 08.2025          | NOK 13.077          | 1.297                 | 4                             | 0                               | 4                                              | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | \$ 29               | 4.132                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥ 4.117             | \$ 29                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SOG        | 07.2025          | \$ 4.241            | ¥ 612.156             | 0                             | (3)                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 136                 | NOK 1.362             | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥ 609.910           | \$ 4.241              | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK 1.362           | 136                   | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £ 6.747             | 9.136                 | 0                             | (110)                           | (110)                                          | (0,03)               |
| UAG        | 07.2025          | ¥ 28.466            | 197                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK 13.059          | 1.286                 | 0                             | (5)                             | (5)                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 6.033                      | \$ (1.889)                      | \$ 4.144                                       | 0,94                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD                              | 07.2025          | \$                     | 1.146 AUD                | 1.764                            | \$ 10                              | \$ 10                                                | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 198 NZD                  | 328                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | AUD                    | 1.764                    | \$ 1.147                         | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | NZD                    | 328                      | 198                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| BOA                              | 07.2025          | €                      | 11.126                   | 12.651                           | 0                                  | (409)                                                | (0,09)                  |
| BPS                              | 07.2025          | \$                     | 453                      | NOK 4.574                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BRC                              | 07.2025          |                        | 2.286 £                  | 1.680                            | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 21.983 NOK               | 223.915                          | 144                                | 0                                                    | 0,03                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 0 NZD                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | £                      | 1.680                    | \$ 2.286                         | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
| BSH                              | 07.2025          | DKK                    | 910                      | 139                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
| CBK                              | 07.2025          | CHF                    | 1                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | DKK                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | ¥                      | 10.951                   | 77                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | NOK                    | 3.375                    | 334                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB                              | 07.2025          | SEK                    | 13                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 108                      | DKK 685                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 13.124 €                 | 11.313                           | 155                                | 0                                                    | 0,03                    |
|                                  | 08.2025          | DKK                    | 683                      | 108                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR                              | 08.2025          | €                      | 11.288                   | 13.124                           | 0                                  | (155)                                                | (0,04)                  |
|                                  | 07.2025          | AUD                    | 1.764                    | 1.138                            | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | CHF                    | 496                      | 602                              | 0                                  | (21)                                                 | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025          | ¥                      | 470.199                  | 3.278                            | 22                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|                                  | 07.2025          | SEK                    | 4.680                    | 489                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 619                      | CHF 496                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 146 DKK                  | 931                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 1.939 ¥                  | 282.258                          | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | CHF                    | 494                      | 619                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | DKK                    | 929                      | 146                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | ¥                      | 281.220                  | 1.939                            | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 497                      | SEK 4.699                        | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
| IND                              | 08.2025          | SEK                    | 4.689                    | 497                              | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | DKK                    | 705                      | 107                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | NZD                    | 329                      | 196                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | CAD                    | 2.071                    | 1.508                            | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
| MBC                              | 07.2025          | €                      | 187                      | 217                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | ¥                      | 21.477                   | 149                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 1.507                    | CAD 2.072                        | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | CAD                    | 2.068                    | \$ 1.507                         | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
| MYI                              | 07.2025          | ¥                      | 10.622                   | 74                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | NOK                    | 199.624                  | 19.790                           | 64                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 651                      | ¥ 94.917                         | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 4.182                    | NOK 42.524                       | 20                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | ¥                      | 94.568                   | \$ 651                           | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 19.790                   | NOK 199.587                      | 0                                  | (64)                                                 | (0,01)                  |
| RYL                              | 07.2025          |                        | 8                        | 83                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX                              | 07.2025          |                        | 7                        | ¥ 1.057                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | ¥                      | 1.053                    | \$ 7                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          |                        | 15.090                   | 104                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | NOK                    | 215.516                  | 21.465                           | 169                                | 0                                                    | 0,04                    |
| SOG                              | 07.2025          | \$                     | 1.085                    | ¥ 156.658                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | ¥                      | 156.083                  | \$ 1.085                         | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 21.465                   | NOK 215.475                      | 0                                  | (169)                                                | (0,04)                  |
|                                  | 07.2025          | £                      | 1.680                    | \$ 2.275                         | 0                                  | (27)                                                 | (0,01)                  |
| SSB                              | 07.2025          | ¥                      | 6.930                    | 48                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025          | \$                     | 19.935                   | NOK 202.440                      | 70                                 | 0                                                    | 0,02                    |
|                                  |                  |                        |                          | \$ 716                           | \$ (962)                           | \$ (246)                                             | (0,06)                  |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 4.224                                             | 0,96                    |

| BESCHREIBUNG                               | PARI (000S) | MARKTWERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|-------------|---------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |             |                     |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 300.000  | \$ 36               | 0,01                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |             | \$ 36               | 0,01                         |
| <b>LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE</b>           |             |                     |                              |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>               |             |                     |                              |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA      |             |                     |                              |
| 2,000 % fällig am 01.07.2040               | 6.700       | (6.124)             | (1,39)                       |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055               | 31.650      | (25.062)            | (5,69)                       |
| 3,500 % fällig am 01.08.2055               | 1.000       | (900)               | (0,20)                       |
| 6,500 % fällig am 01.07.2055 (g)           | 6.700       | (6.919)             | (1,57)                       |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere            |             | \$ (39.005)         | (8,85)                       |
| Summe Anlagen                              |             | \$ 640.710          | 145,32                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |             | \$ (199.826)        | (45,32)                      |
| Nettovermögen                              |             | \$ 440.884          | 100,00                       |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Ein zum 30. Juni 2025 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,10 %):

| Emittentenbeschreibung   | Kaufdatum  | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|--------------------------|------------|--------|-----------|----------------------|
| DrillCo Holding Lux S.A. | 08.06.2023 | \$ 321 | \$ 329    | 0,08                 |

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 37.593 USD (31. Dezember 2024: 802 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 18.491 USD) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 12.041 USD (31. Dezember 2024: 8.345 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 910 USD (31. Dezember 2024: 3.890 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 667.175                                                      | \$ 1.893                                                     | \$ 669.068 |
| Investmentfonds                     | 7.142                                                                       | 0                                                               | 0                                                            | 7.142      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 148                                                                         | 3.321                                                           | 0                                                            | 3.469      |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 36                                                              | 0                                                            | 36         |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (39.005)                                                        | 0                                                            | (39.005)   |
| Summen                              | \$ 7.290                                                                    | \$ 631.527                                                      | \$ 1.893                                                     | \$ 640.710 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 509.763                                                      | \$ 571                                                       | \$ 510.334 |
| Investmentfonds                     | 6.608                                                                       | 0                                                               | 0                                                            | 6.608      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 613                                                                         | (3.114)                                                         | 0                                                            | (2.501)    |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 38                                                              | 0                                                            | 38         |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (36.634)                                                        | 0                                                            | (36.634)   |
| Summen                              | \$ 7.221                                                                    | \$ 470.053                                                      | \$ 571                                                       | \$ 477.845 |

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

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

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

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BRC                                | 1,500 %    | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (711)      | \$ (835)                                    | (0,19)                  |
| CIB                                | 4,440      | 06.06.2025       | 18.07.2025         | \$ (752)     | (755)                                       | (0,17)                  |
| DEU                                | 4,420      | 24.06.2025       | 02.07.2025         | (2.649)      | (2.652)                                     | (0,60)                  |
| JPS                                | 4,430      | 05.06.2025       | 03.07.2025         | (3.986)      | (3.998)                                     | (0,91)                  |
|                                    | 4,450      | 10.06.2025       | 08.07.2025         | (1.396)      | (1.399)                                     | (0,32)                  |
|                                    | 4,450      | 23.06.2025       | 07.07.2025         | (5.610)      | (5.616)                                     | (1,27)                  |
| STR                                | 4,490      | 30.06.2025       | 01.07.2025         | (21.896)     | (21.898)                                    | (4,97)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (37.153)                                 | (8,43)                  |

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

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 98                               | \$ 0                                  | \$ 98                           | \$ (7)                              | \$ 0                                  | \$ (7)                          |
| BOA        | 259                                 | (60)                                  | 199                             | 263                                 | (260)                                 | 3                               |
| BPS        | (624)                               | 370                                   | (254)                           | 201                                 | (290)                                 | (89)                            |
| BRC        | 1.489                               | (1.490)                               | (1)                             | 985                                 | (660)                                 | 325                             |
| BSH        | 16                                  | 210                                   | 226                             | 1                                   | 0                                     | 1                               |
| CBK        | 816                                 | (780)                                 | 36                              | 331                                 | 0                                     | 331                             |
| DUB        | (10)                                | 0                                     | (10)                            | 129                                 | 0                                     | 129                             |
| FAR        | 980                                 | (930)                                 | 50                              | 241                                 | 0                                     | 241                             |
| GLM        | 60                                  | 0                                     | 60                              | (231)                               | 290                                   | 59                              |
| GST        | (242)                               | 0                                     | (242)                           | 373                                 | 0                                     | 373                             |
| IND        | 5                                   | 0                                     | 5                               | 10                                  | 0                                     | 10                              |
| JPM        | 146                                 | 0                                     | 146                             | (49)                                | 0                                     | (49)                            |
| MBC        | 976                                 | (640)                                 | 336                             | (884)                               | 670                                   | (214)                           |
| MYC        | (35)                                | 0                                     | (35)                            | (23)                                | 0                                     | (23)                            |
| MYI        | (83)                                | 0                                     | (83)                            | (20)                                | (10)                                  | (30)                            |
| RBC        | 509                                 | (330)                                 | 179                             | 3                                   | 0                                     | 3                               |
| RYL        | 7                                   | 0                                     | 7                               | 25                                  | 0                                     | 25                              |
| SCX        | 43                                  | 0                                     | 43                              | (2.467)                             | 2.350                                 | (117)                           |
| SOG        | 10                                  | 0                                     | 10                              | (5)                                 | 0                                     | (5)                             |
| SSB        | (289)                               | 330                                   | 41                              | (13)                                | 0                                     | (13)                            |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (557)                               | 280                                   | (277)                           |
| UAG        | 136                                 | (150)                                 | (14)                            | (205)                               | 300                                   | 95                              |
| WST        | (43)                                | 0                                     | (43)                            | (71)                                | 0                                     | (71)                            |

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

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 36,89             | 34,82             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 22,48             | 25,24             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,59              | 0,06              |
| Investmentfonds                                                        | 0,64              | 0,78              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,17              | 0,15              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,34              | 0,50              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,24              | 0,71              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,00              | 0,00              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 37,65             | 37,74             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

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

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert   | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Argentinien             | 0,05              | 0,06              |
| Australien              | 4,70              | 3,21              |
| Belgien                 | 0,46              | 0,44              |
| Kanada                  | 3,29              | 4,99              |
| Kaimaninseln            | 2,76              | 2,60              |
| Chile                   | 0,46              | 0,47              |
| Kolumbien               | 0,73              | 0,79              |
| Tschechische Republik   | 0,11              | 0,11              |
| Dänemark                | 0,81              | 0,09              |
| Dominikanische Republik | 0,45              | 0,48              |
| Ecuador                 | 0,21              | 0,18              |
| Ägypten                 | 0,21              | k. A.             |
| Finnland                | 0,11              | 0,11              |
| Frankreich              | 6,25              | 1,73              |
| Deutschland             | 0,21              | 0,43              |
| Guatemala               | 0,09              | 0,09              |
| Ungarn                  | 1,68              | 1,31              |
| Indien                  | 0,25              | 0,28              |
| Indonesien              | 0,56              | 0,38              |
| Irland                  | 3,95              | 3,91              |
| Israel                  | 1,51              | 1,92              |
| Italien                 | 0,67              | 1,27              |
| Elfenbeinküste          | 0,58              | 0,56              |
| Japan                   | 8,47              | 6,41              |
| Kasachstan              | 0,43              | 0,45              |
| Luxemburg               | 0,39              | 0,45              |
| Malaysia                | 0,64              | 0,92              |
| Mexiko                  | 0,88              | 0,47              |
| Multinational           | 0,11              | 0,13              |
| Niederlande             | 1,50              | 1,87              |



| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Neuseeland                                                                             | 0,37              | 0,02              |
| Norwegen                                                                               | 0,30              | 0,42              |
| Peru                                                                                   | 2,17              | 2,19              |
| Philippinen                                                                            | 0,08              | 0,09              |
| Polen                                                                                  | 1,47              | 0,97              |
| Portugal                                                                               | 0,16              | 0,19              |
| Rumänien                                                                               | 1,63              | 1,40              |
| Saudi-Arabien                                                                          | 1,30              | 0,68              |
| Senegal                                                                                | 0,23              | 0,31              |
| Serbien                                                                                | 1,29              | 0,97              |
| Singapur                                                                               | 1,32              | 1,64              |
| Südafrika                                                                              | 1,91              | 1,99              |
| Südkorea                                                                               | 2,25              | 2,70              |
| Spanien                                                                                | 3,57              | 0,77              |
| Supranational                                                                          | 0,66              | 0,70              |
| Schweiz                                                                                | 2,09              | 2,03              |
| Thailand                                                                               | 0,55              | 0,62              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 1,10              | 0,98              |
| Großbritannien                                                                         | 9,45              | 8,75              |
| USA                                                                                    | 76,82             | 61,12             |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,51              | 1,57              |
| Investmentfonds                                                                        | 1,62              | 1,63              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,33              | 0,23              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | k. A.             | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | (0,05)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,45)            | (0,35)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | 0,05              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | 0,08              |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | k. A.             | 0,09              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,01)            | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | (0,12)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | (0,01)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,02              | 0,01              |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | (0,06)            | 0,23              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,21)            | 0,04              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,22              | (0,85)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,01              | 0,01              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (8,85)            | (9,06)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (45,32)           | (18,18)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>         |                |                          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Bank of Queensland Ltd.                 |                |                          |                                   |
| 3,300 % fällig am 30.07.2029            | € 18.000       | \$ 21.678                | 0,13                              |
| Commonwealth Bank of Australia          |                |                          |                                   |
| 2,907 % fällig am 11.11.2030            | 24.000         | 28.454                   | 0,17                              |
| Lonsdale Finance Pty. Ltd.              |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 19.11.2031            | AUD 10.800     | 7.276                    | 0,04                              |
| Macquarie Bank Ltd.                     |                |                          |                                   |
| 2,778 % fällig am 25.02.2030            | € 22.500       | 26.582                   | 0,16                              |
| Westpac Banking Corp.                   |                |                          |                                   |
| 3,131 % fällig am 15.04.2031            | 43.800         | 52.374                   | 0,31                              |
|                                         |                | 136.364                  | 0,81                              |

|                               |            |        |      |
|-------------------------------|------------|--------|------|
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>         |            |        |      |
| <b>Household Capital RMBS</b> |            |        |      |
| 6,202 % fällig am 20.07.2086  | AUD 17.674 | 11.623 | 0,07 |
| 7,202 % fällig am 20.07.2086  | 3.800      | 2.494  | 0,01 |
|                               |            | 14.117 | 0,08 |

|                                                |         |         |      |
|------------------------------------------------|---------|---------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |         |         |      |
| <b>Australia Government International Bond</b> |         |         |      |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051                   | 16.900  | 6.025   | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 21.05.2030                   | 17.800  | 11.166  | 0,07 |
| <b>New South Wales Treasury Corp.</b>          |         |         |      |
| 1,750 % fällig am 20.03.2034                   | 73.250  | 37.948  | 0,22 |
| 2,000 % fällig am 08.03.2033                   | 36.800  | 20.258  | 0,12 |
| <b>Queensland Treasury Corp.</b>               |         |         |      |
| 1,500 % fällig am 20.08.2032                   | 35.700  | 19.256  | 0,11 |
| 1,750 % fällig am 20.07.2034                   | 45.000  | 22.914  | 0,13 |
| 2,000 % fällig am 22.08.2033                   | 24.582  | 13.268  | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 22.08.2035                   | 68.000  | 43.070  | 0,25 |
| <b>Treasury Corp. of Victoria</b>              |         |         |      |
| 2,000 % fällig am 17.09.2035                   | 74.300  | 37.184  | 0,22 |
| 2,250 % fällig am 15.09.2033                   | 148.150 | 81.443  | 0,48 |
| 2,250 % fällig am 20.11.2034                   | 37.100  | 19.572  | 0,12 |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032                   | 36.700  | 23.806  | 0,14 |
|                                                |         | 335.910 | 1,98 |
| Summe Australien                               |         | 486.391 | 2,87 |

|                                         |          |        |      |
|-----------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>BELGIEN</b>                          |          |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |        |      |
| <b>ING Belgium S.A.</b>                 |          |        |      |
| 3,000 % fällig am 15.02.2031            | € 27.000 | 32.157 | 0,19 |

|                                           |           |         |      |
|-------------------------------------------|-----------|---------|------|
| <b>KANADA</b>                             |           |         |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |           |         |      |
| <b>Canadian Imperial Bank of Commerce</b> |           |         |      |
| 2,625 % fällig am 01.10.2029              | 26.100    | 30.752  | 0,18 |
| <b>Fairfax Financial Holdings Ltd.</b>    |           |         |      |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028              | 12.300    | 14.364  | 0,08 |
| <b>Royal Bank of Canada</b>               |           |         |      |
| 4,851 % fällig am 14.12.2026              | \$ 20.400 | 20.636  | 0,12 |
| 4,969 % fällig am 02.08.2030              | 8.000     | 8.114   | 0,05 |
| <b>Toronto-Dominion Bank</b>              |           |         |      |
| 2,492 % fällig am 16.02.2027              | € 36.610  | 43.035  | 0,25 |
| 3,191 % fällig am 16.02.2029              | 41.400    | 49.784  | 0,29 |
| 4,814 % fällig am 16.07.2027              | \$ 39.200 | 39.849  | 0,24 |
| 4,838 % fällig am 11.06.2029              | £ 30.300  | 41.525  | 0,25 |
|                                           |           | 248.059 | 1,46 |

|                                          |           |       |      |
|------------------------------------------|-----------|-------|------|
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                    |           |       |      |
| <b>Real Estate Asset Liquidity Trust</b> |           |       |      |
| 3,650 % fällig am 12.08.2053             | CAD 3.943 | 2.882 | 0,02 |

|                                             |         |         |      |
|---------------------------------------------|---------|---------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                     |         |         |      |
| <b>Canada Government International Bond</b> |         |         |      |
| 2,000 % fällig am 01.06.2028                | 650     | 468     | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 01.03.2030                | 1.700   | 1.242   | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 01.12.2033                | 118.800 | 87.537  | 0,52 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2029                | 225.800 | 172.689 | 1,02 |
| <b>Canadian Government Real Return Bond</b> |         |         |      |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (d)            | 11.025  | 7.947   | 0,05 |

| BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>CPPIB Capital, Inc.</b>             |                |                          |                                   |
| 0,750 % fällig am 02.02.2037           | € 2.200        | \$ 1.946                 | 0,01                              |
| <b>Export Development Canada</b>       |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 28.01.2030           | £ 5.800        | 8.088                    | 0,05                              |
| 7,130 % fällig am 11.03.2029           | INR 2.145.700  | 25.450                   | 0,15                              |
| <b>Ontario Teachers' Finance Trust</b> |                |                          |                                   |
| 0,900 % fällig am 20.05.2041           | € 9.700        | 7.655                    | 0,04                              |
| <b>Province of British Columbia</b>    |                |                          |                                   |
| 4,150 % fällig am 18.06.2034           | CAD 105.600    | 79.833                   | 0,47                              |
| <b>Province of Ontario</b>             |                |                          |                                   |
| 0,010 % fällig am 25.11.2030           | € 30.200       | 30.725                   | 0,18                              |
| 3,650 % fällig am 02.06.2033           | CAD 96.700     | 71.265                   | 0,42                              |
| 4,150 % fällig am 02.06.2034           | 54.400         | 41.137                   | 0,24                              |
| <b>Province of Quebec</b>              |                |                          |                                   |
| 3,600 % fällig am 01.09.2033           | 209.800        | 153.679                  | 0,91                              |
| 4,450 % fällig am 01.09.2034           | 34.900         | 26.922                   | 0,16                              |
|                                        |                | 716.583                  | 4,23                              |
| Summe Kanada                           |                | 967.524                  | 5,71                              |

|                                                  |          |        |      |
|--------------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>KAIMANINSELN</b>                              |          |        |      |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>          |          |        |      |
| <b>BlueMountain CLO Ltd.</b>                     |          |        |      |
| 5,598 % fällig am 15.07.2031                     | \$ 3.669 | 3.671  | 0,02 |
| <b>Carbone CLO Ltd.</b>                          |          |        |      |
| 5,671 % fällig am 20.01.2031                     | 2.667    | 2.670  | 0,01 |
| <b>Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.</b> |          |        |      |
| 5,618 % fällig am 15.10.2030                     | 94       | 94     | 0,00 |
| 5,638 % fällig am 15.05.2031                     | 961      | 962    | 0,01 |
| <b>Catamaran CLO Ltd.</b>                        |          |        |      |
| 5,634 % fällig am 22.04.2030                     | 3.057    | 3.060  | 0,02 |
| <b>Dryden Senior Loan Fund</b>                   |          |        |      |
| 5,488 % fällig am 15.04.2031                     | 3.613    | 3.615  | 0,02 |
| <b>Sound Point CLO Ltd.</b>                      |          |        |      |
| 5,644 % fällig am 26.07.2031                     | 403      | 404    | 0,00 |
|                                                  |          | 14.476 | 0,08 |

|                                         |        |         |      |
|-----------------------------------------|--------|---------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |         |      |
| <b>Avolon Holdings Funding Ltd.</b>     |        |         |      |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027            | 431    | 410     | 0,00 |
| <b>Gaci First Investment Co.</b>        |        |         |      |
| 4,750 % fällig am 14.02.2030            | 28.600 | 28.734  | 0,17 |
| 4,875 % fällig am 14.02.2035            | 16.000 | 15.683  | 0,09 |
| 5,000 % fällig am 29.01.2029            | 31.900 | 32.273  | 0,19 |
| 5,125 % fällig am 14.02.2053            | 32.600 | 27.958  | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 29.01.2030 (h)        | 61.800 | 63.144  | 0,37 |
| 5,250 % fällig am 29.01.2034            | 38.500 | 38.876  | 0,23 |
| 5,625 % fällig am 29.07.2034            | 22.700 | 23.488  | 0,14 |
| <b>QNB Finance Ltd.</b>                 |        |         |      |
| 1,375 % fällig am 26.01.2026            | 2.060  | 2.022   | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 30.01.2029            | 33.200 | 33.697  | 0,20 |
| <b>Sands China Ltd.</b>                 |        |         |      |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028            | 9.500  | 9.577   | 0,06 |
| <b>Suci Second Investment Co.</b>       |        |         |      |
| 6,000 % fällig am 25.10.2028            | 29.600 | 30.824  | 0,18 |
|                                         |        | 306.686 | 1,81 |

|                              |        |         |      |
|------------------------------|--------|---------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>      |        |         |      |
| <b>KSA Sukuk Ltd.</b>        |        |         |      |
| 5,268 % fällig am 25.10.2028 | 8.500  | 8.725   | 0,05 |
| <b>RAK Capital</b>           |        |         |      |
| 5,000 % fällig am 12.03.2035 | 24.500 | 24.846  | 0,15 |
|                              |        | 33.571  | 0,20 |
| Summe Kaimaninseln           |        | 354.733 | 2,09 |

|                                            |        |        |      |
|--------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>CHILE</b>                               |        |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |        |        |      |
| <b>Chile Government International Bond</b> |        |        |      |
| 4,850 % fällig am 22.01.2029               | 13.300 | 13.509 | 0,08 |

|                                            |            |        |      |
|--------------------------------------------|------------|--------|------|
| <b>CHINA</b>                               |            |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |            |        |      |
| <b>China Government International Bond</b> |            |        |      |
| 3,190 % fällig am 15.04.2053               | CNY 61.240 | 10.828 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                        |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>Czech Republic Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 25.08.2028                        | CZK 2.900      | \$ 133                   | 0,00                              |

|                                         |       |   |      |
|-----------------------------------------|-------|---|------|
| <b>DÄNEMARK</b>                         |       |   |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |   |      |
| <b>Jyske Realkredit A/S</b>             |       |   |      |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050            | DKK 0 | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037            | 0     | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.07.2050            | 0     | 0 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050            | 0     | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047            | 0     | 0 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050            | 0     | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047            | 0     | 0 | 0,00 |

|                                             |        |       |      |
|---------------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>Nordea Kredit Realkreditaktieselskab</b> |        |       |      |
| 1,000 % fällig am 01.04.2026                | 11.900 | 1.860 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                | 0      | 0     | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037                | 0      | 0     | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050                | 0      | 0     | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                | 38.025 | 4.866 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2037                | 0      | 0     | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047                | 0      | 0     | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050                | 0      | 0     | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037                | 0      | 0     | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047                | 0      | 0     | 0,00 |

|                                |         |        |      |
|--------------------------------|---------|--------|------|
| <b>Nykredit Realkredit A/S</b> |         |        |      |
| 1,000 % fällig am 01.04.2026   | 118.800 | 18.583 | 0,11 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050   | 0       | 0      | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053   | 0       | 0      | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037   | 0       | 0      | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050   | 0       | 0      | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2052   | 7.674   | 981    | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047   | 0       | 0      | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050   | 0       | 0      | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036   | 0       | 0      | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047   | 0       | 0      | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047   | 0       | 0      | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2053   | 231.897 | 36.552 | 0,21 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2053   | 173.196 | 28.235 | 0,17 |

|                               |        |         |      |
|-------------------------------|--------|---------|------|
| <b>Realkredit Danmark A/S</b> |        |         |      |
| 1,000 % fällig am 01.04.2026  | 71.000 | 11.105  | 0,06 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050  | 0      | 0       | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053  | 0      | 0       | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053  | 8.052  | 1.030   | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050  | 0      | 0       | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2036  | 0      | 0       | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.04.2047  | 0      | 0       | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2046  | 0      | 0       | 0,00 |
| 3,280 % fällig am 01.01.2038  | 0      | 0       | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2056  | 98.103 | 15.371  | 0,09 |
| Summe Dänemark                |        | 118.583 | 0,70 |

|                                            |               |        |      |
|--------------------------------------------|---------------|--------|------|
| <b>ÄGYPTEN</b>                             |               |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |               |        |      |
| <b>Egypt Government International Bond</b> |               |        |      |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028              | EGP 1.673.600 | 33.321 | 0,20 |

|                                                  |           |        |      |
|--------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>FRANKREICH</b>                                |           |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |           |        |      |
| <b>Banque Federative du Credit Mutuel S.A.</b>   |           |        |      |
| 5,088 % fällig am 23.01.2027                     | \$ 16.400 | 16.589 | 0,10 |
| <b>BNP Paribas S.A.</b>                          |           |        |      |
| 2,871 % fällig am 19.04.2032 (h)                 | 12.000    | 10.757 | 0,06 |
| 5,786 % fällig am 13.01.2033 (h)                 | 39.600    | 41.220 | 0,24 |
| <b>BPCE S.A.</b>                                 |           |        |      |
| 5,876 % fällig am 14.01.2031                     | 5.100     | 5.292  | 0,03 |
| 6,293 % fällig am 14.01.2036                     | 5.800     | 6.094  | 0,04 |
| <b>Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A.</b> |           |        |      |
| 2,875 % fällig am 25.03.2031                     | € 23.300  | 27.508 | 0,16 |
| <b>Cie de Financement Foncier S.A.</b>           |           |        |      |
| 3,000 % fällig am 24.04.2032                     | 28.700    | 33.769 | 0,20 |
| 3,125 % fällig am 24.04.2027                     | 54.800    | 65.482 | 0,39 |
| 3,125 % fällig am 06.06.2030                     | 12.800    | 15.352 | 0,09 |
| <b>Credit Agricole Home Loan SFH S.A.</b>        |           |        |      |
| 3,000 % fällig am 01.12.2030                     | 22.900    | 27.293 | 0,16 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Credit Agricole S.A.</b>      |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 22.01.2034     | € 19.800       | \$ 23.856                | 0,14                              |
| 5,134 % fällig am 11.03.2027     | \$ 36.400      | 36.961                   | 0,22                              |
| 5,862 % fällig am 09.01.2036     | 26.388         | 27.367                   | 0,16                              |
| <b>Dexia S.A.</b>                |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 21.01.2028 (b) | € 9.100        | 10.088                   | 0,06                              |
|                                  |                | 347.628                  | 2,05                              |

### STAATSEMISSIONEN

|                                             |         |         |      |
|---------------------------------------------|---------|---------|------|
| <b>France Government International Bond</b> |         |         |      |
| 0,500 % fällig am 25.05.2072                | 15.250  | 4.922   | 0,03 |
| 0,750 % fällig am 25.02.2028                | 144.250 | 163.374 | 0,97 |
| 0,750 % fällig am 25.05.2052                | 89.050  | 49.826  | 0,29 |
| 2,750 % fällig am 25.10.2027                | 197.250 | 235.108 | 1,39 |
| 2,750 % fällig am 25.02.2030                | 353.200 | 418.920 | 2,47 |
| 3,000 % fällig am 25.06.2049                | 700     | 710     | 0,00 |
|                                             |         | 872.860 | 5,15 |

Summe Frankreich

1.220.488 7,20

### DEUTSCHLAND

#### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                         |        |        |      |
|-----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>Commerzbank AG</b>                   |        |        |      |
| 3,625 % fällig am 14.01.2032            | 14.000 | 16.583 | 0,09 |
| <b>Deutsche Bank AG</b>                 |        |        |      |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030            | 4.400  | 4.847  | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 23.02.2028            | 5.900  | 6.849  | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 13.02.2031            | 800    | 942    | 0,01 |
| <b>Volkswagen Financial Services AG</b> |        |        |      |
| 2,739 % fällig am 10.06.2027            | 8.500  | 10.000 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 10.09.2026            | 5.900  | 7.030  | 0,04 |
|                                         |        | 46.251 | 0,27 |

### STAATSEMISSIONEN

|                                   |        |        |      |
|-----------------------------------|--------|--------|------|
| <b>Bundesrepublik Deutschland</b> |        |        |      |
| 2,300 % fällig am 15.02.2033      | 18.500 | 21.538 | 0,13 |
| Summe Deutschland                 |        | 67.789 | 0,40 |

### UNGARN

#### STAATSEMISSIONEN

|                                              |          |        |      |
|----------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>Hungary Government International Bond</b> |          |        |      |
| 4,000 % fällig am 25.07.2029                 | 26.500   | 31.973 | 0,19 |
| 4,500 % fällig am 16.06.2034                 | 14.900   | 17.654 | 0,11 |
| 4,875 % fällig am 22.03.2040                 | 1.800    | 2.068  | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 26.03.2036                 | \$ 4.200 | 4.057  | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 22.09.2032                 | 18.300   | 19.132 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 29.03.2041                 | 100      | 113    | 0,00 |
| <b>Magyar Export-Import Bank</b>             |          |        |      |
| 6,000 % fällig am 16.05.2029                 | € 14.000 | 17.756 | 0,11 |
| Summe Ungarn                                 |          | 92.753 | 0,55 |

### INDONESIEN

#### STAATSEMISSIONEN

|                                                |          |        |      |
|------------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>Indonesia Government International Bond</b> |          |        |      |
| 4,125 % fällig am 15.01.2037                   | 8.400    | 9.989  | 0,06 |
| 5,600 % fällig am 15.01.2035 (h)               | \$ 6.700 | 7.002  | 0,04 |
| Summe Indonesien                               |          | 16.991 | 0,10 |

### INTERNATIONAL

#### KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                                        |          |        |      |
|----------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>Project Mercury</b>                 |          |        |      |
| 0,400 % - 6,668 % fällig am 11.08.2030 | € 25.000 | 30.307 | 0,18 |

### IRLAND

#### FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

|                                         |        |        |      |
|-----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>Accunia European CLO DAC</b>         |        |        |      |
| 3,229 % fällig am 15.07.2030            | 1.294  | 1.521  | 0,01 |
| <b>Anchorage Capital Europe CLO DAC</b> |        |        |      |
| 3,499 % fällig am 15.10.2038            | 42.000 | 49.230 | 0,29 |
| <b>Ares European CLO DAC</b>            |        |        |      |
| 3,059 % fällig am 15.10.2031            | 11.923 | 13.976 | 0,08 |
| 3,086 % fällig am 20.04.2032            | 8.388  | 9.850  | 0,06 |
| <b>Aurium CLO DAC</b>                   |        |        |      |
| 2,982 % fällig am 16.01.2031            | 27.580 | 32.334 | 0,19 |

| BESCHREIBUNG                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Avoca CLO DAC</b>              |                |                          |                                   |
| 3,999 % fällig am 15.10.2032      | € 8.722        | \$ 10.231                | 0,06                              |
| <b>Bain Capital Euro CLO DAC</b>  |                |                          |                                   |
| 2,976 % fällig am 20.01.2032      | 6.913          | 8.097                    | 0,05                              |
| <b>Black Diamond CLO DAC</b>      |                |                          |                                   |
| 3,123 % fällig am 15.05.2032      | 3.017          | 3.540                    | 0,02                              |
| <b>Blackrock European CLO DAC</b> |                |                          |                                   |
| 2,899 % fällig am 15.10.2031      | 6.735          | 7.884                    | 0,05                              |
| 3,156 % fällig am 20.01.2036      | 4.000          | 4.685                    | 0,03                              |

### BlueMountain Fuji EUR CLO DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,999 % fällig am 15.01.2031 | 5.570 | 6.543 | 0,04 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### BNPP AM Euro CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,056 % fällig am 22.07.2032 | 12.684 | 14.848 | 0,09 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Cairn CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,059 % fällig am 15.10.2031 | 11.947 | 14.002 | 0,08 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Carlyle Euro CLO DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 3,033 % fällig am 15.08.2032 | 3.080 | 3.600 | 0,02 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,893 % fällig am 15.11.2031 | 5.793 | 6.805 | 0,04 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### Contego CLO DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,823 % fällig am 23.01.2030 | 6.263 | 7.341 | 0,04 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### CVC Cordatus Loan Fund DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,886 % fällig am 21.07.2030 | 8.297 | 9.756 | 0,06 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### Dryden Euro CLO DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,939 % fällig am 15.04.2033 | 4.980 | 5.843 | 0,03 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### Griffith Park CLO DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,795 % fällig am 21.11.2031 | 6.284 | 7.360 | 0,04 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### Harvest CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 2,916 % fällig am 20.10.2031 | 11.104 | 13.032 | 0,08 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Hayfin Emerald CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,337 % fällig am 17.11.2037 | 16.700 | 19.581 | 0,12 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Indigo Credit Management DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 3,479 % fällig am 15.07.2038 | 4.800 | 5.645 | 0,03 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### Jubilee CLO DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,929 % fällig am 15.04.2031 | 1.070 | 1.253 | 0,01 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### Madison Park Euro Funding DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,029 % fällig am 15.01.2032 | 22.675 | 26.537 | 0,16 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Oak Hill European Credit Partners DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 2,976 % fällig am 20.10.2031 | 11.837 | 13.881 | 0,08 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### OCP Euro CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,116 % fällig am 22.09.2034 | 16.516 | 19.385 | 0,11 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Palmer Square European Loan Funding DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 2,999 % fällig am 15.10.2031 | 4.167 | 4.881 | 0,03 |
|------------------------------|-------|-------|------|

### RRE Loan Management DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,229 % fällig am 15.01.2037 | 10.000 | 11.722 | 0,07 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Sculptor European CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,055 % fällig am 14.01.2032 | 28.860 | 33.840 | 0,20 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Segovia European CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,116 % fällig am 20.07.2032 | 12.430 | 14.612 | 0,09 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Toro European CLO DAC

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 2,953 % fällig am 15.02.2034 | 22.438 | 26.258 | 0,15 |
|------------------------------|--------|--------|------|

### Trinitas Euro CLO DAC

|                                  |       |       |      |
|----------------------------------|-------|-------|------|
| 0,000 % fällig am 15.07.2039 (a) | 7.500 | 8.804 | 0,05 |
|----------------------------------|-------|-------|------|

### Voya Euro CLO DAC

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 3,249 % fällig am 15.10.2034 | 3.700 | 4.340 | 0,03 |
|------------------------------|-------|-------|------|

493.110 2,91

### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

#### AerCap Ireland Capital DAC

|                              |        |     |      |
|------------------------------|--------|-----|------|
| 2,450 % fällig am 29.10.2026 | \$ 200 | 195 | 0,00 |
|------------------------------|--------|-----|------|

|                              |     |     |      |
|------------------------------|-----|-----|------|
| 3,000 % fällig am 29.10.2028 | 900 | 858 | 0,01 |
|------------------------------|-----|-----|------|

#### Iridium Capital PLC

|                              |          |        |      |
|------------------------------|----------|--------|------|
| 4,103 % fällig am 07.03.2027 | € 26.800 | 31.184 | 0,18 |
|------------------------------|----------|--------|------|

32.237 0,19

Summe Irland

525.347 3,10

### ISRAEL

#### STAATSEMISSIONEN

##### Israel Government International Bond

|                              |           |        |      |
|------------------------------|-----------|--------|------|
| 4,500 % fällig am 17.01.2033 | \$ 11.300 | 10.811 | 0,06 |
|------------------------------|-----------|--------|------|

| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,000 % fällig am 30.10.2026 | € 80.700       | \$ 97.414                | 0,58                              |
| 5,375 % fällig am 12.03.2029 | \$ 13.750      | 14.042                   | 0,08                              |
| 5,375 % fällig am 19.02.2030 | 10.000         | 10.203                   | 0,06                              |
| 5,500 % fällig am 12.03.2034 | 16.600         | 16.831                   | 0,10                              |
| 5,625 % fällig am 19.02.2035 | 21.400         | 21.791                   | 0,13                              |
| 5,750 % fällig am 12.03.2054 | 15.700         | 14.562                   | 0,09                              |
| Summe Israel                 |                | 185.654                  | 1,10                              |

### ITALIEN

#### FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

|                                      |          |        |      |
|--------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>Golden Bar Securitisation SRL</b> |          |        |      |
| 3,086 % fällig am 22.09.2043         | € 30.232 | 35.719 | 0,21 |

#### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

##### AMCO - Asset Management Co. SpA

|                              |     |     |      |
|------------------------------|-----|-----|------|
| 0,750 % fällig am 20.04.2028 | 300 | 335 | 0,00 |
|------------------------------|-----|-----|------|

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 4,625 % fällig am 06.02.2027 | 17.500 | 21.283 | 0,13 |
|------------------------------|--------|--------|------|

##### Banca Monte dei Paschi di Siena SpA

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 0,875 % fällig am 08.10.2027 | 8.000 | 9.251 | 0,05 |
|------------------------------|-------|-------|------|

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 6,750 % fällig am 05.09.2027 | 12.000 | 14.721 | 0,09 |
|------------------------------|--------|--------|------|

##### Intesa Sanpaolo SpA

|                              |           |        |      |
|------------------------------|-----------|--------|------|
| 6,625 % fällig am 20.06.2033 | \$ 10.500 | 11.405 | 0,07 |
|------------------------------|-----------|--------|------|

##### Nexi SpA

|                              |         |       |      |
|------------------------------|---------|-------|------|
| 1,625 % fällig am 30.04.2026 | € 6.639 | 7.708 | 0,04 |
|------------------------------|---------|-------|------|

64.703 0,38

### STAATSEMISSIONEN

#### Cassa Depositi e Prestiti SpA

|                              |           |        |      |
|------------------------------|-----------|--------|------|
| 5,750 % fällig am 05.05.2026 | \$ 21.500 | 21.721 | 0,13 |
|------------------------------|-----------|--------|------|

#### Italy Buoni Poliennali Del Tesoro

|                                  |          |        |      |
|----------------------------------|----------|--------|------|
| 0,000 % fällig am 01.04.2026 (b) | € 19.800 | 22.916 | 0,13 |
|----------------------------------|----------|--------|------|

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 3,850 % fällig am 15.09.2026 | 17.000 | 20.391 | 0,12 |
|------------------------------|--------|--------|------|

#### Italy Government International Bond

|                              |         |       |      |
|------------------------------|---------|-------|------|
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ 5.684 | 8.103 | 0,05 |
|------------------------------|---------|-------|------|

73.131 0,43

Summe Italien

173.553 1,02

### JAPAN

#### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

##### Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.

|                              |           |        |      |
|------------------------------|-----------|--------|------|
| 1,412 % fällig am 17.07.2025 | \$ 29.800 | 29.759 | 0,17 |
|------------------------------|-----------|--------|------|

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 5,017 % fällig am 20.07.2028 | 18.000 | 18.237 | 0,11 |
|------------------------------|--------|--------|------|

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 5,354 % fällig am 13.09.2028 | 8.000 | 8.174 | 0,05 |
|------------------------------|-------|-------|------|

##### Nissan Motor Co. Ltd.

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| 3,522 % fällig am 17.09.2025 | 2.100 | 2.089 | 0,01 |
|------------------------------|-------|-------|------|

##### Nomura Holdings, Inc.

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 2,329 % fällig am 22.01.2027 | 11.100 | 10.740 | 0,06 |
|------------------------------|--------|--------|------|

##### Sumitomo Mitsui Banking Corp.

|                              |          |        |      |
|------------------------------|----------|--------|------|
| 0,010 % fällig am 10.09.2025 | € 43.700 | 51.096 | 0,30 |
|------------------------------|----------|--------|------|

|                              |        |        |      |
|------------------------------|--------|--------|------|
| 0,409 % fällig am 07.11.2029 | 26.500 | 28.243 | 0,17 |
|------------------------------|--------|--------|------|

##### Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.

|                              |           |        |      |
|------------------------------|-----------|--------|------|
| 5,520 % fällig am 13.01.2028 | \$ 35.700 | 36.772 | 0,22 |
|------------------------------|-----------|--------|------|

##### Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.

|                              |          |        |      |
|------------------------------|----------|--------|------|
| 0,010 % fällig am 15.10.2027 | € 34.800 | 38.706 | 0,23 |
|------------------------------|----------|--------|------|

223.816 1,32

### STAATSEMISSIONEN

#### Japan Finance Organization for Municipalities

|                              |          |       |   |
|------------------------------|----------|-------|---|
| 0,625 % fällig am 02.09.2025 | \$ 1.400 | 1.391 | 0 |
|------------------------------|----------|-------|---|

| BESCHREIBUNG                     | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 2,200 % fällig am 20.03.2064     | ¥ 9.737.000 | \$ 54.205                | 0,32                              |
| 2,300 % fällig am 20.12.2054     | 25.428.000  | 158.249                  | 0,93                              |
| 2,400 % fällig am 20.03.2045     | 11.959.000  | 83.350                   | 0,49                              |
| 2,400 % fällig am 20.03.2055     | 8.395.000   | 53.395                   | 0,31                              |
| Tokyo Metropolitan Government    |             |                          |                                   |
| 0,750 % fällig am 16.07.2025 (h) | \$ 18.600   | 18.569                   | 0,11                              |
|                                  |             | 1.035.396                | 6,11                              |
| Summe Japan                      |             | 1.259.212                | 7,43                              |

#### LUXEMBURG UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                        |     |    |      |
|----------------------------------------|-----|----|------|
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. |     |    |      |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^         | 500 | 30 | 0,00 |

#### KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                              |          |        |      |
|------------------------------|----------|--------|------|
| Telecom Serbia               |          |        |      |
| 3,399 % fällig am 11.06.2029 | € 20.300 | 23.669 | 0,14 |
| Summe Luxemburg              |          | 23.699 | 0,14 |

#### MALAYSIA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |           |        |      |
|------------------------------|-----------|--------|------|
| Petronas Capital Ltd.        |           |        |      |
| 2,480 % fällig am 28.01.2032 | \$ 10.400 | 9.069  | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 21.04.2030 | 8.600     | 8.262  | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050 | 6.100     | 5.173  | 0,03 |
| 4,800 % fällig am 21.04.2060 | 5.000     | 4.306  | 0,03 |
|                              |           | 26.810 | 0,16 |

#### STAATSEMISSIONEN

|                                        |            |         |      |
|----------------------------------------|------------|---------|------|
| Malaysia Government International Bond |            |         |      |
| 2,632 % fällig am 15.04.2031           | MYR 85.560 | 19.593  | 0,11 |
| 3,519 % fällig am 20.04.2028           | 394.244    | 94.633  | 0,56 |
| 3,582 % fällig am 15.07.2032           | 12.630     | 3.042   | 0,02 |
| Malaysia Government Investment Issue   |            |         |      |
| 4,193 % fällig am 07.10.2032           | 68.050     | 16.958  | 0,10 |
|                                        |            | 134.226 | 0,79 |
| Summe Malaysia                         |            | 161.036 | 0,95 |

#### MEXIKO STAATSEMISSIONEN

|                                      |          |        |      |
|--------------------------------------|----------|--------|------|
| Mexico Government International Bond |          |        |      |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115         | € 800    | 627    | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 27.04.2051         | \$ 7.800 | 6.068  | 0,04 |
| 5,850 % fällig am 02.07.2032 (a)     | 10.500   | 10.639 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 29.01.2038 (a)     | 7.200    | 7.319  | 0,04 |
| Summe Mexiko                         |          | 24.653 | 0,15 |

#### MULTINATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                |       |       |      |
|--------------------------------|-------|-------|------|
| Preferred Term Securities Ltd. |       |       |      |
| 4,890 % fällig am 22.12.2036   | 6.615 | 6.566 | 0,04 |
| 4,980 % fällig am 22.03.2038   | 2.398 | 2.284 | 0,01 |
| Summe multinational            |       | 8.850 | 0,05 |

#### NIEDERLANDE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                  |          |         |      |
|----------------------------------|----------|---------|------|
| ABN AMRO Bank NV                 |          |         |      |
| 1,125 % fällig am 12.01.2032     | € 300    | \$ 318  | 0,00 |
| 5,515 % fällig am 03.12.2035     | \$ 7.600 | 7.747   | 0,05 |
| Achmea Bank NV                   |          |         |      |
| 3,125 % fällig am 11.06.2036 (h) | € 14.000 | 16.386  | 0,10 |
| Coöperatieve Rabobank UA         |          |         |      |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033     | \$ 2.300 | 2.148   | 0,01 |
| 5,447 % fällig am 05.03.2030     | 40.200   | 41.470  | 0,24 |
| 5,710 % fällig am 21.01.2033     | 30.000   | 31.245  | 0,18 |
| CTP NV                           |          |         |      |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026     | € 2.128  | 2.433   | 0,01 |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026     | 5.234    | 6.089   | 0,04 |
| de Volksbank NV                  |          |         |      |
| 3,000 % fällig am 26.03.2031     | 8.000    | 9.518   | 0,06 |
| ING Groep NV                     |          |         |      |
| 3,875 % fällig am 12.08.2029     | 19.200   | 23.240  | 0,14 |
| 4,000 % fällig am 12.02.2035     | 11.000   | 13.354  | 0,08 |
| 5,550 % fällig am 19.03.2035     | \$ 4.000 | 4.098   | 0,02 |
|                                  |          | 158.046 | 0,93 |

#### NON-AGENCY-MBS

|                              |         |         |      |
|------------------------------|---------|---------|------|
| Dutch Property Finance BV    |         |         |      |
| 2,811 % fällig am 28.07.2058 | € 9.618 | 11.291  | 0,07 |
| Jubilee Place BV             |         |         |      |
| 3,093 % fällig am 17.07.2058 | 6.338   | 7.447   | 0,04 |
| 3,263 % fällig am 17.10.2057 | 3.689   | 4.337   | 0,03 |
|                              |         | 23.075  | 0,14 |
| Summe Niederlande            |         | 181.121 | 1,07 |

#### NEUSEELAND STAATSEMISSIONEN

|                                           |        |        |      |
|-------------------------------------------|--------|--------|------|
| Auckland Council                          |        |        |      |
| 1,000 % fällig am 19.01.2027              | 5.800  | 6.686  | 0,04 |
| New Zealand Government International Bond |        |        |      |
| 1,500 % fällig am 15.05.2031 NZD          | 16.500 | 8.689  | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025              | 740    | 827    | 0,01 |
| Summe Neuseeland                          |        | 16.202 | 0,10 |

#### NIGERIA KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

|                              |          |        |      |
|------------------------------|----------|--------|------|
| Bank of Industry Ltd.        |          |        |      |
| 3,695 % fällig am 23.08.2027 | € 12.400 | 14.459 | 0,09 |

#### NORWEGEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                      |        |        |      |
|--------------------------------------|--------|--------|------|
| SR-Boligkredit A/S                   |        |        |      |
| 3,125 % fällig am 19.02.2032         | 30.500 | 36.442 | 0,21 |
| STAATSEMISSIONEN                     |        |        |      |
| Kommunalbanken A/S                   |        |        |      |
| 1,900 % fällig am 19.01.2027 AUD     | 22.000 | 14.048 | 0,08 |
| Norway Government International Bond |        |        |      |
| 1,250 % fällig am 17.09.2031 NOK     | 1.900  | 162    | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 17.02.2027         | 1.100  | 106    | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 26.04.2028         | 7.300  | 693    | 0,01 |
|                                      |        | 15.009 | 0,09 |
| Summe Norwegen                       |        | 51.451 | 0,30 |

#### PERU STAATSEMISSIONEN

|                                    |          |         |      |
|------------------------------------|----------|---------|------|
| Peru Government International Bond |          |         |      |
| 2,780 % fällig am 01.12.2060       | \$ 6.000 | 3.238   | 0,02 |
| 3,230 % fällig am 28.07.2121       | 4.200    | 2.264   | 0,01 |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 PEN   | 31.600   | 8.430   | 0,05 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032       | 86.648   | 25.259  | 0,15 |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037       | 42.600   | 12.236  | 0,07 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031       | 49.601   | 15.199  | 0,09 |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033       | 231.500  | 71.188  | 0,42 |
| 7,600 % fällig am 12.08.2039       | 37.800   | 11.365  | 0,07 |
| Summe Peru                         |          | 149.179 | 0,88 |

#### POLEN STAATSEMISSIONEN

|                                      |          |          |      |
|--------------------------------------|----------|----------|------|
| Bank Gospodarstwa Krajowego          |          |          |      |
| 3,250 % fällig am 18.03.2030         | € 6.400  | \$ 7.621 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 18.03.2037         | 4.000    | 4.731    | 0,03 |
| 4,375 % fällig am 13.03.2039         | 9.100    | 10.664   | 0,06 |
| Poland Government International Bond |          |          |      |
| 3,625 % fällig am 11.01.2034 (h)     | 4.900    | 5.891    | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 14.02.2033         | 15.500   | 19.085   | 0,11 |
| 4,125 % fällig am 11.01.2044         | 2.100    | 2.440    | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 14.02.2043         | 3.400    | 4.004    | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 18.03.2029         | \$ 8.000 | 8.126    | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2030         | 9.500    | 9.697    | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 04.10.2033         | 6.500    | 6.471    | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 12.02.2035         | 6.900    | 7.042    | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 04.04.2053         | 6.000    | 5.598    | 0,03 |
| Summe Polen                          |          | 91.370   | 0,54 |

#### PORTUGAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                |         |       |      |
|--------------------------------|---------|-------|------|
| Banco Espírito Santo S.A.      |         |       |      |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € 6.900 | 1.904 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | 1.900   | 524   | 0,00 |
| Summe Portugal                 |         | 2.428 | 0,01 |

#### KATAR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |          |        |      |
|------------------------------|----------|--------|------|
| QatarEnergy                  |          |        |      |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | \$ 9.400 | 8.245  | 0,05 |
| 3,300 % fällig am 12.07.2051 | 5.900    | 3.989  | 0,02 |
| Summe Katar                  |          | 12.234 | 0,07 |

#### RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN

|                                       |         |         |      |
|---------------------------------------|---------|---------|------|
| Romania Government International Bond |         |         |      |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029          | € 6.560 | 6.746   | 0,04 |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030          | 16.600  | 16.757  | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032          | 1.000   | 953     | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033          | 18.950  | 17.077  | 0,10 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031          | 2.600   | 2.543   | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028          | 20.150  | 22.811  | 0,13 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040          | 7.400   | 5.415   | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041          | 13.300  | 9.748   | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042          | 11.000  | 8.055   | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 27.09.2026          | 6.800   | 8.208   | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 24.09.2031          | 25.510  | 29.598  | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030          | 15.000  | 18.000  | 0,11 |
| 5,250 % fällig am 30.05.2032          | 17.400  | 20.128  | 0,12 |
| 5,625 % fällig am 30.05.2037 (h)      | 6.200   | 6.860   | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 10.09.2034          | 3.500   | 4.150   | 0,02 |
| 6,375 % fällig am 18.09.2033          | 13.300  | 16.093  | 0,09 |
| 6,625 % fällig am 27.09.2029          | 8.700   | 11.015  | 0,07 |
| Summe Rumänien                        |         | 204.157 | 1,21 |

#### SAUDI-ARABIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |           |        |      |
|------------------------------|-----------|--------|------|
| Saudi Arabian Oil Co.        |           |        |      |
| 2,250 % fällig am 24.11.2030 | \$ 12.600 | 11.203 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 24.11.2050 | 6.500     | 4.135  | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 24.11.2070 | 1.600     | 960    | 0,01 |
| 5,375 % fällig am 02.06.2035 | 7.900     | 7.944  | 0,05 |
| 6,375 % fällig am 02.06.2055 | 4.000     | 4.003  | 0,02 |
|                              |           | 28.245 | 0,17 |

#### STAATSEMISSIONEN

|                                            |           |         |      |
|--------------------------------------------|-----------|---------|------|
| Saudi Arabia Government International Bond |           |         |      |
| 3,250 % fällig am 22.10.2030               | 3.100     | 2.909   | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 05.03.2032               | € 21.000  | 24.571  | 0,14 |
| 3,750 % fällig am 05.03.2037               | 800       | 916     | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 05.03.2037 (h)           | 4.500     | 5.151   | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 18.01.2028               | \$ 32.600 | 32.875  | 0,19 |
| 4,750 % fällig am 16.01.2030               | 43.700    | 44.151  | 0,26 |
| 4,875 % fällig am 18.07.2033               | 12.700    | 12.762  | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 18.01.2053               | 2.900     | 2.476   | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028               | 57.800    | 58.779  | 0,35 |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031               | 18.200    | 18.888  | 0,11 |
|                                            |           | 203.478 | 1,20 |
| Summe Saudi-Arabien                        |           | 231.723 | 1,37 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

|                                                        |             | % DES                    |                          |                                          |             | % DES                    |                          |
|--------------------------------------------------------|-------------|--------------------------|--------------------------|------------------------------------------|-------------|--------------------------|--------------------------|
| BESCHREIBUNG                                           | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
| SINGAPUR                                               |             |                          |                          | Autonomous Community of Catalonia        |             |                          |                          |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                       |             |                          |                          | Spain Government International Bond      |             |                          |                          |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.               |             |                          |                          | 0,000 % fällig am 31.01.2028 (b)         |             |                          |                          |
| 5,806 % fällig am                                      |             |                          |                          | 1,450 % fällig am 31.10.2071             |             |                          |                          |
| 11.04.2043                                             |             |                          |                          | 1,900 % fällig am 31.10.2052             |             |                          |                          |
| \$ 4.507 \$ 4.505 0,03                                 |             |                          |                          | 2,400 % fällig am 31.05.2028             |             |                          |                          |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                       |             |                          |                          | 2,500 % fällig am 31.05.2027             |             |                          |                          |
| Clifford Capital Pte Ltd.                              |             |                          |                          | 2,700 % fällig am 31.01.2030             |             |                          |                          |
| 4,781 % fällig am                                      |             |                          |                          | 3,150 % fällig am 30.04.2035             |             |                          |                          |
| 14.01.2030                                             |             |                          |                          | 3,200 % fällig am 31.10.2035             |             |                          |                          |
| 14.600 15.037 0,09                                     |             |                          |                          | 3,450 % fällig am 30.07.2066             |             |                          |                          |
| DBS Bank Ltd.                                          |             |                          |                          | 3,550 % fällig am 31.10.2033             |             |                          |                          |
| 3,209 % fällig am                                      |             |                          |                          | 5,250 % fällig am 06.04.2029             |             |                          |                          |
| 19.08.2026                                             |             |                          |                          | £ 800 1.128 0,01                         |             |                          |                          |
| € 37.900 45.085 0,26                                   |             |                          |                          | 775.604 4,58                             |             |                          |                          |
| 60.122 0,35                                            |             |                          |                          | 789.443 4,66                             |             |                          |                          |
| STAATSEMISSIONEN                                       |             |                          |                          | SUPRANATIONAL                            |             |                          |                          |
| Singapore Government International Bond                |             |                          |                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL         |             |                          |                          |
| 2,375 % fällig am                                      |             |                          |                          | Europäische Investitionsbank             |             |                          |                          |
| 01.07.2039                                             |             |                          |                          | 4,500 % fällig am 31.01.2028             |             |                          |                          |
| SGD 10.089 7.970 0,05                                  |             |                          |                          | 4,600 % fällig am 30.01.2037 CAD         |             |                          |                          |
| 2,750 % fällig am                                      |             |                          |                          | Inter-American Development Bank          |             |                          |                          |
| 01.03.2035                                             |             |                          |                          | 2,500 % fällig am 14.04.2027 AUD         |             |                          |                          |
| 58.570 48.120 0,28                                     |             |                          |                          | 15.200 9.793 0,06                        |             |                          |                          |
| 3,250 % fällig am                                      |             |                          |                          | Summe Supranational                      |             |                          |                          |
| 01.06.2054                                             |             |                          |                          | 42.446 0,25                              |             |                          |                          |
| 79.908 74.686 0,44                                     |             |                          |                          | SCHWEIZ                                  |             |                          |                          |
| 130.776 0,77                                           |             |                          |                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL         |             |                          |                          |
| 195.403 1,15                                           |             |                          |                          | UBS AG                                   |             |                          |                          |
| SLOWAKEI                                               |             |                          |                          | 0,250 % fällig am 05.01.2026             |             |                          |                          |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                       |             |                          |                          | UBS Group AG                             |             |                          |                          |
| 365 bank A/S                                           |             |                          |                          | 2,875 % fällig am 02.04.2032             |             |                          |                          |
| 7,125 % fällig am                                      |             |                          |                          | 3,091 % fällig am                        |             |                          |                          |
| 04.07.2028                                             |             |                          |                          | 14.05.2032 (h)                           |             |                          |                          |
| € 11.500 14.505 0,09                                   |             |                          |                          | 3,869 % fällig am 12.01.2029             |             |                          |                          |
| SÜDAFRIKA                                              |             |                          |                          | 4,125 % fällig am 09.06.2033             |             |                          |                          |
| STAATSEMISSIONEN                                       |             |                          |                          | 4,194 % fällig am 01.04.2031             |             |                          |                          |
| South Africa Government International Bond             |             |                          |                          | 4,550 % fällig am 17.04.2026             |             |                          |                          |
| 7,000 % fällig am                                      |             |                          |                          | 6,373 % fällig am 15.07.2026             |             |                          |                          |
| 28.02.2031                                             |             |                          |                          | 6,442 % fällig am 11.08.2028             |             |                          |                          |
| ZAR 308.700 15.981 0,10                                |             |                          |                          | 6,537 % fällig am 12.08.2033             |             |                          |                          |
| 8,000 % fällig am                                      |             |                          |                          | 7,375 % fällig am 07.09.2033             |             |                          |                          |
| 31.01.2030                                             |             |                          |                          | £ 6.900 10.703 0,06                      |             |                          |                          |
| 8,875 % fällig am                                      |             |                          |                          | UBS Switzerland AG                       |             |                          |                          |
| 28.02.2035                                             |             |                          |                          | 3,304 % fällig am 05.03.2029             |             |                          |                          |
| 1.359.300 71.424 0,42                                  |             |                          |                          | € 22.800 27.467 0,16                     |             |                          |                          |
| Summe Südafrika                                        |             |                          |                          | Summe Schweiz                            |             |                          |                          |
| 130.151 0,77                                           |             |                          |                          | 218.176 1,29                             |             |                          |                          |
| SÜDKOREA                                               |             |                          |                          | THAILAND                                 |             |                          |                          |
| STAATSEMISSIONEN                                       |             |                          |                          | STAATSEMISSIONEN                         |             |                          |                          |
| Korea Housing Finance Corp.                            |             |                          |                          | Thailand Government International Bond   |             |                          |                          |
| 2,733 % fällig am                                      |             |                          |                          | 2,410 % fällig am 17.03.2035 THB         |             |                          |                          |
| 02.07.2028                                             |             |                          |                          | 489.270 16.136 0,10                      |             |                          |                          |
| € 31.700 37.469 0,22                                   |             |                          |                          | 2,500 % fällig am 17.11.2029             |             |                          |                          |
| 2,742 % fällig am                                      |             |                          |                          | 3,775 % fällig am 25.06.2032             |             |                          |                          |
| 05.03.2030                                             |             |                          |                          | 448.830 15.875 0,09                      |             |                          |                          |
| 35.300 41.496 0,25                                     |             |                          |                          | Summe Thailand                           |             |                          |                          |
| South Korea Government International Bond              |             |                          |                          | 107.776 0,64                             |             |                          |                          |
| 1,375 % fällig am                                      |             |                          |                          | VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE             |             |                          |                          |
| 10.06.2030                                             |             |                          |                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL         |             |                          |                          |
| KRW 26.604.840 18.575 0,11                             |             |                          |                          | Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC |             |                          |                          |
| 2,375 % fällig am                                      |             |                          |                          | 4,500 % fällig am 06.05.2030             |             |                          |                          |
| 10.12.2028                                             |             |                          |                          | \$ 2.800 2.797 0,02                      |             |                          |                          |
| 77.823.640 57.388 0,34                                 |             |                          |                          | 5,000 % fällig am 06.05.2035             |             |                          |                          |
| 2,625 % fällig am                                      |             |                          |                          | MDGH GMTN RSC Ltd.                       |             |                          |                          |
| 10.06.2028                                             |             |                          |                          | 5,500 % fällig am 28.04.2033             |             |                          |                          |
| 144.280.900 107.275 0,63                               |             |                          |                          | 7.000 7.290 0,04                         |             |                          |                          |
| 4,250 % fällig am                                      |             |                          |                          | Summe Vereinigte Arabische Emirate       |             |                          |                          |
| 10.12.2032                                             |             |                          |                          | 22.180 0,13                              |             |                          |                          |
| 19.518.160 15.906 0,09                                 |             |                          |                          | GROSSBRITANNIEN                          |             |                          |                          |
| Summe Südkorea                                         |             |                          |                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL         |             |                          |                          |
| 278.109 1,64                                           |             |                          |                          | Barclays PLC                             |             |                          |                          |
| SPANIEN                                                |             |                          |                          | 2,885 % fällig am 31.01.2027             |             |                          |                          |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                       |             |                          |                          | 4,506 % fällig am 31.01.2033             |             |                          |                          |
| Banco Santander S.A.                                   |             |                          |                          | 6,496 % fällig am 13.09.2027             |             |                          |                          |
| 6,607 % fällig am                                      |             |                          |                          | HSBC Holdings PLC                        |             |                          |                          |
| 07.11.2028                                             |             |                          |                          | 2,848 % fällig am 04.06.2031             |             |                          |                          |
| \$ 12.800 13.657 0,08                                  |             |                          |                          | 3,445 % fällig am 25.09.2030             |             |                          |                          |
| NON-AGENCY-MBS                                         |             |                          |                          | 3,973 % fällig am 22.05.2030             |             |                          |                          |
| Fondo de Titulización de Activos Santander Hipotecario |             |                          |                          | 4,041 % fällig am 13.03.2028             |             |                          |                          |
| 2,386 % fällig am                                      |             |                          |                          | 4,583 % fällig am 19.06.2029             |             |                          |                          |
| 18.01.2049                                             |             |                          |                          | 4,755 % fällig am 09.06.2028             |             |                          |                          |
| € 156 182 0,00                                         |             |                          |                          | 17.000 15.540 0,09                       |             |                          |                          |
| STAATSEMISSIONEN                                       |             |                          |                          | € 9.200 10.931 0,06                      |             |                          |                          |
| Adif Alta Velocidad                                    |             |                          |                          | \$ 21.700 21.137 0,13                    |             |                          |                          |
| 3,125 % fällig am                                      |             |                          |                          | 7.300 7.242 0,04                         |             |                          |                          |
| 31.01.2030                                             |             |                          |                          | 19.600 19.631 0,12                       |             |                          |                          |
| 1.600 1.903 0,01                                       |             |                          |                          | 11.200 11.247 0,07                       |             |                          |                          |



| BESCHREIBUNG                                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Mortimer Mix PLC</b>                                                           |                |                          |                                   | <b>Argent Securities Trust</b>                               |                |                          |                                   | <b>4,704 % fällig am 25.08.2036</b>                                                              | \$ 7.943       | \$ 7.502                 | 0,05                              |
| 5,069 % fällig am 22.09.2067                                                      | £ 18.499       | \$ 25.432                | 0,15                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                                 | \$ 5.241       | \$ 4.710                 | 0,03                              | 4,914 % fällig am 25.04.2036                                                                     | 3.379          | 3.464                    | 0,02                              |
| <b>Newgate Funding PLC</b>                                                        |                |                          |                                   | <b>Asset-Backed Funding Certificates Trust</b>               |                |                          |                                   | <b>Lehman ABS Mortgage Loan Trust</b>                                                            |                |                          |                                   |
| 2,225 % fällig am 01.12.2050                                                      | € 395          | 448                      | 0,00                              | 5,134 % fällig am 25.06.2034                                 | 180            | 181                      | 0,00                              | 4,524 % fällig am 25.06.2037                                                                     | 83             | 55                       | 0,00                              |
| 2,568 % fällig am 01.12.2050                                                      | 1.493          | 1.648                    | 0,01                              | <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>            |                |                          |                                   | <b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>                                                            |                |                          |                                   |
| 2,575 % fällig am 15.12.2050                                                      | 410            | 474                      | 0,00                              | 5,049 % fällig am 25.02.2036                                 | 1.450          | 1.447                    | 0,01                              | 4,734 % fällig am 25.05.2036                                                                     | 3.456          | 1.820                    | 0,01                              |
| 3,225 % fällig am 15.12.2050                                                      | 1.700          | 1.938                    | 0,01                              | 5,434 % fällig am 25.11.2042                                 | 9              | 9                        | 0,00                              | 4,994 % fällig am 25.10.2034                                                                     | 476            | 469                      | 0,00                              |
| 3,475 % fällig am 15.12.2050                                                      | 2.966          | 3.219                    | 0,02                              | 5,439 % fällig am 25.06.2035                                 | 364            | 357                      | 0,00                              | 5,709 % fällig am 25.02.2035                                                                     | 5.045          | 4.964                    | 0,03                              |
| 4,517 % fällig am 01.12.2050                                                      | £ 383          | 518                      | 0,00                              | 5,484 % fällig am 25.08.2037                                 | 1.879          | 1.680                    | 0,01                              | <b>Louisiana Local Government Environmental Facilities &amp; Community Development Authority</b> |                |                          |                                   |
| 4,557 % fällig am 01.12.2050                                                      | 332            | 432                      | 0,00                              | <b>Centex Home Equity Loan Trust</b>                         |                |                          |                                   | 5,048 % fällig am 01.12.2034                                                                     | 6.600          | 6.754                    | 0,04                              |
| 4,561 % fällig am 01.12.2050                                                      | 318            | 430                      | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.07.2032                                 | 12             | 11                       | 0,00                              | <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>                                                       |                |                          |                                   |
| 5,358 % fällig am 15.12.2050                                                      | 2.133          | 2.866                    | 0,02                              | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                   |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.08.2036                                                                     | 15.652         | 5.299                    | 0,03                              |
| 5,608 % fällig am 15.12.2050                                                      | 1.900          | 2.535                    | 0,02                              | 4,494 % fällig am 25.07.2045                                 | 53             | 37                       | 0,00                              | <b>MASTR Specialized Loan Trust</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>Paragon Mortgages PLC</b>                                                      |                |                          |                                   | 4,824 % fällig am 25.06.2037                                 | 1.717          | 1.714                    | 0,01                              | 6,084 % fällig am 25.06.2043                                                                     | 66             | 78                       | 0,00                              |
| 4,845 % fällig am 15.11.2038                                                      | \$ 14          | 14                       | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.01.2037                                 | 326            | 325                      | 0,00                              | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                                                    |                |                          |                                   |
| <b>Polaris PLC</b>                                                                |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 25.05.2036                                 | 1.149          | 570                      | 0,00                              | 4,594 % fällig am 25.09.2037                                                                     | 12             | 2                        | 0,00                              |
| 5,014 % fällig am 23.12.2058                                                      | £ 2.657        | 3.642                    | 0,02                              | 7,264 % fällig am 25.01.2037                                 | 118            | 50                       | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.05.2036                                                                     | 34             | 34                       | 0,00                              |
| <b>Resloc UK PLC</b>                                                              |                |                          |                                   | <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>     |                |                          |                                   | <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>                                                    |                |                          |                                   |
| 4,518 % fällig am 15.12.2043                                                      | 39             | 52                       | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.07.2037                                 | 592            | 552                      | 0,00                              | 4,494 % fällig am 25.05.2037                                                                     | 193            | 174                      | 0,00                              |
| 4,556 % fällig am 15.12.2043                                                      | \$ 98          | 96                       | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.08.2037                                 | 14.298         | 13.114                   | 0,08                              | 4,564 % fällig am 25.01.2037                                                                     | 2.426          | 1.117                    | 0,01                              |
| 4,578 % fällig am 15.12.2043                                                      | £ 1.859        | 2.444                    | 0,02                              | 4,714 % fällig am 25.06.2037                                 | 1.153          | 1.100                    | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.10.2036                                                                     | 2.846          | 1.242                    | 0,01                              |
| <b>RMAC Securities PLC</b>                                                        |                |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.09.2047                                 | 1.878          | 1.757                    | 0,01                              | 4,664 % fällig am 25.10.2036                                                                     | 9.428          | 4.885                    | 0,03                              |
| 2,204 % fällig am 12.06.2044                                                      | € 632          | 731                      | 0,01                              | 4,874 % fällig am 25.09.2037                                 | 306            | 318                      | 0,00                              | 4,684 % fällig am 25.07.2036                                                                     | 402            | 365                      | 0,00                              |
| 4,508 % fällig am 12.06.2044                                                      | £ 253          | 341                      | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.06.2047                                 | 9.204          | 8.881                    | 0,05                              | 4,754 % fällig am 25.09.2036                                                                     | 4.128          | 1.780                    | 0,01                              |
| 4,528 % fällig am 12.06.2044                                                      | 170            | 228                      | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.12.2036                                 | 4.446          | 4.248                    | 0,03                              | 4,934 % fällig am 25.04.2036                                                                     | 3.669          | 3.503                    | 0,02                              |
| <b>Southern Pacific Financing PLC</b>                                             |                |                          |                                   | 4,954 % fällig am 25.09.2046                                 | 3.293          | 3.160                    | 0,02                              | 5,109 % fällig am 25.09.2035                                                                     | 366            | 351                      | 0,00                              |
| 4,618 % fällig am 10.03.2044                                                      | 79             | 108                      | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.05.2047                                 | 6.366          | 4.623                    | 0,03                              | 6,684 % fällig am 25.03.2033                                                                     | 19             | 19                       | 0,00                              |
| <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                                              |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.08.2035                                 | 1.054          | 1.040                    | 0,01                              | 8,234 % fällig am 25.02.2047                                                                     | 1.079          | 893                      | 0,01                              |
| 5,214 % fällig am 25.06.2049                                                      | 22.193         | 30.448                   | 0,18                              | 5,114 % fällig am 25.12.2036                                 | 106            | 86                       | 0,00                              | <b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>                                                     |                |                          |                                   |
| <b>Trinity Square PLC</b>                                                         |                |                          |                                   | 5,154 % fällig am 25.07.2034                                 | 29             | 30                       | 0,00                              | 4,604 % fällig am 25.04.2037                                                                     | 3.264          | 1.694                    | 0,01                              |
| 5,217 % fällig am 15.07.2059                                                      | 8.621          | 11.842                   | 0,07                              | 5,270 % fällig am 25.02.2035                                 | 252            | 247                      | 0,00                              | 4,664 % fällig am 25.04.2037                                                                     | 9.980          | 5.179                    | 0,03                              |
| <b>Twin Bridges PLC</b>                                                           |                |                          |                                   | 5,274 % fällig am 25.10.2047                                 | 1.925          | 1.888                    | 0,01                              | <b>Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust</b>                                             |                |                          |                                   |
| 5,089 % fällig am 12.03.2055                                                      | 8.506          | 11.670                   | 0,07                              | 5,409 % fällig am 25.01.2036                                 | 3.513          | 3.460                    | 0,02                              | 4,534 % fällig am 25.11.2036                                                                     | 2              | 1                        | 0,00                              |
| <b>Uropa Securities PLC</b>                                                       |                |                          |                                   | 5,484 % fällig am 25.11.2034                                 | 2              | 3                        | 0,00                              | <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                                                        |                |                          |                                   |
| 4,649 % fällig am 10.10.2040                                                      | 26             | 35                       | 0,00                              | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b>  |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.02.2037                                                                     | 169            | 33                       | 0,00                              |
| <b>Warwick Finance Residential Mortgages PLC</b>                                  |                |                          |                                   | 4,562 % fällig am 25.01.2032                                 | 9              | 9                        | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.04.2037                                                                     | 280            | 73                       | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am                                                                 |                |                          |                                   | <b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization LLC</b> |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.04.2037                                                                     | 96             | 47                       | 0,00                              |
| 21.12.2049 (b)                                                                    | 1              | 6.624                    | 0,04                              | 4,554 % fällig am 25.11.2036                                 | 29             | 13                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.02.2037                                                                     | 122            | 67                       | 0,00                              |
| 5,189 % fällig am 21.12.2049                                                      | 17.758         | 24.422                   | 0,14                              | <b>CSAB Mortgage-Backed Trust</b>                            |                |                          |                                   | <b>New Century Home Equity Loan Trust</b>                                                        |                |                          |                                   |
| 5,889 % fällig am 21.12.2049                                                      | 7.280          | 10.041                   | 0,06                              | 6,672 % fällig am 25.06.2036                                 | 181            | 46                       | 0,00                              | 3,464 % fällig am 20.06.2031                                                                     | 147            | 137                      | 0,00                              |
| 6,389 % fällig am 21.12.2049                                                      | 3.640          | 4.984                    | 0,03                              | <b>Delta Funding Home Equity Loan Trust</b>                  |                |                          |                                   | <b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b>                                      |                |                          |                                   |
| 6,889 % fällig am 21.12.2049                                                      | 2.080          | 2.835                    | 0,02                              | 5,066 % fällig am 15.08.2030                                 | 5              | 5                        | 0,00                              | 5,064 % fällig am 25.02.2036                                                                     | 3.360          | 3.140                    | 0,02                              |
| 7,389 % fällig am 21.12.2049                                                      | 2.080          | 2.812                    | 0,02                              | <b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>                      |                |                          |                                   | <b>Nomura Resecuritization Trust</b>                                                             |                |                          |                                   |
| <b>Winchester PLC</b>                                                             |                |                          |                                   | 5,534 % fällig am 25.05.2037                                 | 210            | 206                      | 0,00                              | 3,851 % fällig am 26.12.2037                                                                     | 844            | 738                      | 0,01                              |
| 5,188 % fällig am 21.10.2056                                                      | 16.007         | 21.971                   | 0,13                              | <b>EMC Mortgage Loan Trust</b>                               |                |                          |                                   | <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                                                           |                |                          |                                   |
|                                                                                   |                | 406.329                  | 2,40                              | 5,174 % fällig am 25.05.2040                                 | 8              | 8                        | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.01.2037                                                                     | 1.282          | 424                      | 0,00                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                           |                |                          |                                   | <b>Encore Credit Receivables Trust</b>                       |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.05.2036                                                                     | 3.600          | 3.492                    | 0,02                              |
| <b>United Kingdom Gilt</b>                                                        |                |                          |                                   | 5,334 % fällig am 25.01.2036                                 | 4.708          | 4.610                    | 0,03                              | 5,094 % fällig am 25.01.2036                                                                     | 8              | 8                        | 0,00                              |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050                                                      | 46.810         | 23.596                   | 0,14                              | <b>Fieldstone Mortgage Investment Trust</b>                  |                |                          |                                   | <b>Option One Mortgage Loan Trust</b>                                                            |                |                          |                                   |
| 1,250 % fällig am 31.07.2051                                                      | 31.025         | 18.600                   | 0,11                              | 4,679 % fällig am 25.11.2036                                 | 1.863          | 1.163                    | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.03.2037                                                                     | 2.269          | 1.756                    | 0,01                              |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053                                                      | 11.300         | 7.032                    | 0,04                              | <b>First Franklin Mortgage Loan Trust</b>                    |                |                          |                                   | 4,614 % fällig am 25.04.2037                                                                     | 13.378         | 6.532                    | 0,04                              |
| 3,250 % fällig am 31.01.2033                                                      | 13.400         | 17.175                   | 0,10                              | 4,654 % fällig am 25.12.2037                                 | 1.835          | 1.769                    | 0,01                              | 4,654 % fällig am 25.04.2037                                                                     | 3.320          | 2.351                    | 0,01                              |
| 4,375 % fällig am 31.07.2054                                                      | 81.970         | 97.364                   | 0,58                              | <b>Fremont Home Loan Trust</b>                               |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.05.2037                                                                     | 4.239          | 2.552                    | 0,02                              |
| 5,375 % fällig am 31.01.2056                                                      | 17.450         | 24.288                   | 0,14                              | 4,574 % fällig am 25.01.2037                                 | 2.154          | 1.116                    | 0,01                              | 4,714 % fällig am 25.01.2037                                                                     | 634            | 408                      | 0,00                              |
|                                                                                   |                | 188.055                  | 1,11                              | 4,704 % fällig am 25.10.2036                                 | 1.812          | 1.648                    | 0,01                              | 5,114 % fällig am 25.11.2034                                                                     | 41             | 42                       | 0,00                              |
| Summe Großbritannien                                                              |                | 1.289.186                | 7,61                              | 5,499 % fällig am 25.06.2035                                 | 2.932          | 2.890                    | 0,02                              | 5,304 % fällig am 25.05.2035                                                                     | 3.867          | 3.296                    | 0,02                              |
| <b>USA</b>                                                                        |                |                          |                                   | <b>GSAA Home Equity Trust</b>                                |                |                          |                                   | <b>Ownit Mortgage Loan Trust</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                           |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.04.2047                                 | 276            | 120                      | 0,00                              | 4,739 % fällig am 25.05.2037                                                                     | 1.455          | 1.190                    | 0,01                              |
| <b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>                                             |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.06.2036                                 | 2.612          | 666                      | 0,00                              | <b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>                        |                |                          |                                   |
| 4,694 % fällig am 25.09.2036                                                      | \$ 520         | 518                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.03.2037                                 | 267            | 106                      | 0,00                              | 5,169 % fällig am 25.09.2035                                                                     | 121            | 118                      | 0,00                              |
| <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>                                |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.05.2047                                 | 97             | 59                       | 0,00                              | <b>People's Choice Home Loan Securities Trust</b>                                                |                |                          |                                   |
| 4,554 % fällig am 25.10.2036                                                      | 4              | 1                        | 0,00                              | <b>GSAMP Trust</b>                                           |                |                          |                                   | 5,784 % fällig am 25.01.2035                                                                     | 37             | 36                       | 0,00                              |
| 4,694 % fällig am 25.12.2036                                                      | 5.515          | 2.903                    | 0,02                              | 4,574 % fällig am 25.12.2036                                 | 5.403          | 2.883                    | 0,02                              | <b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>                                                        |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                      | 2.069          | 692                      | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.12.2046                                 | 7.334          | 3.895                    | 0,02                              | 5,134 % fällig am 25.08.2032                                                                     | 1              | 1                        | 0,00                              |
| 5,229 % fällig am 25.01.2035                                                      | 596            | 570                      | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.06.2036                                 | 71             | 70                       | 0,00                              | 5,340 % fällig am 25.01.2037                                                                     | 15.587         | 4.799                    | 0,03                              |
| 5,334 % fällig am 25.12.2034                                                      | 806            | 729                      | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.12.2046                                 | 6.426          | 3.176                    | 0,02                              | 5,879 % fällig am 25.06.2037                                                                     | 19.229         | 4.956                    | 0,03                              |
| 5,334 % fällig am 25.08.2035                                                      | 3.222          | 3.181                    | 0,02                              | 4,934 % fällig am 25.05.2046                                 | 329            | 316                      | 0,00                              | 5,893 % fällig am 25.06.2037                                                                     | 9.958          | 2.573                    | 0,02                              |
| <b>Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 5,109 % fällig am 25.11.2035                                 | 1.372          | 1.333                    | 0,01                              | <b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>                                                 |                |                          |                                   |
| 5,184 % fällig am 25.01.2036                                                      | 346            | 341                      | 0,00                              | <b>Home Equity Asset Trust</b>                               |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.12.2036                                                                     | 179            | 177                      | 0,00                              |
| 5,409 % fällig am 25.07.2035                                                      | 800            | 775                      | 0,01                              | 4,994 % fällig am 25.08.2036                                 | 220            | 218                      | 0,00                              | 5,114 % fällig am 25.12.2035                                                                     | 3.071          | 2.747                    | 0,02                              |
| 5,484 % fällig am 25.11.2034                                                      | 333            | 329                      | 0,00                              | 5,354 % fällig am 25.02.2033                                 | 2              | 2                        | 0,00                              | <b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Amortizing Residential Collateral Trust</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>          |                |                          |                                   | 5,139 % fällig am 25.11.2035                                                                     | 485            | 473                      | 0,00                              |
| 5,134 % fällig am 25.10.2031                                                      | 17             | 17                       | 0,00                              | 4,594 % fällig am 25.11.2036                                 | 4.956          | 4.490                    | 0,03                              | <b>Saxon Asset Securities Trust</b>                                                              |                |                          |                                   |
| <b>Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.04.2037                                 | 2.633          | 2.323                    | 0,01                              | 4,634 % fällig am 25.05.2047                                                                     | 6.953          | 6.235                    | 0,04                              |
| 5,374 % fällig am 25.06.2029                                                      | 37             | 37                       | 0,00                              | <b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>                  |                |                          |                                   | 4,744 % fällig am 25.09.2037                                                                     | 1.528          | 1.471                    | 0,01                              |
|                                                                                   |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.02.2036                                 | 1.000          | 987                      | 0,01                              |                                                                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                                   |                |                          |                                   | <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>                   |                |                          |                                   |                                                                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                                   |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.08.2036                                 | 2.493          | 1.872                    | 0,01                              |                                                                                                  |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>         |                |                          |                                   | <b>Doctors Co. An Interinsurance Exchange</b> |                |                          |                                   | <b>3,900 % fällig am 22.07.2032</b>                                                                          | € 34.700       | \$ 41.977                | 0,25                              |
| 4,534 % fällig am 25.12.2036                                  | \$ 5           | \$ 2                     | 0,00                              | 4,500 % fällig am 18.01.2032                  | \$ 3.900       | \$ 3.474                 | 0,02                              | 5,211 % fällig am 03.12.2035                                                                                 | \$ 33.600      | 33.743                   | 0,20                              |
| 4,554 % fällig am 25.12.2036                                  | 78             | 17                       | 0,00                              | <b>Ford Motor Credit Co. LLC</b>              |                |                          |                                   | 5,389 % fällig am 24.04.2034                                                                                 | 45.300         | 46.370                   | 0,27                              |
| 4,694 % fällig am 25.05.2037                                  | 127            | 97                       | 0,00                              | 2,900 % fällig am 16.02.2028                  | 700            | 657                      | 0,00                              |                                                                                                              |                | 1.085.385                | 6,41                              |
| 5,154 % fällig am 25.10.2035                                  | 523            | 453                      | 0,00                              | 3,375 % fällig am 13.11.2025                  | 2.700          | 2.682                    | 0,02                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                                                    |                |                          |                                   |
| 5,259 % fällig am 25.10.2035                                  | 2.174          | 2.089                    | 0,01                              | 3,815 % fällig am 02.11.2027                  | 1.400          | 1.352                    | 0,01                              | <b>Pantheon Senior Debt Secondaries</b>                                                                      |                |                          |                                   |
| <b>SG Mortgage Securities Trust</b>                           |                |                          |                                   | 4,389 % fällig am 08.01.2026                  | 1.000          | 996                      | 0,01                              | 6,317 % fällig am 26.03.2026 (g)                                                                             | 5.300          | 5.300                    | 0,03                              |
| 4,754 % fällig am 25.07.2036                                  | 3.039          | 631                      | 0,00                              | <b>GA Global Funding Trust</b>                |                |                          |                                   | <b>Project Hudson</b>                                                                                        |                |                          |                                   |
| <b>SLM Student Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   | 2,250 % fällig am 06.01.2027                  | 9.400          | 9.079                    | 0,05                              | 7,730 % fällig am 29.05.2026                                                                                 | 7.800          | 7.913                    | 0,05                              |
| 2,525 % fällig am 15.12.2033                                  | € 603          | 670                      | 0,00                              | 5,400 % fällig am 13.01.2030                  | 6.800          | 6.986                    | 0,04                              |                                                                                                              |                | 13.213                   | 0,08                              |
| 2,558 % fällig am 25.10.2039                                  | 113            | 124                      | 0,00                              | <b>GLP Capital LP</b>                         |                |                          |                                   | <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                                          |                |                          |                                   |
| <b>Soundview Home Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   | 5,300 % fällig am 15.01.2029                  | 2.500          | 2.529                    | 0,02                              | <b>American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,604 % fällig am 25.07.2037                                  | \$ 1.501       | 1.326                    | 0,01                              | <b>Goldman Sachs Bank USA</b>                 |                |                          |                                   | 6,270 % fällig am 15.02.2050                                                                                 | 90             | 93                       | 0,00                              |
| 4,604 % fällig am 25.08.2037                                  | 219            | 191                      | 0,00                              | 5,283 % fällig am 18.03.2027                  | 4.500          | 4.523                    | 0,03                              | <b>American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010</b>                                       |                |                          |                                   |
| 4,614 % fällig am 25.07.2037                                  | 126            | 113                      | 0,00                              | <b>Goldman Sachs Group, Inc.</b>              |                |                          |                                   | 7,734 % fällig am 15.02.2033                                                                                 | 100            | 116                      | 0,00                              |
| 4,634 % fällig am 25.06.2037                                  | 5.677          | 3.861                    | 0,02                              | 3,500 % fällig am 23.01.2033                  | € 36.900       | 43.700                   | 0,26                              | 7,834 % fällig am 15.02.2041                                                                                 | 1.700          | 2.020                    | 0,01                              |
| 4,644 % fällig am 25.06.2037                                  | 10.949         | 7.209                    | 0,04                              | 4,692 % fällig am 23.10.2030                  | \$ 13.000      | 13.042                   | 0,08                              | <b>Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021</b>                      |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                                  | 425            | 407                      | 0,00                              | 5,049 % fällig am 23.07.2030                  | 10.000         | 10.168                   | 0,06                              | 3,850 % fällig am 01.06.2050                                                                                 | 1.875          | 1.707                    | 0,01                              |
| 4,839 % fällig am 25.12.2036                                  | 4.542          | 4.521                    | 0,03                              | 5,207 % fällig am 28.01.2031                  | 14.500         | 14.844                   | 0,09                              | <b>Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021</b> |                |                          |                                   |
| 4,934 % fällig am 25.10.2036                                  | 6.833          | 6.550                    | 0,04                              | 5,218 % fällig am 23.04.2031                  | 39.600         | 40.607                   | 0,24                              | 2,346 % fällig am 01.06.2030                                                                                 | 200            | 182                      | 0,00                              |
| 4,934 % fällig am 25.11.2036                                  | 4.424          | 4.189                    | 0,03                              | 5,435 % fällig am 28.01.2031                  | 24.200         | 24.071                   | 0,14                              | <b>Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021</b>                      |                |                          |                                   |
| 5,184 % fällig am 25.03.2036                                  | 572            | 569                      | 0,00                              | 5,536 % fällig am 28.01.2036 (h)              | 16.800         | 17.235                   | 0,10                              | 2,687 % fällig am 01.06.2030                                                                                 | 6.000          | 5.467                    | 0,03                              |
| 5,334 % fällig am 25.10.2037                                  | 4.547          | 3.490                    | 0,02                              | <b>HCA, Inc.</b>                              |                |                          |                                   | 2,787 % fällig am 01.06.2031                                                                                 | 4.400          | 3.940                    | 0,03                              |
| <b>Specialty Underwriting &amp; Residential Finance Trust</b> |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 01.09.2026                  | 2.170          | 2.181                    | 0,01                              | 3,037 % fällig am 01.06.2032                                                                                 | 8.045          | 7.136                    | 0,04                              |
| 5,000 % fällig am 25.12.2036                                  | 166            | 164                      | 0,00                              | <b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>               |                |                          |                                   | <b>Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b>    |                |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>                 |                |                          |                                   | 3,588 % fällig am 23.01.2036                  | € 13.800       | 16.130                   | 0,10                              | 7,618 % fällig am 01.08.2040                                                                                 | 2.800          | 3.296                    | 0,02                              |
| 5,054 % fällig am 25.01.2036                                  | 2.352          | 2.215                    | 0,01                              | 4,603 % fällig am 22.10.2030                  | \$ 16.400      | 16.459                   | 0,10                              | <b>Minnesota Housing Finance Agency Revenue Notes, Series 2024</b>                                           |                |                          |                                   |
| 5,709 % fällig am 25.11.2034                                  | 1.953          | 2.044                    | 0,01                              | 5,336 % fällig am 23.01.2035                  | 6.500          | 6.656                    | 0,04                              | 5,301 % fällig am 01.01.2029                                                                                 | 6.300          | 6.412                    | 0,04                              |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>  |                |                          |                                   | 5,502 % fällig am 24.01.2036                  | 26.700         | 27.512                   | 0,16                              | 5,532 % fällig am 01.01.2034                                                                                 | 1.700          | 1.738                    | 0,01                              |
| 5,939 % fällig am 25.04.2035                                  | 1              | 1                        | 0,00                              | <b>Kraton Corp.</b>                           |                |                          |                                   | <b>Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>Terwin Mortgage Trust</b>                                  |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.07.2027                  | 23.400         | 23.701                   | 0,14                              | 6,655 % fällig am 01.04.2057                                                                                 | 278            | 297                      | 0,00                              |
| 0,066 % fällig am 25.08.2037                                  | 202            | 92                       | 0,00                              | <b>Las Vegas Sands Corp.</b>                  |                |                          |                                   |                                                                                                              |                | 32.404                   | 0,19                              |
| 5,374 % fällig am 25.11.2033                                  | 4              | 4                        | 0,00                              | 5,900 % fällig am 01.06.2027                  | 13.200         | 13.493                   | 0,08                              | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                                                        |                |                          |                                   |
| <b>Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.</b>         |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 15.08.2029                  | 4.300          | 4.421                    | 0,03                              | <b>Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| 5,169 % fällig am 01.04.2041                                  | 11.000         | 11.120                   | 0,07                              | <b>Lehman Brothers Holdings, Inc.</b>         |                |                          |                                   | 5,460 % fällig am 25.09.2035                                                                                 | 39             | 35                       | 0,00                              |
| <b>WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust</b>              |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 25.05.2010 ^                | 8.800          | 6                        | 0,00                              | 5,584 % fällig am 25.03.2035                                                                                 | 470            | 410                      | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.01.2037                                  | 2.295          | 1.985                    | 0,01                              | 5,625 % fällig am 24.01.2013 ^                | 12.700         | 8                        | 0,00                              | <b>American Home Mortgage Assets Trust</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust</b>      |                |                          |                                   | 6,200 % fällig am 26.09.2014 ^                | 9.800          | 6                        | 0,00                              | 4,624 % fällig am 25.05.2046                                                                                 | 202            | 177                      | 0,00                              |
| 4,129 % fällig am 25.10.2036                                  | 45             | 16                       | 0,00                              | 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^                | £ 14.000       | 73                       | 0,00                              | 4,644 % fällig am 25.10.2046                                                                                 | 59             | 30                       | 0,00                              |
| <b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>  |                |                          |                                   | <b>Morgan Stanley</b>                         |                |                          |                                   | 4,814 % fällig am 25.09.2046                                                                                 | 615            | 577                      | 0,00                              |
| 4,779 % fällig am 25.01.2037                                  | 3.699          | 3.681                    | 0,02                              | 3,955 % fällig am 21.03.2035                  | € 12.150       | 14.595                   | 0,09                              | 5,319 % fällig am 25.11.2046                                                                                 | 7.367          | 1.788                    | 0,01                              |
|                                                               |                | 261.037                  | 1,54                              | 4,654 % fällig am 18.10.2030                  | \$ 10.300      | 10.322                   | 0,06                              | <b>American Home Mortgage Investment Trust</b>                                                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                       |                |                          |                                   | 4,889 % fällig am 20.07.2033                  | 7.500          | 7.510                    | 0,04                              | 6,326 % fällig am 25.09.2035                                                                                 | 3.130          | 1.181                    | 0,01                              |
| <b>Athene Global Funding</b>                                  |                |                          |                                   | 5,042 % fällig am 19.07.2030                  | 10.400         | 10.579                   | 0,06                              | <b>Banc of America Funding Trust</b>                                                                         |                |                          |                                   |
| 3,046 % fällig am 23.02.2027                                  | € 28.100       | 33.153                   | 0,20                              | 5,250 % fällig am 21.04.2034                  | 15.000         | 15.264                   | 0,09                              | 4,621 % fällig am 20.10.2046                                                                                 | 96             | 82                       | 0,00                              |
| 3,410 % fällig am 25.02.2030                                  | 13.700         | 16.168                   | 0,10                              | 5,367 % fällig am 13.04.2028                  | 14.200         | 14.285                   | 0,08                              | 4,752 % fällig am 20.02.2047                                                                                 | 477            | 444                      | 0,00                              |
| 5,097 % fällig am 16.07.2026                                  | \$ 19.500      | 19.529                   | 0,12                              | 5,466 % fällig am 18.01.2035                  | 6.500          | 6.652                    | 0,04                              | 5,078 % fällig am 20.01.2047                                                                                 | 79             | 68                       | 0,00                              |
| 5,516 % fällig am 25.03.2027                                  | 21.100         | 21.461                   | 0,13                              | 5,587 % fällig am 18.01.2036                  | 29.900         | 30.705                   | 0,18                              | 5,750 % fällig am 25.11.2035                                                                                 | 5              | 5                        | 0,00                              |
| <b>Aviation Capital Group LLC</b>                             |                |                          |                                   | <b>Morgan Stanley Bank N.A.</b>               |                |                          |                                   | 6,249 % fällig am 20.02.2036                                                                                 | 175            | 167                      | 0,00                              |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025                                  | 23.600         | 23.579                   | 0,14                              | 5,245 % fällig am 12.01.2029                  | 4.200          | 4.210                    | 0,03                              | <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                                                                        |                |                          |                                   |
| <b>Bank of America Corp.</b>                                  |                |                          |                                   | 5,504 % fällig am 26.05.2028                  | 24.900         | 25.436                   | 0,15                              | 7,491 % fällig am 25.09.2033                                                                                 | 4              | 4                        | 0,00                              |
| 1,949 % fällig am 27.10.2026                                  | € 17.600       | 20.635                   | 0,12                              | <b>ONEOK, Inc.</b>                            |                |                          |                                   | <b>BCAP LLC Trust</b>                                                                                        |                |                          |                                   |
| 3,036 % fällig am 22.09.2026                                  | 6.200          | 7.293                    | 0,04                              | 4,750 % fällig am 15.10.2031                  | 17.200         | 17.039                   | 0,10                              | 4,774 % fällig am 25.01.2037                                                                                 | 21             | 19                       | 0,00                              |
| 3,261 % fällig am 28.01.2031                                  | 45.000         | 53.225                   | 0,31                              | <b>Organon &amp; Co.</b>                      |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.05.2047                                                                                 | 139            | 127                      | 0,00                              |
| 5,202 % fällig am 25.04.2029                                  | \$ 27.100      | 27.700                   | 0,16                              | 2,875 % fällig am 30.04.2028                  | € 3.400        | 3.899                    | 0,02                              | 5,179 % fällig am 26.01.2047                                                                                 | 182            | 179                      | 0,00                              |
| 5,288 % fällig am 25.04.2034                                  | 14.100         | 14.388                   | 0,09                              | 4,125 % fällig am 30.04.2028                  | \$ 4.900       | 4.716                    | 0,03                              | 5,250 % fällig am 26.04.2037                                                                                 | 503            | 282                      | 0,00                              |
| 5,365 % fällig am 24.01.2031                                  | 16.900         | 16.853                   | 0,10                              | <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>         |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                                                           |                |                          |                                   |
| 5,468 % fällig am 23.01.2035 (h)                              | 43.500         | 44.706                   | 0,26                              | 2,100 % fällig am 01.08.2027                  | 500            | 474                      | 0,00                              | 4,000 % fällig am 25.05.2034                                                                                 | 36             | 33                       | 0,00                              |
| <b>Bayer U.S. Finance LLC</b>                                 |                |                          |                                   | 3,300 % fällig am 01.12.2027                  | 800            | 774                      | 0,00                              | 4,250 % fällig am 25.05.2047                                                                                 | 81             | 73                       | 0,00                              |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025                                  | 5.700          | 5.685                    | 0,03                              | 3,750 % fällig am 01.07.2028                  | 1.500          | 1.456                    | 0,01                              | 5,032 % fällig am 25.08.2033                                                                                 | 4              | 4                        | 0,00                              |
| <b>Bristol-Myers Squibb Co.</b>                               |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.12.2046                  | 1.600          | 1.147                    | 0,01                              | 5,785 % fällig am 25.02.2034                                                                                 | 6              | 5                        | 0,00                              |
| 4,900 % fällig am 22.02.2029 (h)                              | 8.800          | 9.013                    | 0,05                              | 4,250 % fällig am 15.03.2046                  | 800            | 597                      | 0,00                              | 6,159 % fällig am 25.10.2033                                                                                 | 16             | 15                       | 0,00                              |
| <b>British Airways Pass-Through Trust</b>                     |                |                          |                                   | 4,300 % fällig am 15.03.2045                  | 1.500          | 1.134                    | 0,01                              | 6,375 % fällig am 25.08.2033                                                                                 | 22             | 21                       | 0,00                              |
| 3,300 % fällig am 15.06.2034                                  | 4.718          | 4.393                    | 0,03                              | 4,500 % fällig am 01.07.2040                  | 800            | 667                      | 0,00                              | 6,530 % fällig am 25.02.2036                                                                                 | 41             | 36                       | 0,00                              |
| <b>Broadcom, Inc.</b>                                         |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 15.06.2043                  | 1.000          | 793                      | 0,00                              | 6,896 % fällig am 25.05.2034                                                                                 | 37             | 36                       | 0,00                              |
| 2,450 % fällig am 15.02.2031                                  | 200            | 179                      | 0,00                              | 4,750 % fällig am 15.02.2044                  | 200            | 163                      | 0,00                              | 7,335 % fällig am 25.02.2036                                                                                 | 25             | 22                       | 0,00                              |
| <b>Charter Communications Operating LLC</b>                   |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 01.07.2050                  | 600            | 484                      | 0,00                              |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.03.2042                                  | 5.500          | 3.924                    | 0,02                              | <b>PacificCorp</b>                            |                |                          |                                   |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 15.02.2028                                  | 200            | 196                      | 0,00                              | 5,100 % fällig am 15.02.2029                  | 2.200          | 2.244                    | 0,01                              |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| 3,850 % fällig am 01.04.2061                                  | 5.100          | 3.270                    | 0,02                              | 5,300 % fällig am 15.02.2031                  | 24.800         | 25.557                   | 0,15                              |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035                                  | 8.800          | 9.247                    | 0,05                              | <b>Philip Morris International, Inc.</b>      |                |                          |                                   |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| <b>Citibank N.A.</b>                                          |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 13.02.2029                  | 13.600         | 13.845                   | 0,08                              |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| 4,838 % fällig am 06.08.2029                                  | 28.900         | 29.517                   | 0,17                              | <b>Southern California Edison Co.</b>         |                |                          |                                   |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| <b>Citigroup, Inc.</b>                                        |                |                          |                                   | 5,450 % fällig am 01.03.2035                  | 5.000          | 4.911                    | 0,03                              |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 14.05.2032                                  | € 20.600       | 24.779                   | 0,15                              | <b>T-Mobile USA, Inc.</b>                     |                |                          |                                   |                                                                                                              |                |                          |                                   |
| 4,542 % fällig am 19.09.2030                                  | \$ 14.600      | 14.537                   | 0,09                              | 5,050 % fällig am 15.07.2033                  | 10.900         | 10.978                   | 0,07                              |                                                                                                              |                |                          |                                   |
|                                                               |                |                          |                                   | <b>Wells Fargo &amp; Co.</b>                  |                |                          |                                   |                                                                                                              |                |                          |                                   |
|                                                               |                |                          |                                   | 3,350 % fällig am 02.03.2033                  | 25.000         | 22.838                   | 0,14                              |                                                                                                              |                |                          |                                   |



| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                                               |                |                          |                                   | 5,014 % fällig am 25.04.2035                                       | \$ 147         | \$ 140                   | 0,00                              | <b>HSI Asset Loan Obligation Trust</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,192 % fällig am 25.08.2036                                                  | \$ 1.132       | \$ 518                   | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.03.2035                                       | 890            | 832                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                        | \$ 21          | \$ 19                    | 0,00                              |
| 4,333 % fällig am 25.11.2036                                                  | 387            | 177                      | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.02.2035                                       | 187            | 176                      | 0,00                              | <b>Impac CMB Trust</b>                                              |                |                          |                                   |
| 4,607 % fällig am 25.11.2036                                                  | 2.396          | 1.231                    | 0,01                              | 5,114 % fällig am 25.02.2035                                       | 74             | 69                       | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.03.2035                                        | 5              | 5                        | 0,00                              |
| 4,698 % fällig am 25.03.2036                                                  | 190            | 110                      | 0,00                              | 5,134 % fällig am 25.02.2036                                       | 5              | 2                        | 0,00                              | <b>Impac Secured Assets Trust</b>                                   |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.02.2034                                                  | 62             | 59                       | 0,00                              | 5,138 % fällig am 25.11.2034                                       | 99             | 95                       | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.01.2037                                        | 3.119          | 2.699                    | 0,02                              |
| 4,810 % fällig am 25.08.2036                                                  | 9              | 6                        | 0,00                              | 5,194 % fällig am 25.09.2034                                       | 16             | 15                       | 0,00                              | <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                                  |                |                          |                                   |
| 4,905 % fällig am 25.09.2035                                                  | 1.355          | 778                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                       | 62             | 29                       | 0,00                              | 3,332 % fällig am 25.01.2036                                        | 28             | 25                       | 0,00                              |
| 4,907 % fällig am 25.11.2035                                                  | 428            | 329                      | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.07.2037                                       | 309            | 145                      | 0,00                              | 3,446 % fällig am 25.06.2036                                        | 148            | 129                      | 0,00                              |
| 5,154 % fällig am 25.08.2035                                                  | 6.749          | 6.574                    | 0,04                              | 6,000 % fällig am 25.07.2036                                       | 284            | 138                      | 0,00                              | 3,678 % fällig am 25.10.2035                                        | 91             | 73                       | 0,00                              |
| 5,207 % fällig am 25.01.2036                                                  | 795            | 753                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.05.2037                                       | 1.041          | 451                      | 0,00                              | 3,736 % fällig am 25.08.2035                                        | 74             | 54                       | 0,00                              |
| 5,467 % fällig am 25.05.2035                                                  | 24             | 23                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.12.2037                                       | 656            | 261                      | 0,00                              | 3,803 % fällig am 25.03.2036                                        | 463            | 332                      | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>                                    |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.11.2047                                       | 506            | 241                      | 0,00                              | 3,838 % fällig am 25.03.2036                                        | 1.572          | 1.083                    | 0,01                              |
| 4,594 % fällig am 25.12.2046                                                  | 305            | 273                      | 0,00                              | 6,662 % fällig am 20.02.2036                                       | 25             | 22                       | 0,00                              | 4,588 % fällig am 25.12.2034                                        | 39             | 37                       | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>                           |                |                          |                                   | <b>Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust</b>              |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.02.2037                                        | 1.341          | 1.232                    | 0,01                              |
| 4,120 % fällig am 26.12.2046                                                  | 1.203          | 957                      | 0,01                              | 4,794 % fällig am 25.03.2035                                       | 379            | 367                      | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.06.2046                                        | 785            | 686                      | 0,00                              |
| <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                                           |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.03.2035                                       | 25             | 28                       | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.06.2037                                        | 94             | 88                       | 0,00                              |
| 4,669 % fällig am 25.03.2037                                                  | 417            | 385                      | 0,00                              | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b>        |                |                          |                                   | <b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,939 % fällig am 25.07.2037                                                  | 32             | 26                       | 0,00                              | 5,063 % fällig am 25.03.2032                                       | 29             | 28                       | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.10.2036                                        | 2.296          | 2.079                    | 0,01                              |
| 5,078 % fällig am 25.03.2037                                                  | 39             | 38                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.04.2033                                       | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,939 % fällig am 27.06.2037                                        | 119            | 72                       | 0,00                              |
| 6,550 % fällig am 25.02.2037                                                  | 63             | 63                       | 0,00                              | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Certificates</b>                 |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.11.2036                                        | 12             | 5                        | 0,00                              |
| <b>Citicorp Mortgage Securities Trust</b>                                     |                |                          |                                   | 3,850 % fällig am 25.09.2057                                       | 7.268          | 7.051                    | 0,04                              | 5,593 % fällig am 25.12.2035                                        | 554            | 385                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037                                                  | 50             | 43                       | 0,00                              | 4,905 % fällig am 25.06.2050                                       | 3.854          | 3.452                    | 0,02                              | <b>JPMorgan Mortgage Trust</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b>        |                |                          |                                   | 5,198 % fällig am 25.08.2034                                        | 45             | 44                       | 0,00                              |
| 4,719 % fällig am 25.08.2036                                                  | 8.935          | 3.646                    | 0,02                              | 6,079 % fällig am 25.04.2037                                       | 63             | 18                       | 0,00                              | 5,308 % fällig am 25.02.2036                                        | 302            | 211                      | 0,00                              |
| 4,978 % fällig am 25.08.2035                                                  | 166            | 153                      | 0,00                              | <b>DBGS Mortgage Trust</b>                                         |                |                          |                                   | 5,537 % fällig am 25.02.2036                                        | 100            | 66                       | 0,00                              |
| 5,988 % fällig am 25.08.2035                                                  | 42             | 40                       | 0,00                              | 5,204 % fällig am 15.06.2033                                       | 1.120          | 1.074                    | 0,01                              | 5,794 % fällig am 25.06.2036                                        | 165            | 114                      | 0,00                              |
| 6,080 % fällig am 25.09.2035                                                  | 6              | 6                        | 0,00                              | <b>Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust</b>               |                |                          |                                   | 5,823 % fällig am 25.07.2035                                        | 26             | 25                       | 0,00                              |
| 6,180 % fällig am 25.09.2035                                                  | 60             | 59                       | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.08.2036                                       | 1.346          | 1.224                    | 0,01                              | 5,952 % fällig am 25.11.2033                                        | 16             | 15                       | 0,00                              |
| 6,490 % fällig am 25.05.2035                                                  | 4              | 4                        | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.03.2037                                       | 1.480          | 1.383                    | 0,01                              | 6,373 % fällig am 25.07.2035                                        | 48             | 47                       | 0,00                              |
| 7,230 % fällig am 25.10.2035                                                  | 6              | 6                        | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.09.2047                                       | 2.269          | 1.948                    | 0,01                              | 6,759 % fällig am 25.12.2034                                        | 130            | 127                      | 0,00                              |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 4,814 % fällig am 25.08.2047                                       | 3.160          | 2.711                    | 0,02                              | <b>Lehman XS Trust</b>                                              |                |                          |                                   |
| 4,841 % fällig am 25.09.2035                                                  | 386            | 347                      | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.08.2037                                       | 2.293          | 1.860                    | 0,01                              | 4,794 % fällig am 25.12.2036                                        | 1.894          | 1.839                    | 0,01                              |
| <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust</b>               |                |                          |                                   | <b>Luminent Mortgage Trust</b>                                      |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.02.2037                                                  | 1.372          | 1.131                    | 0,01                              | 4,534 % fällig am 25.10.2036                                       | 5              | 4                        | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.12.2036                                        | 129            | 125                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037                                                  | 252            | 227                      | 0,00                              | <b>Downey Savings &amp; Loan Association Mortgage Loan Trust</b>   |                |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.10.2046                                        | 296            | 271                      | 0,00                              |
| <b>Commercial Mortgage Trust</b>                                              |                |                          |                                   | 4,622 % fällig am 19.10.2036                                       | 1.062          | 958                      | 0,01                              | <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| 3,545 % fällig am 10.02.2036                                                  | 28.500         | 28.009                   | 0,17                              | 5,272 % fällig am 19.09.2044                                       | 25             | 23                       | 0,00                              | 6,043 % fällig am 21.11.2034                                        | 59             | 57                       | 0,00                              |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   | <b>First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust</b>         |                |                          |                                   | <b>MASTR Alternative Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| 4,612 % fällig am 20.02.2047                                                  | 4.156          | 3.338                    | 0,02                              | 5,103 % fällig am 25.04.2035                                       | 47             | 47                       | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.03.2036                                        | 675            | 63                       | 0,00                              |
| 4,627 % fällig am 20.12.2046                                                  | 2.015          | 1.762                    | 0,01                              | 6,250 % fällig am 25.11.2036                                       | 155            | 40                       | 0,00                              | <b>MASTR Asset Securitization Trust</b>                             |                |                          |                                   |
| 4,674 % fällig am 25.06.2036                                                  | 745            | 699                      | 0,01                              | 6,250 % fällig am 25.08.2037                                       | 159            | 55                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.06.2036                                        | 139            | 76                       | 0,00                              |
| 4,712 % fällig am 20.09.2046                                                  | 1.171          | 1.028                    | 0,01                              | <b>First Horizon Mortgage Pass-Through Trust</b>                   |                |                          |                                   | <b>Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust</b> |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.02.2047                                                  | 106            | 104                      | 0,00                              | 6,431 % fällig am 25.08.2035                                       | 48             | 35                       | 0,00                              | 4,866 % fällig am 15.12.2030                                        | 21             | 20                       | 0,00                              |
| 4,774 % fällig am 25.05.2047                                                  | 2.693          | 2.418                    | 0,02                              | <b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>                           |                |                          |                                   | 5,126 % fällig am 15.11.2031                                        | 22             | 22                       | 0,00                              |
| 4,784 % fällig am 25.05.2037                                                  | 525            | 162                      | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.01.2037                                       | 529            | 484                      | 0,00                              | 5,137 % fällig am 20.10.2029                                        | 9              | 8                        | 0,00                              |
| 4,834 % fällig am 25.05.2036                                                  | 58             | 50                       | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.04.2036                                       | 237            | 211                      | 0,00                              | <b>Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,852 % fällig am 20.03.2046                                                  | 1.347          | 1.243                    | 0,01                              | 4,874 % fällig am 25.06.2045                                       | 25             | 23                       | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.01.2037                                        | 8.279          | 2.497                    | 0,02                              |
| 4,852 % fällig am 20.07.2046                                                  | 194            | 163                      | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.04.2036                                       | 191            | 168                      | 0,00                              | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                       |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.05.2035                                                  | 23             | 22                       | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.11.2045                                       | 60             | 57                       | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.06.2028                                        | 6              | 5                        | 0,00                              |
| 4,854 % fällig am 25.07.2046                                                  | 43             | 39                       | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.09.2046                                       | 1.019          | 812                      | 0,01                              | 5,415 % fällig am 25.12.2034                                        | 86             | 82                       | 0,00                              |
| 4,892 % fällig am 20.05.2046                                                  | 2.111          | 1.880                    | 0,01                              | 5,114 % fällig am 25.10.2046                                       | 1.280          | 990                      | 0,01                              | 6,247 % fällig am 25.02.2033                                        | 43             | 40                       | 0,00                              |
| 4,894 % fällig am 25.11.2036                                                  | 4.760          | 4.115                    | 0,03                              | <b>GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 6,617 % fällig am 25.06.2037                                        | 9              | 9                        | 0,00                              |
| 4,897 % fällig am 25.10.2035                                                  | 8              | 6                        | 0,00                              | 7,182 % fällig am 25.10.2033                                       | 5              | 5                        | 0,00                              | <b>Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust</b>               |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.02.2037                                                  | 691            | 584                      | 0,00                              | <b>GS Mortgage Securities Corp. Trust</b>                          |                |                          |                                   | 4,365 % fällig am 25.04.2037                                        | 553            | 486                      | 0,00                              |
| 5,072 % fällig am 20.12.2035                                                  | 1.314          | 1.242                    | 0,01                              | 5,509 % fällig am 15.07.2031                                       | 5.000          | 3.902                    | 0,02                              | <b>Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust</b>           |                |                          |                                   |
| 5,074 % fällig am 25.11.2035                                                  | 9              | 8                        | 0,00                              | 7,500 % fällig am 25.10.2036                                       | 51             | 6                        | 0,00                              | 3,732 % fällig am 15.05.2048                                        | 1.369          | 1.365                    | 0,01                              |
| 5,076 % fällig am 20.11.2035                                                  | 283            | 267                      | 0,00                              | <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   | <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                           |                |                          |                                   |
| 5,096 % fällig am 20.11.2035                                                  | 23             | 23                       | 0,00                              | 4,664 % fällig am 25.05.2037                                       | 9.078          | 4.301                    | 0,03                              | 3,368 % fällig am 25.11.2037                                        | 447            | 313                      | 0,00                              |
| 5,114 % fällig am 25.10.2046                                                  | 593            | 439                      | 0,00                              | 4,729 % fällig am 25.01.2036                                       | 28             | 26                       | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.04.2035                                        | 113            | 112                      | 0,00                              |
| 5,184 % fällig am 25.07.2036                                                  | 257            | 107                      | 0,00                              | 4,857 % fällig am 25.06.2034                                       | 15             | 14                       | 0,00                              | 5,347 % fällig am 25.11.2035                                        | 22             | 17                       | 0,00                              |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035                                                  | 137            | 102                      | 0,00                              | 4,985 % fällig am 25.11.2035                                       | 10             | 10                       | 0,00                              | <b>MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035                                                  | 700            | 498                      | 0,00                              | 5,293 % fällig am 25.09.2035                                       | 27             | 26                       | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.06.2047                                        | 3.393          | 2.972                    | 0,02                              |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035                                                  | 1.273          | 811                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am 25.01.2037                                       | 45             | 87                       | 0,00                              | <b>New Century Alternative Mortgage Loan Trust</b>                  |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037                                                  | 175            | 91                       | 0,00                              | 5,880 % fällig am 25.04.2032                                       | 65             | 63                       | 0,00                              | 6,173 % fällig am 25.07.2036                                        | 4.689          | 923                      | 0,01                              |
| 5,899 % fällig am 25.11.2035                                                  | 207            | 185                      | 0,00                              | 5,880 % fällig am 25.03.2033                                       | 12             | 12                       | 0,00                              | <b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,974 % fällig am 25.11.2035                                                  | 219            | 197                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.03.2032                                       | 0              | 0                        | 0,00                              | 3,500 % fällig am 25.12.2057                                        | 1.571          | 1.523                    | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036                                                  | 1.775          | 799                      | 0,01                              | <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   | <b>Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust</b>         |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037                                                  | 177            | 69                       | 0,00                              | 4,812 % fällig am 19.09.2037                                       | 406            | 349                      | 0,00                              | 4,413 % fällig am 25.10.2035                                        | 19             | 17                       | 0,00                              |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036                                                  | 109            | 80                       | 0,00                              | 4,824 % fällig am 19.07.2035                                       | 42             | 31                       | 0,00                              | <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                              |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037                                                  | 439            | 202                      | 0,00                              | 4,832 % fällig am 19.09.2046                                       | 468            | 410                      | 0,00                              | 0,445 % fällig am 25.09.2046                                        | 1.250          | 442                      | 0,00                              |
| 6,439 % fällig am 25.11.2035                                                  | 160            | 148                      | 0,00                              | 4,842 % fällig am 19.12.2036                                       | 7.935          | 6.229                    | 0,04                              | <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>                       |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032                                                  | 3              | 3                        | 0,00                              | 4,912 % fällig am 19.03.2036                                       | 96             | 88                       | 0,00                              | 4,108 % fällig am 25.08.2035                                        | 38             | 13                       | 0,00                              |
| <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>                      |                |                          |                                   | 4,932 % fällig am 19.01.2036                                       | 289            | 188                      | 0,00                              | 4,584 % fällig am 25.02.2047                                        | 396            | 121                      | 0,00                              |
| 3,655 % fällig am 25.04.2035                                                  | 115            | 91                       | 0,00                              | 5,132 % fällig am 19.01.2035                                       | 73             | 70                       | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.06.2037                                        | 823            | 767                      | 0,01                              |
| 3,991 % fällig am 25.09.2033                                                  | 8              | 7                        | 0,00                              | 5,249 % fällig am 19.12.2036                                       | 241            | 216                      | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.03.2047                                        | 1.345          | 1.247                    | 0,01                              |
| 4,300 % fällig am 20.09.2036                                                  | 42             | 37                       | 0,00                              | 5,514 % fällig am 19.08.2036                                       | 17             | 17                       | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.06.2046                                        | 4.580          | 992                      | 0,01                              |
| 4,366 % fällig am 19.01.2034                                                  | 31             | 29                       | 0,00                              | 5,932 % fällig am 19.10.2035                                       | 186            | 132                      | 0,00                              |                                                                     |                |                          |                                   |
| 4,623 % fällig am 20.04.2036                                                  | 757            | 686                      | 0,00                              | 6,399 % fällig am 19.10.2035                                       | 352            | 166                      | 0,00                              |                                                                     |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.05.2035                                                  | 308            | 270                      | 0,00                              |                                                                    |                |                          |                                   |                                                                     |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,854 % fällig am 25.04.2046                                 | \$ 3.480       | \$ 885                   | 0,01                              | 4,974 % fällig am 25.12.2045                       | \$ 10          | \$ 10                    | 0,00                              | 4,918 % fällig am 15.06.2041                 | \$ 1.838       | \$ 1.825                 | 0,01                              |
| 4,934 % fällig am 25.08.2037                                 | 349            | 334                      | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.07.2045                       | 194            | 191                      | 0,00                              | 5,000 % fällig am 15.08.2035 -<br>01.12.2039 | 312            | 319                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                                 | 302            | 248                      | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.10.2045                       | 49             | 50                       | 0,00                              | 5,018 % fällig am 15.12.2037                 | 46             | 46                       | 0,00                              |
| 6,104 % fällig am 25.11.2037                                 | 1.475          | 1.238                    | 0,01                              | 5,054 % fällig am 25.01.2045                       | 92             | 92                       | 0,00                              | 5,245 % fällig am 25.11.2054                 | 11.703         | 11.679                   | 0,07                              |
| <b>Residential Asset Securitization Trust</b>                |                |                          |                                   | 5,074 % fällig am 25.01.2045                       | 33             | 33                       | 0,00                              | 5,250 % fällig am 15.12.2050                 | 8.360          | 8.354                    | 0,05                              |
| 4,834 % fällig am 25.01.2046                                 | 11             | 3                        | 0,00                              | 5,174 % fällig am 25.11.2034                       | 116            | 112                      | 0,00                              | 5,255 % fällig am 25.03.2055                 | 19.983         | 19.827                   | 0,12                              |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036                                 | 1.683          | 1.151                    | 0,01                              | 5,254 % fällig am 25.11.2045                       | 223            | 210                      | 0,00                              | 5,404 % fällig am 25.07.2055                 | 21.700         | 21.707                   | 0,13                              |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037                                 | 1.095          | 491                      | 0,00                              | 5,254 % fällig am 25.12.2045                       | 2.533          | 2.322                    | 0,01                              | 5,500 % fällig am 01.06.2037 -<br>01.10.2039 | 40             | 41                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037                                 | 774            | 285                      | 0,00                              | 5,279 % fällig am 25.10.2046                       | 1.925          | 1.658                    | 0,01                              | 5,599 % fällig am 25.10.2044 -<br>25.02.2045 | 714            | 657                      | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036                                 | 1.097          | 308                      | 0,00                              | 5,379 % fällig am 25.06.2046                       | 499            | 466                      | 0,00                              | 5,705 % fällig am 25.03.2055                 | 7.463          | 7.498                    | 0,04                              |
| <b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>   |                |                          |                                   | 5,399 % fällig am 25.02.2046                       | 1.254          | 1.146                    | 0,01                              | 5,799 % fällig am 25.07.2044                 | 16             | 15                       | 0,00                              |
| 5,871 % fällig am 25.09.2035                                 | 208            | 133                      | 0,00                              | 5,399 % fällig am 25.08.2046                       | 57             | 52                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 15.04.2036                 | 889            | 941                      | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032                                 | 4              | 5                        | 0,00                              | 5,599 % fällig am 25.11.2042                       | 18             | 17                       | 0,00                              | 6,901 % fällig am 01.09.2037                 | 66             | 69                       | 0,00                              |
| <b>Sequoia Mortgage Trust</b>                                |                |                          |                                   | 5,649 % fällig am 25.01.2047                       | 289            | 266                      | 0,00                              | 7,000 % fällig am 01.10.2037                 | 5              | 5                        | 0,00                              |
| 4,504 % fällig am 20.07.2037                                 | 534            | 423                      | 0,00                              | 5,776 % fällig am 25.03.2033                       | 6              | 6                        | 0,00                              | 7,093 % fällig am 01.10.2033                 | 13             | 14                       | 0,00                              |
| 4,731 % fällig am 20.01.2047                                 | 204            | 145                      | 0,00                              | 5,782 % fällig am 25.06.2033                       | 25             | 25                       | 0,00                              | 7,222 % fällig am 01.10.2034                 | 14             | 15                       | 0,00                              |
| 5,132 % fällig am 19.10.2026                                 | 14             | 13                       | 0,00                              | 5,799 % fällig am 25.08.2042                       | 0              | 0                        | 0,00                              | 7,355 % fällig am 01.09.2035                 | 4              | 5                        | 0,00                              |
| 5,132 % fällig am 20.07.2033                                 | 72             | 72                       | 0,00                              | 5,899 % fällig am 25.10.2046                       | 8              | 7                        | 0,00                              | 7,481 % fällig am 01.08.2035                 | 6              | 6                        | 0,00                              |
| 5,192 % fällig am 20.10.2027                                 | 1              | 1                        | 0,00                              | 5,902 % fällig am 25.08.2034                       | 47             | 46                       | 0,00                              | <b>Ginnie Mae</b>                            |                |                          |                                   |
| 7,373 % fällig am 20.04.2035                                 | 16             | 17                       | 0,00                              | 6,205 % fällig am 25.03.2034                       | 3              | 3                        | 0,00                              | 3,000 % fällig am 20.07.2046 -<br>20.04.2052 | 296.697        | 262.774                  | 1,55                              |
| <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>        |                |                          |                                   | 6,526 % fällig am 25.09.2033                       | 4              | 4                        | 0,00                              | 3,500 % fällig am 20.10.2052 -<br>20.10.2054 | 8.568          | 7.813                    | 0,05                              |
| 4,519 % fällig am 25.11.2035                                 | 28             | 26                       | 0,00                              | 6,633 % fällig am 25.09.2033                       | 6              | 6                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 15.04.2039 -<br>15.06.2039 | 20             | 19                       | 0,00                              |
| 4,728 % fällig am 25.08.2035                                 | 74             | 64                       | 0,00                              | <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through</b>     |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 20.07.2025 -<br>20.09.2026 | 1              | 1                        | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.10.2035                                 | 293            | 279                      | 0,00                              | <b>Certificates Trust</b>                          |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 20.11.2026 -<br>20.12.2026 | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 4,874 % fällig am 25.05.2037                                 | 7              | 7                        | 0,00                              | 4,884 % fällig am 25.04.2035                       | 102            | 86                       | 0,00                              | 4,875 % fällig am 20.04.2027 -<br>20.05.2030 | 4              | 4                        | 0,00                              |
| 4,916 % fällig am 25.12.2035                                 | 286            | 194                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.07.2036                       | 57             | 41                       | 0,00                              | 5,000 % fällig am 20.04.2030 -<br>20.04.2038 | 12             | 12                       | 0,00                              |
| 4,972 % fällig am 25.07.2035                                 | 604            | 531                      | 0,00                              | 5,339 % fällig am 25.07.2046                       | 401            | 246                      | 0,00                              | 5,196 % fällig am 20.01.2066                 | 835            | 837                      | 0,01                              |
| 5,288 % fällig am 25.09.2034                                 | 2              | 2                        | 0,00                              | <b>Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through</b> |                |                          |                                   | 5,276 % fällig am 20.08.2066                 | 1.872          | 1.878                    | 0,01                              |
| 5,409 % fällig am 25.09.2034                                 | 145            | 140                      | 0,00                              | <b>Certificates Trust</b>                          |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 20.08.2035 -<br>15.02.2039 | 121            | 123                      | 0,00                              |
| 6,174 % fällig am 25.04.2034                                 | 6              | 6                        | 0,00                              | 4,699 % fällig am 25.06.2033                       | 3              | 2                        | 0,00                              | 5,625 % fällig am 20.01.2030                 | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 6,525 % fällig am 25.02.2034                                 | 29             | 28                       | 0,00                              | <b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>          |                |                          |                                   | <b>Ginnie Mae, TBA</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>           |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.07.2037                       | 341            | 299                      | 0,00                              | 2,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 151.300        | 128.568                  | 0,76                              |
| 3,530 % fällig am 25.05.2047                                 | 2.109          | 1.712                    | 0,01                              | 6,500 % fällig am 28.12.2037                       | 180            | 165                      | 0,00                              | 3,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 263.300        | 232.891                  | 1,38                              |
| 4,554 % fällig am 25.08.2036                                 | 1.311          | 1.156                    | 0,01                              |                                                    |                | 192.932                  | 1,14                              | 3,500 % fällig am 01.07.2055                 | 638.450        | 580.522                  | 3,43                              |
| 4,754 % fällig am 25.01.2037                                 | 914            | 818                      | 0,01                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                       |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 395.500        | 405.421                  | 2,39                              |
| 4,794 % fällig am 25.01.2037                                 | 1.634          | 1.452                    | 0,01                              | <b>Fannie Mae</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Small Business Administration</b>         |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.09.2047                                 | 1.297          | 1.201                    | 0,01                              | 3,000 % fällig am 01.03.2060                       | 6.362          | 5.487                    | 0,03                              | 4,760 % fällig am 01.09.2025                 | 2              | 2                        | 0,00                              |
| 4,814 % fällig am 25.06.2036                                 | 30             | 29                       | 0,00                              | 3,500 % fällig am 01.01.2059                       | 19.241         | 17.219                   | 0,10                              | 5,090 % fällig am 01.10.2025                 | 1              | 1                        | 0,00                              |
| 4,834 % fällig am 25.10.2036                                 | 2.017          | 1.807                    | 0,01                              | 4,496 % fällig am 25.12.2036                       | 129            | 127                      | 0,00                              | 5,490 % fällig am 01.05.2028                 | 6              | 7                        | 0,00                              |
| 4,854 % fällig am 25.05.2036                                 | 405            | 283                      | 0,00                              | 4,556 % fällig am 25.03.2034                       | 15             | 15                       | 0,00                              | 5,600 % fällig am 01.09.2028                 | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 4,854 % fällig am 25.09.2047                                 | 1.655          | 1.461                    | 0,01                              | 4,586 % fällig am 25.08.2034                       | 4              | 4                        | 0,00                              | 5,680 % fällig am 01.06.2028                 | 2              | 2                        | 0,00                              |
| 4,874 % fällig am 25.05.2036                                 | 1.915          | 1.570                    | 0,01                              | 4,770 % fällig am 25.09.2042 -<br>25.03.2044       | 29             | 29                       | 0,00                              | 6,220 % fällig am 01.12.2028                 | 20             | 21                       | 0,00                              |
| 4,874 % fällig am 25.05.2046                                 | 2.428          | 852                      | 0,01                              | 4,820 % fällig am 25.06.2029 -<br>25.06.2036       | 147            | 146                      | 0,00                              | <b>Tennessee Valley Authority</b>            |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.09.2047                                 | 19             | 17                       | 0,00                              | 5,255 % fällig am 25.11.2053 -<br>25.01.2055       | 12.417         | 12.434                   | 0,07                              | 4,875 % fällig am 15.05.2035                 | 14.000         | 14.325                   | 0,08                              |
| 4,932 % fällig am 19.07.2035                                 | 11             | 11                       | 0,00                              | 5,402 % fällig am 25.07.2055                       | 16.585         | 16.591                   | 0,10                              | 5,880 % fällig am 01.04.2036                 | 500            | 553                      | 0,00                              |
| 4,954 % fällig am 25.05.2046                                 | 28             | 17                       | 0,00                              | 5,455 % fällig am 25.03.2055                       | 23.494         | 23.497                   | 0,14                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>      |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.02.2036                                 | 233            | 195                      | 0,00                              | 5,696 % fällig am 01.06.2043                       | 2              | 2                        | 0,00                              | 2,500 % fällig am 01.05.2030 -<br>01.01.2052 | 49.082         | 41.069                   | 0,24                              |
| 5,012 % fällig am 19.07.2034                                 | 12             | 11                       | 0,00                              | 5,697 % fällig am 01.11.2042 -<br>01.10.2044       | 34             | 34                       | 0,00                              | 3,000 % fällig am 01.01.2027 -<br>01.06.2051 | 23.508         | 20.409                   | 0,12                              |
| 5,092 % fällig am 19.09.2032                                 | 8              | 8                        | 0,00                              | 5,705 % fällig am 25.02.2055                       | 3.157          | 3.173                    | 0,02                              | 3,500 % fällig am 01.11.2034 -<br>01.07.2050 | 26.794         | 24.744                   | 0,15                              |
| 5,132 % fällig am 19.03.2034                                 | 3              | 3                        | 0,00                              | 5,805 % fällig am 25.12.2054                       | 53.577         | 54.013                   | 0,32                              | 4,000 % fällig am 01.01.2026 -<br>01.08.2053 | 13.647         | 12.890                   | 0,08                              |
| 5,799 % fällig am 25.12.2035                                 | 56             | 47                       | 0,00                              | 5,897 % fällig am 01.09.2040                       | 5              | 5                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 01.09.2025 -<br>01.09.2053 | 46.676         | 44.798                   | 0,26                              |
| 5,899 % fällig am 25.08.2047                                 | 984            | 831                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.04.2043 -<br>25.07.2044       | 474            | 489                      | 0,00                              | 5,500 % fällig am 01.01.2035 -<br>01.01.2055 | 207.979        | 208.264                  | 1,23                              |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b> |                |                          |                                   | 6,009 % fällig am 01.12.2034                       | 20             | 20                       | 0,00                              | 6,000 % fällig am 01.12.2053 -<br>01.09.2054 | 262.258        | 267.005                  | 1,58                              |
| 4,714 % fällig am 25.01.2036                                 | 61             | 51                       | 0,00                              | 6,123 % fällig am 01.06.2035                       | 1              | 1                        | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.06.2036 -<br>01.02.2054 | 247.858        | 256.262                  | 1,51                              |
| 4,724 % fällig am 25.10.2036                                 | 443            | 371                      | 0,00                              | 6,170 % fällig am 01.04.2033                       | 32             | 32                       | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b> |                |                          |                                   |
| <b>TBW Mortgage-Backed Trust</b>                             |                |                          |                                   | 6,269 % fällig am 01.04.2033                       | 19             | 20                       | 0,00                              | 2,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 112.050        | 92.938                   | 0,55                              |
| 6,130 % fällig am 25.01.2037                                 | 25             | 6                        | 0,00                              | 6,325 % fällig am 01.01.2033                       | 11             | 11                       | 0,00                              | 3,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 279.200        | 241.580                  | 1,43                              |
| <b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>                   |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.11.2036                       | 69             | 71                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 4,400 % fällig am 25.09.2037                                 | 7              | 7                        | 0,00                              | 6,633 % fällig am 01.12.2030                       | 1              | 1                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 5,684 % fällig am 25.06.2037                                 | 413            | 384                      | 0,00                              | 6,734 % fällig am 01.10.2034                       | 12             | 12                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 5,949 % fällig am 25.06.2037                                 | 1.194          | 1.016                    | 0,01                              | 6,782 % fällig am 25.05.2035                       | 0              | 0                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 5,999 % fällig am 25.06.2037                                 | 972            | 830                      | 0,01                              | 7,000 % fällig am 25.07.2042                       | 57             | 60                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 5,999 % fällig am 25.06.2047                                 | 512            | 473                      | 0,00                              | 7,037 % fällig am 01.11.2034                       | 167            | 174                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 6,049 % fällig am 25.03.2037                                 | 470            | 331                      | 0,00                              | 7,400 % fällig am 01.08.2033                       | 15             | 16                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| <b>Towd Point Mortgage Trust</b>                             |                |                          |                                   | 7,420 % fällig am 01.08.2035                       | 63             | 65                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 25.05.2058                                 | 5.822          | 5.716                    | 0,03                              | <b>Freddie Mac</b>                                 |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |
| <b>Verus Securitization Trust</b>                            |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.11.2026 -<br>01.04.2045       | 265            | 238                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 1,829 % fällig am 25.10.2066                                 | 5.294          | 4.766                    | 0,03                              | 3,500 % fällig am 01.08.2026 -<br>01.04.2049       | 4.323          | 3.971                    | 0,02                              |                                              |                |                          |                                   |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>         |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.09.2041                       | 3              | 3                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 3,413 % fällig am 25.05.2037                                 | 764            | 620                      | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.08.2031                       | 0              | 0                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 3,876 % fällig am 25.05.2037                                 | 1.047          | 907                      | 0,01                              | 4,700 % fällig am 25.09.2031                       | 20             | 20                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 3,976 % fällig am 25.03.2036                                 | 865            | 765                      | 0,01                              | 4,868 % fällig am 15.12.2031                       | 0              | 0                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |
| 4,068 % fällig am 25.12.2046                                 | 16             | 14                       | 0,00                              | 4,898 % fällig am 15.10.2040                       | 1.224          | 1.211                    | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   |
| 4,182 % fällig am 27.02.2034                                 | 41             | 40                       | 0,00                              |                                                    |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |
| 4,351 % fällig am 25.12.2036                                 | 384            | 352                      | 0,00                              |                                                    |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |
| 4,434 % fällig am 25.09.2036                                 | 198            | 169                      | 0,00                              |                                                    |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |
| 4,585 % fällig am 25.03.2036                                 | 42             | 38                       | 0,00                              |                                                    |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |
| 4,688 % fällig am 25.12.2035                                 | 175            | 161                      | 0,00                              |                                                    |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |
| 4,823 % fällig am 25.09.2036                                 | 2.222          | 1.945                    | 0,01                              |                                                    |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.04.2045                                 | 11             | 11                       | 0,00                              |                                                    |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                     | PARI-<br>(000S) | MARKT-<br>WERT -<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                         | PARI-<br>(000S) | MARKT-<br>WERT -<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                             | AKTIEN       | MARKT-<br>WERT -<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|-----------------|----------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|-----------------|----------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|----------------------------|-----------------------------------|
| 4,000 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055        | \$ 115.400      | \$ 107.298                 | 0,63                              | CVS Corp.                            |                 |                            |                                   | INVESTMENTFONDS                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055                     | 6.410           | 6.129                      | 0,04                              | 4,920 % fällig am 14.07.2025         | \$ 12.700       | \$ 12.676                  | 0,08                              | ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN                                                        |              |                            |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055        | 1.737.000       | 1.701.481                  | 10,05                             | 4,920 % fällig am 15.07.2025         | 1.850           | 1.846                      | 0,01                              | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (e) | 5.766.349    | \$ 78.134                  | 0,46                              |
| 6,000 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055        | 1.016.630       | 1.032.303                  | 6,09                              | Dominion Energy, Inc.                |                 |                            |                                   | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (e)       | 1.355.380    | 20.126                     | 0,12                              |
| 6,500 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055        | 2.456.035       | 2.532.631                  | 14,95                             | 4,600 % fällig am 18.07.2025         | 1.900           | 1.896                      | 0,01                              | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Bond Ex-US Fund (e)                    | 10.956.929   | 125.566                    | 0,74                              |
|                                                  |                 | 8.437.792                  | 49,81                             | 4,600 % fällig am 21.07.2025         | 2.000           | 1.995                      | 0,01                              | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - UK Corporate Bond Fund (e)                    | 4.923.621    | 66.864                     | 0,40                              |
|                                                  |                 |                            |                                   | 4,600 % fällig am 01.08.2025         | 2.300           | 2.291                      | 0,01                              | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (e)                        | 373.988      | 3.822                      | 0,02                              |
| US-SCHATZOBIGATIONEN                             |                 |                            |                                   | Enbridge, Inc.                       |                 |                            |                                   | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)                | 34.754.306   | 346.562                    | 2,05                              |
| U.S. Treasury Bonds                              |                 |                            |                                   | 4,600 % fällig am 11.07.2025         | 1.250           | 1.248                      | 0,01                              | PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)                         | 345.274      | 5.058                      | 0,03                              |
| 1,375 % fällig am 15.11.2040                     | 61.050          | 38.912                     | 0,23                              | 4,600 % fällig am 21.07.2025         | 1.200           | 1.197                      | 0,01                              |                                                                                          | 646.132      | 3,82                       |                                   |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041                     | 205.300         | 141.272                    | 0,83                              | Global Payments, Inc.                |                 |                            |                                   | BÖRSENGEHADELTE FONDS                                                                    |              |                            |                                   |
| 1,875 % fällig am 15.02.2051                     | 100             | 56                         | 0,00                              | 5,000 % fällig am 01.07.2025         | 2.300           | 2.300                      | 0,01                              | PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)                                 | 3.455.880    | 397.969                    | 2,35                              |
| 2,000 % fällig am 15.08.2051                     | 7.100           | 4.096                      | 0,02                              | Harley-Davidson Funding Corp.        |                 |                            |                                   | PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)                            | 4.369.740    | 437.455                    | 2,58                              |
| 2,250 % fällig am 15.08.2049                     | 72.000          | 45.189                     | 0,27                              | 5,070 % fällig am 04.08.2025         | 100             | 100                        | 0,00                              |                                                                                          | 835.424      | 4,93                       |                                   |
| 2,875 % fällig am 15.05.2052                     | 26.900          | 18.939                     | 0,11                              | Holcim Finance U.S. LLC              |                 |                            |                                   | Summe Investmentfonds                                                                    | \$ 1.481.556 | 8,75                       |                                   |
| 3,000 % fällig am 15.02.2048                     | 35.300          | 26.239                     | 0,16                              | 4,670 % fällig am 15.07.2025         | 1.700           | 1.697                      | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049                     | 46.400          | 34.202                     | 0,20                              | 4,670 % fällig am 16.07.2025         | 19.000          | 18.961                     | 0,11                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 3,250 % fällig am 15.05.2042                     | 200             | 166                        | 0,00                              | Jabil, Inc.                          |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.11.2048                     | 137.500         | 108.813                    | 0,64                              | 4,850 % fällig am 14.07.2025         | 950             | 948                        | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,125 % fällig am 15.08.2044                     | 259.000         | 237.359                    | 1,40                              | 4,860 % fällig am 02.07.2025         | 4.400           | 4.399                      | 0,03                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.02.2044                     | 21.800          | 21.071                     | 0,12                              | Jones Lang LaSalle Finance BV        |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.11.2054                     | 638.900         | 609.051                    | 3,60                              | 4,650 % fällig am 09.07.2025         | 1.750           | 1.748                      | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.02.2055                     | 183.700         | 178.878                    | 1,06                              | 4,650 % fällig am 14.07.2025         | 950             | 948                        | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) |                 |                            |                                   | 4,720 % fällig am 07.07.2025         | 1.750           | 1.748                      | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,125 % fällig am 15.10.2025                     | 8.901           | 8.870                      | 0,05                              | 4,720 % fällig am 14.07.2025         | 3.800           | 3.793                      | 0,02                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031                     | 38.058          | 35.036                     | 0,21                              | 4,720 % fällig am 16.07.2025         | 1.200           | 1.198                      | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,125 % fällig am 15.01.2032                     | 9.836           | 8.919                      | 0,05                              | ONEOK, Inc.                          |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027                     | 46.476          | 45.845                     | 0,27                              | 4,600 % fällig am 11.07.2025         | 550             | 549                        | 0,00                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027                     | 170             | 168                        | 0,00                              | 4,600 % fällig am 14.07.2025         | 1.500           | 1.497                      | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028                     | 93.140          | 91.423                     | 0,54                              | Targa Resources Corp.                |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,625 % fällig am 15.07.2032                     | 5.851           | 5.460                      | 0,03                              | 4,700 % fällig am 29.07.2025         | 6.800           | 6.773                      | 0,04                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028                     | 9.839           | 9.722                      | 0,06                              |                                      |                 | 119.124                    | 0,71                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 1,125 % fällig am 15.01.2033                     | 98.961          | 94.608                     | 0,56                              | NIGERIA TREASURY BILLS               |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033                     | 21.123          | 20.523                     | 0,12                              | 23,286 % fällig am 04.11.2025 (b)(c) | NGN 3.500.000   | 2.097                      | 0,01                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028                     | 27.101          | 27.451                     | 0,16                              | 30,612 % fällig am 29.06.2026 (b)(c) | 27.472.911      | 14.424                     | 0,09                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027                     | 1.591           | 1.617                      | 0,01                              | 30,864 % fällig am 26.06.2026 (b)(c) | 9.440.829       | 4.964                      | 0,03                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 2,375 % fällig am 15.10.2028                     | 34.140          | 35.421                     | 0,21                              | 33,126 % fällig am 12.06.2026 (b)(c) | 16.817.197      | 8.908                      | 0,05                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029                     | 60.208          | 62.659                     | 0,37                              | 33,156 % fällig am 11.06.2026 (b)(c) | 16.831.667      | 8.920                      | 0,05                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029                     | 38.634          | 42.187                     | 0,25                              |                                      |                 | 39.313                     | 0,23                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| U.S. Treasury Notes                              |                 |                            |                                   | Summe kurzfristige Instrumente       |                 | 158.437                    | 0,94                              |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,375 % fällig am 30.09.2027                     | 2.400           | 2.229                      | 0,01                              | Summe Übertragbare Wertpapiere       |                 | \$ 22.058.515              | 130,22                            |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 0,750 % fällig am 31.01.2028                     | 100             | 93                         | 0,00                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 2,500 % fällig am 31.03.2027                     | 4.600           | 4.503                      | 0,03                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 3,500 % fällig am 15.02.2033                     | 25.100          | 24.204                     | 0,14                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 3,750 % fällig am 31.12.2028                     | 1.100           | 1.101                      | 0,01                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.02.2034                     | 27.500          | 27.222                     | 0,16                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,250 % fällig am 31.12.2025                     | 14.300          | 14.301                     | 0,09                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.11.2034                     | 100             | 100                        | 0,00                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.05.2035                     | 200             | 200                        | 0,00                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
|                                                  |                 | 2.028.105                  | 11,97                             |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| Summe USA                                        |                 | 12.050.868                 | 71,14                             |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| KURZFRISTIGE INSTRUMENTE                         |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| COMMERCIAL PAPER                                 |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| Air Lease Corp.                                  |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,840 % fällig am 08.07.2025                     | 3.000           | 2.997                      | 0,02                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,840 % fällig am 15.07.2025                     | 4.150           | 4.142                      | 0,03                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,850 % fällig am 18.07.2025                     | 5.700           | 5.686                      | 0,03                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| Alimentation Couche-Tard, Inc.                   |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,610 % fällig am 10.07.2025                     | 3.750           | 3.745                      | 0,02                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,630 % fällig am 09.07.2025                     | 2.400           | 2.397                      | 0,01                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,640 % fällig am 29.07.2025                     | 3.350           | 3.337                      | 0,02                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| Bacardi-Martini BV                               |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,900 % fällig am 03.07.2025                     | 1.350           | 1.349                      | 0,01                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| Broadcom, Inc.                                   |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,730 % fällig am 10.07.2025                     | 850             | 849                        | 0,01                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| Canadian Natural Resources Ltd.                  |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,900 % fällig am 06.08.2025 (a)                 | 12.450          | 12.389                     | 0,07                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| CBRE Services, Inc.                              |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 4,690 % fällig am 10.07.2025                     | 7.500           | 7.490                      | 0,04                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| Crown Castle, Inc.                               |                 |                            |                                   |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |
| 5,030 % fällig am 22.07.2025                     | 4.950           | 4.935                      | 0,03                              |                                      |                 |                            |                                   |                                                                                          |              |                            |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

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

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

### FUTURES

| Beschreibung                                           | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Australia Government 3-Year Note September Futures     | Long  | 09.2025     | 174                  | \$ 40                                    | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures    | Short | 09.2025     | 12.501               | (8.645)                                  | (0,05)               |
| Canada Government 5-Year Bond September Futures        | Short | 09.2025     | 1.931                | (1.036)                                  | (0,01)               |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures       | Long  | 09.2025     | 2.326                | 1.805                                    | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures                            | Short | 09.2025     | 5.029                | 1.937                                    | 0,01                 |
| Euro-BTP September Futures                             | Long  | 09.2025     | 9.997                | 4.666                                    | 0,03                 |
| Euro-Bund September Futures                            | Short | 09.2025     | 6.135                | 6.130                                    | 0,04                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures               | Long  | 09.2025     | 11                   | (29)                                     | 0,00                 |
| Euro-OAT September Futures                             | Short | 09.2025     | 6.541                | 2.062                                    | 0,01                 |
| Euro-Schatz September Futures                          | Short | 09.2025     | 1.203                | 232                                      | 0,00                 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures        | Short | 09.2025     | 2.164                | (6.519)                                  | (0,04)               |
| Short Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2025     | 6.267                | 1.236                                    | 0,01                 |
| South Korea Government 10-Year Bond September Futures  | Short | 09.2025     | 848                  | 287                                      | 0,00                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 5.045                | 4.220                                    | 0,03                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 20.598               | 24.014                                   | 0,14                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures           | Long  | 09.2025     | 6.475                | 12.273                                   | 0,07                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures          | Long  | 09.2025     | 8.744                | 18.562                                   | 0,11                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures   | Short | 09.2025     | 1.089                | (4.501)                                  | (0,03)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures             | Long  | 09.2025     | 2.047                | 6.027                                    | 0,04                 |
|                                                        |       |             |                      | <b>\$ 62.761</b>                         | <b>0,37</b>          |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                               | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld         | Marktwert        | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|-----------------|------------------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | \$ 109,000    | 25.07.2025    | 393                  | \$ (161)        | \$ (12)          | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,500       | 25.07.2025    | 393                  | (161)           | (209)            | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                | € 117,250     | 25.07.2025    | 164                  | (36)            | (35)             | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures               | 118,500       | 25.07.2025    | 164                  | (30)            | (21)             | 0,00                 |
|                                                            |               |               |                      | <b>\$ (388)</b> | <b>\$ (277)</b>  | <b>0,00</b>          |
|                                                            |               |               |                      |                 | <b>\$ 62.484</b> | <b>0,37</b>          |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

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

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

| Referenzeinheit           | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 %                     | 20.06.2026       | \$ 800                    | \$ (1)                                   | 0,00                 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

| Index/Tranchen                      | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-43 10-Year Index             | (1,000) %                   | 20.12.2034       | \$ 74.675                 | \$ (369)                                 | 0,00                 |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index  | (1,000)                     | 20.06.2030       | € 356.050                 | (1.253)                                  | (0,01)               |
| iTraxx Europe Main 43 10-Year Index | (1,000)                     | 20.06.2035       | 240.900                   | (806)                                    | (0,01)               |
|                                     |                             |                  |                           | <b>\$ (2.428)</b>                        | <b>(0,02)</b>        |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-43 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.12.2029       | \$ 548.200                | \$ (484)                                 | 0,00                 |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2030       | 3.480.500                 | 18.828                                   | 0,11                 |
|                        |                             |                  |                           | <b>\$ 18.344</b>                         | <b>0,11</b>          |



## ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex           | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag    | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|---------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                  | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,000 %         | 17.06.2026       | £ 200         | \$ 0                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,000           | 17.06.2027       | 357.180       | (5.135)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2030       | 338.900       | 5.831                                           | 0,03                    |
| Erhalt                                  | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2035       | 51.800        | (500)                                           | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                  | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 18.03.2031       | 292.400       | 297                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2055       | 18.000        | (573)                                           | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                  | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 4,000           | 17.03.2028       | 1.017.900     | 10.271                                          | 0,06                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000           | 17.09.2030       | INR 1.978.530 | (205)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 17.03.2031       | ¥ 14.710.000  | (4.486)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050           | 15.12.2031       | 17.222.400    | (2.989)                                         | (0,02)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400           | 19.06.2039       | 13.160.000    | 13.495                                          | 0,08                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,600           | 18.12.2029       | 16.240.000    | (928)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750           | 19.03.2027       | 37.770.000    | 367                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750           | 19.03.2030       | 30.810.000    | 287                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 19.03.2032       | 67.820.000    | 1.820                                           | 0,01                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 18.09.2034       | 72.160.000    | (3.352)                                         | (0,02)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 19.03.2035       | 34.570.000    | (455)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 19.06.2044       | 28.450.000    | (14.365)                                        | (0,09)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,250           | 18.06.2035       | 2.500.000     | (277)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,500           | 18.09.2054       | 2.523.600     | 2.423                                           | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,500           | 19.03.2055       | 1.130.000     | 468                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,500           | 17.09.2030       | SGD 57.700    | (942)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS | 2,750           | 18.09.2029       | 394.120       | (14.457)                                        | (0,09)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,488           | 15.08.2031       | \$ 25.600     | (3.524)                                         | (0,02)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750           | 15.06.2027       | 185.971       | (9.412)                                         | (0,06)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,965           | 30.11.2026       | 472.600       | 8.559                                           | 0,05                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000           | 19.03.2027       | 725.640       | (4.981)                                         | (0,03)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000           | 19.03.2030       | 589.200       | (14.472)                                        | (0,09)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,100           | 15.11.2032       | 42.410        | (1.363)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,232           | 10.09.2034       | 14.100        | 679                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2027       | 215.540       | (385)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2030       | 138.020       | (955)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2035       | 420.090       | (10.487)                                        | (0,06)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2035       | 266.770       | (664)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2055       | 12.730        | 44                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2055       | 10.100        | 39                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,300           | 31.05.2027       | 100.800       | 189                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500           | 18.12.2025       | 309.800       | 1.065                                           | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,600           | 30.06.2027       | 492.100       | (2.289)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,605           | 28.08.2034       | 20.300        | 317                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,620           | 30.11.2029       | 1.399.729     | (14.238)                                        | (0,08)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,679           | 13.08.2034       | 9.600         | 91                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,700           | 20.02.2049       | 1.900         | 70                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,715           | 07.08.2034       | 35.410        | 299                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750           | 18.12.2026       | 13.500        | (116)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,771           | 15.02.2055       | 56.400        | 1.530                                           | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,773           | 04.03.2055       | 29.000        | 778                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,777           | 15.02.2055       | 9.400         | 246                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,804           | 15.02.2055       | 15.200        | 325                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,842           | 04.03.2030       | 83.600        | (1.242)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,850           | 05.08.2034       | 28.900        | (139)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,851           | 28.02.2029       | 135.500       | (1.897)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,861           | 15.02.2055       | 11.800        | 129                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,862           | 28.02.2029       | 133.200       | (1.919)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,900           | 15.02.2035       | 1.067.778     | (21.041)                                        | (0,13)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,905           | 15.08.2026       | 163.400       | (302)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,905           | 12.03.2035       | 9.800         | (144)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,921           | 15.11.2054       | 2.100         | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,922           | 15.11.2054       | 17.600        | 17                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,930           | 24.03.2035       | 29.000        | (490)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,930           | 25.06.2055       | 30.900        | (221)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,940           | 15.11.2054       | 12.100        | (28)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,955           | 15.11.2054       | 21.800        | (106)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,959           | 15.11.2054       | 45.000        | (257)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,960           | 27.06.2055       | 38.471        | (321)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,964           | 15.11.2054       | 19.600        | (131)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,975           | 21.03.2035       | 21.600        | (449)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,990           | 15.11.2054       | 12.000        | (135)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,993           | 15.11.2054       | 18.300        | (216)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,994           | 15.11.2054       | 58.000        | (691)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,000           | 20.06.2026       | 132.100       | (2.085)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,005           | 29.09.2055       | 11.439        | (81)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,018           | 15.11.2054       | 15.200        | (246)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,020           | 15.05.2026       | 145.200       | (24)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,065           | 26.06.2055       | 19.479        | (192)                                           | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,100           | 15.11.2052       | 104.700       | (2.150)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,111           | 15.11.2054       | 45.600        | (1.501)                                         | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,115           | 15.11.2054       | 16.940        | (569)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,117           | 15.11.2054       | 4.110         | (139)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,130           | 15.11.2054       | 39.350        | (1.426)                                         | (0,01)                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt variabler<br>Zinssatz       | Variabler Zinssatzindex             | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,713 %         | 02.10.2029       | CAD        | 81.100                                          | \$ 3.180                | 0,02   |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,900           | 18.12.2029       |            | 76.500                                          | 3.205                   | 0,02   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,740           | 01.06.2034       |            | 6.300                                           | 58                      | 0,00   |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850           | 01.09.2029       |            | 151.800                                         | 1.503                   | 0,01   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850           | 01.06.2033       |            | 14.000                                          | (132)                   | 0,00   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,880           | 01.09.2033       |            | 48.600                                          | (92)                    | 0,00   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2033       |            | 20.000                                          | (252)                   | 0,00   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2034       |            | 58.500                                          | (351)                   | 0,00   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,180           | 01.06.2033       |            | 140.200                                         | (2.468)                 | (0,02) |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250           | 15.03.2033       |            | 88.700                                          | (3.423)                 | (0,02) |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250           | 18.12.2034       |            | 28.100                                          | 135                     | 0,00   |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250           | 21.06.2053       |            | 2.300                                           | 135                     | 0,00   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,300           | 01.06.2033       |            | 65.400                                          | (2.049)                 | (0,01) |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,400           | 01.06.2033       |            | 17.700                                          | (514)                   | 0,00   |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 18.12.2025       |            | 477.400                                         | 3.341                   | 0,02   |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 19.03.2026       |            | 397.400                                         | 2.525                   | 0,01   |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 01.09.2033       |            | 78.900                                          | (3.521)                 | (0,02) |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,700           | 01.09.2033       |            | 31.200                                          | (1.487)                 | (0,01) |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2033       |            | 10.100                                          | (444)                   | 0,00   |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,925           | 19.06.2026       |            | 176.100                                         | 1.806                   | 0,01   |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,283           | 14.02.2027       | CHF        | 47.000                                          | 431                     | 0,00   |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,294           | 10.02.2027       |            | 42.300                                          | 1.071                   | 0,01   |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,343           | 16.05.2027       |            | 31.300                                          | 370                     | 0,00   |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 3-Month CNY-CNREPOFIX               | 1,500           | 18.06.2030       | CNY        | 9.874.800                                       | 5.227                   | 0,03   |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 3-Month KRW-KORIBOR                 | 2,500           | 17.09.2035       | KRW        | 153.605.550                                     | (458)                   | 0,00   |
| Zahlung                                        | 3-Month KRW-KORIBOR                 | 2,750           | 19.03.2035       |            | 102.532.520                                     | 1.005                   | 0,01   |
| Zahlung                                        | 3-Month NZD-BBR                     | 4,750           | 19.06.2029       | NZD        | 77.500                                          | 1.692                   | 0,01   |
| Zahlung                                        | 3-Month SEK-STIBOR                  | 2,474           | 03.02.2030       | SEK        | 393.000                                         | 890                     | 0,01   |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,500           | 18.03.2031       | AUD        | 65.100                                          | (13)                    | 0,00   |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,750           | 19.03.2030       |            | 1.223.900                                       | 5.478                   | 0,03   |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,000           | 21.06.2033       |            | 376.400                                         | 9.525                   | 0,06   |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250           | 15.03.2033       |            | 39.100                                          | (50)                    | 0,00   |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250           | 19.03.2035       |            | 98.600                                          | 1.066                   | 0,01   |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 19.03.2035       |            | 385.600                                         | 7.604                   | 0,04   |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 18.06.2035       |            | 42.900                                          | 766                     | 0,00   |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR                  | 1,913           | 30.01.2029       | CZK        | 158.300                                         | (480)                   | 0,00   |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,064           | 17.11.2052       | €          | 17.650                                          | 10.876                  | 0,06   |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,451           | 27.05.2050       |            | 19.900                                          | (9.902)                 | (0,06) |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,795           | 11.10.2029       |            | 53.450                                          | (597)                   | 0,00   |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,923           | 11.10.2029       |            | 1.900                                           | (9)                     | 0,00   |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,929           | 11.10.2029       |            | 159.180                                         | (673)                   | 0,00   |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,000           | 17.09.2027       |            | 272.800                                         | (1.075)                 | (0,01) |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,028           | 11.10.2029       |            | 269.000                                         | (392)                   | 0,00   |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,235           | 12.03.2055       |            | 208.200                                         | 10.015                  | 0,06   |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2030       |            | 556.590                                         | 6.026                   | 0,03   |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2035       |            | 1.602.080                                       | 2.829                   | 0,02   |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 21.09.2037       |            | 55.870                                          | (241)                   | 0,00   |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2055       |            | 161.820                                         | 6.993                   | 0,04   |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,270           | 12.03.2055       |            | 105.000                                         | 4.681                   | 0,03   |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,282           | 12.03.2055       |            | 35.300                                          | 1.539                   | 0,01   |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,343           | 10.01.2030       |            | 330.600                                         | 1.012                   | 0,01   |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,460           | 01.04.2035       |            | 30.800                                          | (329)                   | 0,00   |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520           | 27.03.2035       |            | 17.200                                          | (76)                    | 0,00   |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,750           | 18.09.2039       |            | 46.900                                          | (1.814)                 | (0,01) |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,827           | 06.05.2029       |            | 34.100                                          | 1.060                   | 0,01   |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 3,000           | 15.03.2033       |            | 252.755                                         | (1.128)                 | (0,01) |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 3,450           | 20.10.2028       |            | 1.550                                           | 115                     | 0,00   |
|                                                |                                     |                 |                  |            | \$                                              | (35.864)                | (0,21) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                     |                 |                  |            | \$                                              | (19.949)                | (0,12) |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## OPTIONSKAUF

## DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,650    | 11.03.2026    | 16.289                    | \$ 112   | \$ 119    | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000   | 25.08.2025    | 21.328                    | 96       | 127       | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,115      | 26.11.2025    | 5.400                     | 21       | 20        | 0,00                 |
| BRC        | Call - OTC USD versus SEK | SEK 10,200    | 26.11.2025    | 34.601                    | 216      | 209       | 0,00                 |
| GLM        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,100      | 17.12.2025    | 5.959                     | 682      | 489       | 0,01                 |
| JPM        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,600    | 22.12.2025    | 49.119                    | 220      | 256       | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 395,000   | 29.09.2025    | 26.346                    | 133      | 108       | 0,00                 |
| MBC        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,098      | 23.12.2025    | 5.299                     | 615      | 414       | 0,01                 |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,750    | 09.12.2025    | 17.259                    | 103      | 131       | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,550        | 16.12.2025    | 44.616                    | 200      | 196       | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,700        | 16.12.2025    | 28.965                    | 181      | 197       | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,110      | 24.11.2025    | 112.132                   | 526      | 356       | 0,00                 |
|            |                           |               |               |                           | \$ 3.105 | \$ 2.622  | 0,02                 |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                        | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| BPS        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,570 %       | 13.08.2025    | 915.100                   | \$ 1.281 | \$ 1      | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,570         | 13.08.2025    | 21.200                    | 30       | 0         | 0,00                 |
|            |                                     |                         |                                             |               |               |                           | \$ 1.311 | \$ 1      | 0,00                 |

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|------------|------------|----------------------|
| BPS        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 54,000    | 19.12.2025    | 798                       | \$ (27)    | \$ (22)    | 0,00                 |
| GLM        | Call - OTC USD versus TRY | 53,500        | 11.12.2025    | 27.286                    | (886)      | (729)      | (0,01)               |
| UAG        | Call - OTC USD versus TRY | 54,000        | 16.12.2025    | 17.146                    | (564)      | (463)      | 0,00                 |
|            |                           |               |               |                           | \$ (1.477) | \$ (1.214) | (0,01)               |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|------------|------------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770 %       | 09.07.2025    | 54.400                    | \$ (174)   | \$ (497)   | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120         | 09.07.2025    | 54.400                    | (174)      | (1)        | 0,00                 |
| BRC        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,350         | 25.09.2025    | 36.400                    | (349)      | (10)       | 0,00                 |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564         | 24.07.2025    | 54.600                    | (183)      | (208)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914         | 24.07.2025    | 54.600                    | (167)      | (95)       | 0,00                 |
| DUB        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,330         | 25.09.2025    | 6.600                     | (73)       | (2)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,330         | 25.09.2025    | 62.400                    | (686)      | (19)       | 0,00                 |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525         | 28.07.2025    | 7.700                     | (25)       | (26)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875         | 28.07.2025    | 7.700                     | (25)       | (20)       | 0,00                 |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772         | 10.07.2025    | 54.000                    | (177)      | (514)      | (0,01)               |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122         | 10.07.2025    | 54.000                    | (177)      | (2)        | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697         | 16.07.2025    | 54.600                    | (158)      | (368)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097         | 16.07.2025    | 54.600                    | (158)      | (9)        | 0,00                 |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | \$ (2.526) | \$ (1.771) | (0,01)               |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|------------|----------------------|
| GST        | South Korea Government International Bond | (1,000) %                   | 20.06.2030       | \$ 21.900                 | \$ (700)                                     | \$ (45)                                         | \$ (745)   | 0,00                 |
| MYC        | South Korea Government International Bond | (1,000)                     | 20.06.2030       | 22.400                    | (715)                                        | (48)                                            | (763)      | (0,01)               |
|            |                                           |                             |                  |                           | \$ (1.415)                                   | \$ (93)                                         | \$ (1.508) | (0,01)               |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit     | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|----------------------|
| GST        | Petroleos Mexicanos | 4,850 %                     | 07.05.2026       | \$ 72.096                 | \$ 0                                         | \$ 885                                          | \$ 885    | 0,01                 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückzahlungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                                            | Zahlung                                                                                                               | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag<br>erhaltener<br>Währung | Nennbetrag<br>gelieferter<br>Währung | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert  | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|------------|------------------------------|
| CBK        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,410 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.12.2026       | \$ 353.857                          | ¥ 52.392.000                         | \$ 609                                       | \$ 37                                           | \$ 646     | 0,00                         |
|            | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,470 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.09.2030       | 15.435                              | 2.380.000                            | (108)                                        | 39                                              | (69)       | 0,00                         |
|            | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,462 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.09.2030       | 144.590                             | 22.050.000                           | (318)                                        | 296                                             | (22)       | 0,00                         |
| GLM        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,459 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.09.2030       | 4.914                               | 750.000                              | (15)                                         | 10                                              | (5)        | 0,00                         |
| GST        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,414 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 15.10.2026       | 615.394                             | 97.415.300                           | (8.843)                                      | 280                                             | (8.563)    | (0,05)                       |
|            | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,417 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.12.2026       | 103.692                             | 15.408.700                           | (60)                                         | 19                                              | (41)       | 0,00                         |
|            | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,420 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.06.2027       | 44.332                              | 6.339.000                            | 150                                          | 6                                               | 156        | 0,00                         |
| JPM        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,410 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.12.2026       | 203.399                             | 30.115.200                           | 350                                          | 22                                              | 372        | 0,00                         |
| MYC        | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day USD-<br>SOFR Compounded-OIS<br>abzgl. 0,430 %<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz<br>entspricht 1-Day JPY-<br>MUTKCALM<br>basierend auf dem<br>Nennbetrag der<br>gelieferten Währung | 17.09.2030       | 9.621                               | 1.460.000                            | (22)                                         | 4                                               | (18)       | 0,00                         |
|            |                                                                                                                                                   |                                                                                                                       |                  |                                     |                                      | \$ (8.257)                                   | \$ 713                                          | \$ (7.544) | (0,05)                       |

## ZINSSWAPS

|            | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz |                       |         |                  |            |           | Gezahlte/<br>(erhaltene) | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) |           | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|------------|---------------------------------------------|-----------------------|---------|------------------|------------|-----------|--------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| Kontrahent | Variable                                    | Variable              | Fester  | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag |           | Abschlussprämien         |                                                 | Marktwert |                              |
| BPS        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 1,500 % | 18.03.2031       | CNY        | 3.932.200 | \$ (1.260)               | \$ 1.963                                        | \$ 703    | 0,00                         |
|            | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR    | 3,500   | 19.03.2030       | MYR        | 183.710   | (189)                    | 801                                             | 612       | 0,00                         |
|            | Erhalt                                      | 3-Month MYR-KLIBOR    | 3,750   | 18.09.2034       |            | 82.890    | (229)                    | (334)                                           | (563)     | 0,00                         |
| CBK        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 1,500   | 18.03.2031       | CNY        | 2.045.000 | 0                        | 366                                             | 366       | 0,00                         |
| GST        | Zahlung                                     | 3-Month MYR-KLIBOR    | 3,500   | 19.03.2030       | MYR        | 533.090   | 253                      | 1.523                                           | 1.776     | 0,01                         |
|            | Erhalt                                      | 3-Month MYR-KLIBOR    | 3,750   | 20.09.2033       |            | 275.030   | 1.742                    | (3.654)                                         | (1.912)   | (0,01)                       |
| JPM        | Erhalt                                      | 3-Month MYR-KLIBOR    | 3,750   | 19.03.2035       |            | 61.130    | 47                       | (457)                                           | (410)     | 0,00                         |
| SCX        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 1,500   | 18.03.2031       | CNY        | 454.700   | 210                      | (129)                                           | 81        | 0,00                         |
|            |                                             |                       |         |                  |            |           | \$ 574                   | \$ 79                                           | \$ 653    | 0,00                         |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettover-<br>mögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD                    | 220                      | \$ 162                           | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CNH                    | 482.999                  | 67.040                           | 0                                  | (462)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | 63                       | CHF 50                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 37.980                   | € 33.040                         | 804                                | 804                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 18.555                   | NZD 30.833                       | 162                                | 162                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CHF                    | 50                       | \$ 63                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH                    | 728.416                  | 101.347                          | 0                                  | (726)                                                | 0,00                         |
|            | 08.2025          | €                      | 12.660                   | 14.856                           | 0                                  | (38)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025          | NZD                    | 30.833                   | 18.576                           | 0                                  | (162)                                                | 0,00                         |
|            | 08.2025          | \$                     | 162                      | CAD 220                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | 8.487                    | CNH 61.548                       | 138                                | 138                                                  | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025          | AUD                    | 14.276                   | \$ 9.298                         | 0                                  | (58)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CNY                    | 121                      | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | KRW                    | 13.776.324               | 10.106                           | 0                                  | (80)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | PEN                    | 6.942                    | 1.854                            | 0                                  | (102)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | 10.469                   | € 9.262                          | 403                                | 403                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 736                      | £ 542                            | 7                                  | 7                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 9.750                    | IDR 159.072.638                  | 47                                 | 47                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 10.056                   | SGD 12.877                       | 54                                 | 54                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH                    | 180.491                  | \$ 25.224                        | 0                                  | (69)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025          | HUF                    | 2.413.507                | € 5.972                          | 0                                  | (31)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025          | SGD                    | 12.847                   | \$ 10.056                        | 0                                  | (56)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025          | TWD                    | 3.564                    | 109                              | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025          | \$                     | 20.975                   | MXN 397.840                      | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025          | BRL                    | 846                      | \$ 148                           | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CAD                    | 2.180                    | 1.584                            | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      | 7.042                    | £ 6.003                          | 0                                  | (41)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 12.591                   | RON 63.607                       | 0                                  | (96)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | £                      | 5.915                    | € 7.042                          | 161                                | 161                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | ¥                      | 129.454                  | \$ 899                           | 3                                  | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | KRW                    | 433.109                  | 319                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | NOK                    | 25.725                   | 2.542                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | RON                    | 88                       | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | SEK                    | 42.400                   | 4.416                            | 0                                  | (33)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | THB                    | 9.397                    | 284                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | TWD                    | 674.674                  | 20.762                           | 0                                  | (2.464)                                              | (0,01)                       |
|            | 07.2025          | \$                     | 64.731                   | BRL 361.430                      | 1.491                              | 1.491                                                | 0,01                         |
|            | 07.2025          |                        | 11.557                   | CNY 82.793                       | 17                                 | 17                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 8.335                    | € 7.274                          | 204                                | 204                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 20.207                   | IDR 329.682.179                  | 97                                 | 97                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 789                      | ¥ 112.700                        | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 1.550                    | THB 50.767                       | 13                                 | 13                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 18.900                   | TRY 764.676                      | 220                                | 220                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | 5.980                    | TWD 177.929                      | 142                                | 142                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH                    | 217.237                  | \$ 30.414                        | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CZK                    | 3.718                    | 167                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025          | £                      | 6.015                    | € 7.042                          | 41                                 | 41                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025          | TWD                    | 559.989                  | \$ 17.181                        | 0                                  | (2.284)                                              | (0,01)                       |
|            | 08.2025          | \$                     | 10.450                   | CNH 74.686                       | 16                                 | 16                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | 2.944                    | CNY 21.054                       | 4                                  | 4                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | 10.549                   | INR 916.932                      | 117                                | 117                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | 14.219                   | MXN 270.847                      | 47                                 | 47                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | 12.682                   | TRY 527.574                      | 132                                | 132                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | 1.039                    | TWD 34.024                       | 143                                | 143                                                  | 0,00                         |
|            | 05.2026          |                        | 6.986                    | KWD 2.129                        | 0                                  | (26)                                                 | 0,00                         |
|            | 06.2026          |                        | 5.942                    | 1.814                            | 1                                  | (11)                                                 | 0,00                         |
|            | 06.2027          |                        | 1.536                    | 466                              | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                         |
|            | 05.2029          | KWD                    | 10.514                   | \$ 36.145                        | 1.580                              | 1.580                                                | 0,01                         |
|            | 07.2029          |                        | 1.012                    | 3.480                            | 151                                | 151                                                  | 0,00                         |
|            | 05.2030          |                        | 7.566                    | 26.055                           | 1.041                              | 1.041                                                | 0,01                         |
| BRC        | 07.2025          | AUD                    | 9.247                    | 6.025                            | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | BRL                    | 48.442                   | 8.725                            | 0                                  | (151)                                                | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
|            | 07.2025          | €                   | 15.577 RON            | 78.878 \$                     | 0                               | \$ (76)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 35.691 \$             | 40.867                        | 0                               | (1.029)                                        | (0,01)               |
|            | 07.2025          | ILS                 | 97.451                | 27.990                        | 0                               | (950)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | KRW                 | 2.098.496             | 1.535                         | 0                               | (17)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 18.935                | 1.862                         | 0                               | (9)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 1.725                 | 1.341                         | 0                               | (13)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TRY                 | 6.126                 | 151                           | 0                               | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 3.143 CAD             | 4.322                         | 29                              | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 91.071 €              | 80.487                        | 3.409                           | 0                                              | 3.409                |
|            | 07.2025          |                     | 786 £                 | 581                           | 10                              | 0                                              | 10                   |
|            | 07.2025          |                     | 13.880 ILS            | 46.860                        | 36                              | 0                                              | 36                   |
|            | 07.2025          |                     | 750 KRW               | 1.031.164                     | 12                              | 0                                              | 12                   |
|            | 07.2025          |                     | 655 PLN               | 2.456                         | 24                              | 0                                              | 24                   |
|            | 07.2025          |                     | 75.842 TRY            | 3.094.042                     | 933                             | 0                                              | 933                  |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 937.181               | 51.811                        | 0                               | (841)                                          | (841)                |
|            | 08.2025          | CNH                 | 65.343                | 9.099                         | 0                               | (57)                                           | (57)                 |
|            | 08.2025          | CZK                 | 36.687                | 1.650                         | 0                               | (95)                                           | (95)                 |
|            | 08.2025          | THB                 | 89                    | 3                             | 0                               | 0                                              | 0                    |
|            | 08.2025          | \$                  | 54.127 TRY            | 2.252.738                     | 677                             | 0                                              | 677                  |
|            | 09.2025          | MYR                 | 466.583               | 110.758                       | 0                               | (492)                                          | (492)                |
|            | 12.2025          | \$                  | 4.084 TRY             | 191.057                       | 89                              | 0                                              | 89                   |
| BSH        | 07.2025          | DKK                 | 287.713               | 43.816                        | 0                               | (1.451)                                        | (1.451)              |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.926 PEN             | 6.942                         | 30                              | 0                                              | 30                   |
|            | 11.2025          | PEN                 | 77.652                | 21.248                        | 0                               | (544)                                          | (544)                |
| CBK        | 07.2025          | CAD                 | 113.453               | 82.084                        | 0                               | (1.063)                                        | (1.063)              |
|            | 07.2025          | CNY                 | 93.144                | 12.999                        | 0                               | 0                                              | 0                    |
|            | 07.2025          | DKK                 | 130                   | 20                            | 0                               | (1)                                            | (1)                  |
|            | 07.2025          | €                   | 16.222                | 18.545                        | 0                               | (497)                                          | (497)                |
|            | 07.2025          | KRW                 | 367.462.079           | 268.083                       | 0                               | (3.614)                                        | (3.614)              |
|            | 07.2025          | PEN                 | 39.573                | 10.754                        | 0                               | (391)                                          | (391)                |
|            | 07.2025          | SEK                 | 14.980                | 1.578                         | 6                               | 0                                              | 6                    |
|            | 07.2025          | SGD                 | 720                   | 561                           | 0                               | (5)                                            | (5)                  |
|            | 07.2025          | THB                 | 491.704               | 14.786                        | 0                               | (354)                                          | (354)                |
|            | 07.2025          | TWD                 | 1.175.284             | 36.125                        | 0                               | (4.335)                                        | (4.335)              |
|            | 07.2025          | \$                  | 7.832 AUD             | 12.058                        | 70                              | 0                                              | 70                   |
|            | 07.2025          |                     | 1.296 CAD             | 1.773                         | 4                               | 0                                              | 4                    |
|            | 07.2025          |                     | 108.508 CNY           | 777.430                       | 226                             | 0                                              | 226                  |
|            | 07.2025          |                     | 3.043 €               | 2.598                         | 7                               | 0                                              | 7                    |
|            | 07.2025          |                     | 5.731 £               | 4.207                         | 38                              | (4)                                            | 34                   |
|            | 07.2025          |                     | 15.883 IDR            | 258.650.296                   | 46                              | 0                                              | 46                   |
|            | 07.2025          |                     | 24.616 ¥              | 3.504.900                     | 0                               | (351)                                          | (351)                |
|            | 07.2025          |                     | 345 PEN               | 1.255                         | 9                               | 0                                              | 9                    |
|            | 07.2025          |                     | 5.669 SEK             | 53.733                        | 0                               | (31)                                           | (31)                 |
|            | 07.2025          |                     | 9.873 TWD             | 292.609                       | 200                             | 0                                              | 200                  |
|            | 08.2025          | CNH                 | 153.774               | 21.392                        | 0                               | (156)                                          | (156)                |
|            | 08.2025          | EGP                 | 80.911                | 1.507                         | 0                               | (91)                                           | (91)                 |
|            | 08.2025          | PEN                 | 13.455                | 3.571                         | 0                               | (217)                                          | (217)                |
|            | 08.2025          | SEK                 | 53.617                | 5.669                         | 31                              | 0                                              | 31                   |
|            | 08.2025          | TWD                 | 1.582.684             | 48.547                        | 0                               | (6.467)                                        | (6.467)              |
|            | 08.2025          | \$                  | 55.069 CNY            | 393.809                       | 98                              | 0                                              | 98                   |
|            | 08.2025          |                     | 600 EGP               | 33.030                        | 53                              | 0                                              | 53                   |
|            | 08.2025          |                     | 78.991 INR            | 6.808.364                     | 258                             | (51)                                           | 207                  |
|            | 08.2025          |                     | 1.136 PEN             | 4.094                         | 16                              | 0                                              | 16                   |
|            | 09.2025          | MXN                 | 45.916                | 2.393                         | 0                               | (18)                                           | (18)                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 66.581                | 18.126                        | 0                               | (596)                                          | (596)                |
|            | 09.2025          | \$                  | 4.040 KZT             | 2.082.620                     | 0                               | (115)                                          | (115)                |
|            | 11.2025          | PEN                 | 103.735               | 28.094                        | 0                               | (1.024)                                        | (1.024)              |
| DUB        | 01.2026          | ¥                   | 1.210.000             | 8.914                         | 367                             | 0                                              | 367                  |
|            | 07.2025          | CNY                 | 194                   | 27                            | 0                               | 0                                              | 0                    |
|            | 07.2025          | ILS                 | 47.324                | 13.654                        | 0                               | (399)                                          | (399)                |
|            | 07.2025          | KRW                 | 1.854.523             | 1.360                         | 0                               | (11)                                           | (11)                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 807                   | 626                           | 0                               | (7)                                            | (7)                  |
|            | 07.2025          | \$                  | 6.298 CNY             | 44.982                        | 4                               | (10)                                           | (6)                  |
|            | 07.2025          |                     | 34.010 DKK            | 216.590                       | 67                              | 0                                              | 67                   |
|            | 07.2025          |                     | 1.307 IDR             | 21.276.120                    | 4                               | 0                                              | 4                    |
|            | 07.2025          |                     | 950 KZT               | 502.313                       | 11                              | 0                                              | 11                   |
|            | 07.2025          |                     | 5.494 TWD             | 163.315                       | 127                             | 0                                              | 127                  |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 122                   | 7                             | 0                               | 0                                              | 0                    |
|            | 08.2025          | CNH                 | 353                   | 49                            | 0                               | 0                                              | 0                    |
|            | 08.2025          | CNY                 | 88                    | 12                            | 0                               | 0                                              | 0                    |
|            | 08.2025          | DKK                 | 216.064               | 34.010                        | 0                               | (68)                                           | (68)                 |
|            | 08.2025          | €                   | 25.105 RON            | 127.431                       | 0                               | (171)                                          | (171)                |
|            | 08.2025          | THB                 | 1.368.330             | 42.126                        | 0                               | (118)                                          | (118)                |
|            | 08.2025          | \$                  | 33.279 CNH            | 239.361                       | 263                             | 0                                              | 263                  |
|            | 08.2025          |                     | 1.580 EGP             | 87.058                        | 141                             | 0                                              | 141                  |
|            | 08.2025          |                     | 36.614 INR            | 3.159.408                     | 150                             | (12)                                           | 138                  |
|            | 09.2025          | KZT                 | 783.731               | 1.444                         | 0                               | (33)                                           | (33)                 |
|            | 09.2025          | \$                  | 10.567 KZT            | 5.478.034                     | 0                               | (243)                                          | (243)                |
|            | 12.2025          |                     | 7.755                 | 4.122.118                     | 0                               | (205)                                          | (205)                |
| FAR        | 07.2025          | CHF                 | 30.461                | 36.990                        | 0                               | (1.277)                                        | (1.277)              |
|            | 07.2025          | CNH                 | 245.697               | 34.189                        | 0                               | (148)                                          | (148)                |
|            | 07.2025          | ¥                   | 79.770.161            | 556.053                       | 3.800                           | 0                                              | 3.800                |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| GLM        | 07.2025          | SGD                 | 3.371 \$              | 2.623 \$                      | 0                               | (24)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 160.440 AUD           | 245.397                       | 380                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 68.730 BRL            | 392.953                       | 3.268                           | 0                                             | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 49.013 CHF            | 39.238                        | 281                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 46.258 DKK            | 294.382                       | 59                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 303.649 ¥             | 44.199.150                    | 2.344                           | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 23.663 PLN            | 87.270                        | 477                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 8.491 SGD             | 10.828                        | 11                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | 245.397 \$            | 160.539                       | 0                               | (383)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CHF                 | 39.076                | 49.013                        | 0                               | (283)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 229.286               | 32.042                        | 0                               | (88)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | DKK                 | 293.661               | 46.258                        | 0                               | (58)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 44.036.607            | 303.649                       | 0                               | (2.346)                                       | (0,01)               |
|            | 08.2025          | SGD                 | 10.802                | 8.491                         | 0                               | (12)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 17.497 INR            | 1.513.165                     | 105                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 90.195 \$             | 24.457                        | 0                               | (908)                                         | (0,01)               |
|            | 09.2025          | \$                  | 19.538 MXN            | 380.439                       | 437                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          |                     | 714 PEN               | 2.588                         | 14                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | BRL                 | 1.141.619 \$          | 207.153                       | 0                               | (2.017)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | €                   | 16.228 RON            | 81.897                        | 0                               | (143)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 121.718 \$            | 3.742                         | 0                               | (448)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 5.159 CNY             | 36.977                        | 14                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.765 IDR             | 61.352.973                    | 13                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.298 SGD             | 4.204                         | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 858 THB               | 28.556                        | 21                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 317 TWD               | 10.312                        | 38                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 2.927 \$              | 162                           | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | €                   | 2.961 RON             | 15.041                        | 0                               | (18)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 4.194 \$              | 3.298                         | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 13 CNY                | 92                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 2.380 EGP             | 131.230                       | 214                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 8.386 HUF             | 2.898.426                     | 103                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 249 THB               | 8.218                         | 4                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 698 TWD               | 22.901                        | 98                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MYR                 | 102.869 \$            | 24.434                        | 0                               | (93)                                          | 0,00                 |
|            | 09.2025          | \$                  | 3.373 KZT             | 1.761.364                     | 0                               | (50)                                          | 0,00                 |
|            | 10.2025          |                     | 207.153 BRL           | 1.168.072                     | 1.986                           | 0                                             | 0,01                 |
|            | 12.2025          | TRY                 | 146.387 \$            | 3.140                         | 0                               | (63)                                          | 0,00                 |
| IND JPM    | 01.2026          | ¥                   | 3.670.000             | 27.264                        | 1.340                           | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 15 TWD                | 440                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 1.877 \$              | 2.290                         | 0                               | (68)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 465.502               | 64.499                        | 0                               | (557)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 222.955               | 33.766                        | 0                               | (1.313)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | KRW                 | 27.675.595            | 20.208                        | 0                               | (255)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 87.544                | 68.153                        | 0                               | (581)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TRY                 | 651                   | 16                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 682.909               | 21.000                        | 0                               | (2.509)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 310.037 AUD           | 473.045                       | 0                               | (26)                                          | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          |                     | 74.892 BRL            | 438.244                       | 5.405                           | 0                                             | 0,03                 |
|            | 07.2025          |                     | 869 CAD               | 1.190                         | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 14.948 CNY            | 107.046                       | 1                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 49.609 PLN            | 183.783                       | 1.229                           | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 6.585 SGD             | 8.431                         | 35                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 709 TRY               | 28.906                        | 7                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 374.990 \$            | 20.983                        | 0                               | (85)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | 473.045               | 310.231                       | 25                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 673.475               | 93.647                        | 0                               | (727)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 8.412                 | 6.585                         | 0                               | (36)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 686.537               | 21.068                        | 0                               | (2.796)                                       | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 11.795 INR            | 1.022.667                     | 101                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 10.2025          | HUF                 | 2.548.991 €           | 6.323                         | 17                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 01.2026          | ¥                   | 3.490.000 \$          | 25.465                        | 813                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 9.497                 | 6.124                         | 0                               | (100)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 964.091               | 701.941                       | 0                               | (4.612)                                       | (0,03)               |
|            | 07.2025          | CHF                 | 6.903                 | 8.400                         | 0                               | (272)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 223.163               | 30.967                        | 0                               | (221)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNY                 | 50.631                | 7.064                         | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 85.565                | 98.542                        | 0                               | (1.898)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | £                   | 73.272                | 99.409                        | 0                               | (999)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | HKD                 | 40.499                | 5.178                         | 11                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 6.353.285             | 44.076                        | 170                             | (78)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 210.550               | 164.126                       | 0                               | (1.187)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | THB                 | 246.827               | 7.458                         | 0                               | (143)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 328.026               | 10.065                        | 0                               | (1.228)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 427 AUD               | 655                           | 2                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 780.489 CAD           | 1.072.830                     | 5.766                           | (11)                                          | 0,03                 |
|            | 07.2025          |                     | 24.332 CNY            | 174.242                       | 35                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 30.870 €              | 26.820                        | 613                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 16.122 £              | 11.893                        | 184                             | (8)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.908 IDR             | 63.513.363                    | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 12.211 ¥              | 1.770.600                     | 51                              | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 5.038 PLN             | 18.865                        | 181                             | 0                                             | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
|            | 07.2025          | \$                  | 386 SEK               | 3.680                         | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 172.822 SGD           | 223.471                       | 2.635                           | 2.635                                          | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 435 TWD               | 12.941                        | 10                              | 10                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD                 | 1.068.831             | \$ 778.859                    | 0                               | (5.783)                                        | (0,03)               |
|            | 08.2025          | CNH                 | 703.444               | 97.300                        | 0                               | (1.273)                                        | (0,01)               |
|            | 08.2025          | SGD                 | 219.389               | 170.039                       | 0                               | (2.644)                                        | (0,02)               |
|            | 08.2025          | THB                 | 2.331.663             | 72.175                        | 190                             | 190                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 520.460               | 16.070                        | 0                               | (2.021)                                        | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 199.813 CNH           | 1.433.339                     | 1.041                           | 1.041                                          | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 7.064 CNY             | 50.465                        | 8                               | 8                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 1.910 EGP             | 105.184                       | 168                             | 168                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 81                    | \$ 111                        | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 2.416.634             | 16.749                        | 21                              | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 9.984                 | 7.810                         | 0                               | (29)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 12.391 €              | 10.582                        | 31                              | 31                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.247 £               | 2.368                         | 0                               | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 96.557 ¥              | 14.080.985                    | 926                             | 926                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.896 MYR             | 8.025                         | 12                              | 12                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 4.618 NOK             | 46.582                        | 0                               | (15)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 124 PLN               | 456                           | 2                               | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.010 SGD             | 1.294                         | 6                               | 6                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 233.703               | \$ 32.644                     | 0                               | (105)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 14.029.224            | 96.557                        | 0                               | (927)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025          | NOK                 | 45.573                | 4.519                         | 15                              | 15                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 3.638 CNY             | 26.019                        | 7                               | 7                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          | CAD                 | 45.551                | \$ 32.031                     | 0                               | (1.466)                                        | (0,01)               |
|            | 09.2025          | \$                  | 1.193 KZT             | 618.086                       | 0                               | (27)                                           | 0,00                 |
|            | 12.2025          | CZK                 | 184.554               | € 7.314                       | 0                               | (131)                                          | 0,00                 |
|            | 04.2026          | DKK                 | 201.665               | \$ 28.700                     | 0                               | (3.635)                                        | (0,02)               |
|            | 07.2025          | CHF                 | 48                    | 58                            | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 738.500               | 5.130                         | 17                              | 17                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 5.161 CNH             | 37.270                        | 61                              | 61                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 720                   | \$ 208                        | 0                               | (6)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 2.979                 | 1.799                         | 0                               | (9)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 42.627                | 1.464                         | 0                               | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.430 EGP             | 77.377                        | 119                             | 119                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 2.525 £               | 1.856                         | 18                              | 18                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 17.511 IDR            | 285.333.087                   | 62                              | 62                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 10.501 ¥              | 1.522.398                     | 38                              | 38                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 33.956 SGD            | 43.797                        | 431                             | 431                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 16.460 TWD            | 489.056                       | 376                             | 376                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 402.634               | \$ 56.364                     | 0                               | (57)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 17.334                | 120                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 43.697                | 33.956                        | 0                               | (438)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 183.555               | 5.626                         | 0                               | (755)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 12.347 INR            | 1.060.069                     | 0                               | (16)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 469 RON               | 2.368                         | 0                               | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | RON                 | 3.586                 | \$ 817                        | 0                               | (10)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 861 €                 | 747                           | 17                              | 17                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 14.092 ¥              | 2.034.122                     | 0                               | (9)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 473 NOK               | 4.746                         | 0                               | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 2.026.657             | \$ 14.092                     | 9                               | 9                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 4.745                 | 473                           | 4                               | 4                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 65 HUF                | 23.747                        | 4                               | 4                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 71 INR                | 6.108                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 65.036                | \$ 18.073                     | 0                               | (216)                                          | 0,00                 |
|            | 12.2025          | \$                  | 300 EGP               | 16.365                        | 8                               | 8                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 465.896               | \$ 630.831                    | 0                               | (7.610)                                        | (0,05)               |
|            | 07.2025          | PEN                 | 47.676                | 12.938                        | 0                               | (488)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 716.826               | £ 522.774                     | 0                               | (443)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £                   | 522.774               | \$ 716.919                    | 432                             | 432                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 124 CAD               | 169                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 10.2025          | PEN                 | 51.314                | \$ 13.996                     | 0                               | (428)                                          | 0,00                 |
|            | 01.2026          | ¥                   | 9.710.000             | 64.847                        | 0                               | (3.741)                                        | (0,02)               |
|            | 07.2025          | ILS                 | 7.161                 | 1.996                         | 0                               | (131)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 1.195.823             | 8.262                         | 0                               | (17)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 1.612.959             | 1.190                         | 0                               | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 5.665                 | 558                           | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | RON                 | 2.720                 | 619                           | 0                               | (9)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 39.193                | 1.180                         | 0                               | (27)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.190 KRW             | 1.613.739                     | 3                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 595 SGD               | 764                           | 5                               | 5                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MXN                 | 454                   | \$ 23                         | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          | \$                  | 32.031 CAD            | 45.531                        | 1.451                           | 1.451                                          | 0,01                 |
|            | 12.2025          | €                   | 7.314 CZK             | 184.547                       | 130                             | 130                                            | 0,00                 |
|            | 12.2025          | TRY                 | 93.524                | \$ 1.992                      | 0                               | (47)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 698.135               | 450.147                       | 0                               | (7.377)                                        | (0,04)               |
|            | 07.2025          | €                   | 4.073.164             | 4.601.539                     | 0                               | (179.743)                                      | (1,06)               |
|            | 07.2025          | NZD                 | 27.854                | 16.612                        | 0                               | (297)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 4.753.871             | € 4.053.956                   | 4.864                           | 4.864                                          | 0,03                 |
|            | 07.2025          |                     | 162.300 ¥             | 23.372.782                    | 0                               | (489)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | €                   | 4.053.956             | \$ 4.764.249                  | 0                               | (4.867)                                        | (0,03)               |
|            | 08.2025          | ¥                   | 23.286.763            | 162.300                       | 488                             | 488                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 57.952                     | \$ (286.675)                    | \$ (228.723)                                   | (1,35)               |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD 25.608          | \$ 16.635             | \$ 0                          | \$ (147)                        | \$ (147)                                      | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 16.645           | AUD 25.608            | 148                           | 0                               | 148                                           | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | AUD 44              | \$ 29                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 718              | AUD 1.107             | 8                             | 0                               | 8                                             | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | 295                 | 454                   | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | AUD 492             | \$ 318                | 0                             | (4)                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 15.773           | AUD 24.475            | 266                           | 0                               | 266                                           | 0,01                 |
| CBK        | 07.2025          | AUD 21              | \$ 14                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 35               | AUD 54                | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | 15.031              | 23.342                | 266                           | 0                               | 266                                           | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | AUD 25.457          | \$ 16.644             | 0                             | (40)                            | (40)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 15.816           | AUD 24.514            | 249                           | 0                               | 249                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 16.654              | 25.457                | 40                            | 0                               | 40                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | AUD 44              | \$ 29                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 815              | AUD 1.259             | 10                            | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 990                        | \$ (191)                        | \$ 799                                        | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD 10.239          | \$ 7.506              | \$ 2                          | \$ 0                            | \$ 2                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 7.506            | CAD 10.222            | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | CAD 1.512           | \$ 1.107              | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 12.713           | CAD 17.503            | 114                           | 0                               | 114                                           | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 4                   | 5                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | 13.441              | 18.580                | 176                           | 0                               | 176                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD 51              | \$ 37                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | \$ 285              | CAD 389               | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CAD 18.285          | \$ 13.302             | 0                             | (98)                            | (98)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 13.409           | CAD 18.416            | 88                            | 0                               | 88                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 13.291              | 18.239                | 99                            | 0                               | 99                                            | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          | 4                   | 5                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | 26                  | 35                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | CAD 18.264          | \$ 13.382             | 0                             | (3)                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 13.382           | CAD 18.233            | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 482                        | \$ (104)                        | \$ 378                                        | 0,00                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF 218.416         | \$ 273.464            | \$ 0                          | \$ (928)                        | \$ (928)                                      | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$ 273.464          | CHF 217.512           | 928                           | 0                               | 928                                           | 0,01                 |
| BOA        | 07.2025          | CHF 20              | \$ 24                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 49               | CHF 40                | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | CHF 7.219           | \$ 8.849              | 0                             | (220)                           | (220)                                         | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | 1.838               | 2.259                 | 0                             | (51)                            | (51)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 238              | CHF 194               | 6                             | 0                               | 6                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | CHF 217.195         | \$ 271.300            | 0                             | (1.558)                         | (1.558)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 268.230          | CHF 220.880           | 9.258                         | 0                               | 9.258                                         | 0,05                 |
|            | 08.2025          | 271.300             | 216.301               | 1.564                         | 0                               | 1.564                                         | 0,01                 |
| JPM        | 07.2025          | 402                 | 329                   | 12                            | 0                               | 12                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CHF 823             | \$ 1.019              | 0                             | (15)                            | (15)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 268.024          | CHF 220.256           | 8.680                         | 0                               | 8.680                                         | 0,05                 |
| MYI        | 07.2025          | CHF 10.035          | \$ 12.275             | 0                             | (331)                           | (331)                                         | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          | \$ 259.536          | CHF 212.853           | 7.867                         | 0                               | 7.867                                         | 0,05                 |
| SCX        | 07.2025          | CHF 144             | \$ 176                | 0                             | (4)                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 28.316                     | \$ (3.107)                      | \$ 25.209                                     | 0,15                 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, Class E USD (Currency Exposure) thesaurierend, Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                 | 31.125                | \$                            | 20.219                          | \$                                            | 0                    |
|            | 07.2025          | CHF                 | 9                     | \$                            | 11                              | \$                                            | (179)                |
|            | 07.2025          | €                   | 63                    |                               | 74                              |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | NZD                 | 4.339                 |                               | 2.611                           |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | \$                  | 8                     | CAD                           | 11                              |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          |                     | 891                   | €                             | 784                             |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          | CAD                 | 11                    | \$                            | 8                               |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          | \$                  | 20.231                | AUD                           | 31.125                          |                                               | 180                  |
|            | 08.2025          |                     | 11                    | CHF                           | 9                               |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          |                     | 74                    | €                             | 63                              |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          |                     | 2.614                 | NZD                           | 4.339                           |                                               | 23                   |
|            | 07.2025          | CNY                 | 2.342                 | \$                            | 326                             |                                               | (1)                  |
| BOA        | 07.2025          | PEN                 | 2.407                 |                               | 668                             |                                               | (11)                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 179                   |                               | 140                             |                                               | (1)                  |
|            | 07.2025          | \$                  | 2.355                 | CAD                           | 3.194                           |                                               | (14)                 |
|            | 07.2025          |                     | 14.813                | CNY                           | 106.218                         |                                               | 14                   |
|            | 07.2025          |                     | 1.580                 | COP                           | 6.622.931                       |                                               | 41                   |
|            | 07.2025          |                     | 261.149               | €                             | 229.672                         |                                               | 8.452                |
|            | 07.2025          |                     | 1.048                 | KRW                           | 1.430.060                       |                                               | 10                   |
|            | 07.2025          |                     | 652                   | PEN                           | 2.407                           |                                               | 27                   |
|            | 08.2025          |                     | 667                   |                               | 2.407                           |                                               | 11                   |
|            | 08.2025          |                     | 140                   | SGD                           | 179                             |                                               | 1                    |
|            | 07.2025          | CNY                 | 5.909                 | \$                            | 825                             |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | €                   | 202                   |                               | 234                             |                                               | (3)                  |
| BPS        | 07.2025          | KRW                 | 36.205                |                               | 26                              |                                               | (1)                  |
|            | 07.2025          | \$                  | 880                   | €                             | 776                             |                                               | 30                   |
|            | 08.2025          |                     | 825                   | CNY                           | 5.892                           |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | CZK                 | 51                    | \$                            | 2                               |                                               | 0                    |
| BRC        | 07.2025          | £                   | 43.558                |                               | 59.266                          |                                               | (424)                |
|            | 07.2025          | NZD                 | 4                     |                               | 2                               |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.208                 | AUD                           | 1.854                           |                                               | 7                    |
|            | 07.2025          |                     | 35.481                | €                             | 31.217                          |                                               | 1.163                |
|            | 07.2025          |                     | 37                    | £                             | 27                              |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          |                     | 201                   | ¥                             | 28.864                          |                                               | (1)                  |
|            | 07.2025          |                     | 6.357                 | MYR                           | 26.805                          |                                               | 12                   |
|            | 07.2025          |                     | 108                   | NOK                           | 1.100                           |                                               | 1                    |
|            | 07.2025          |                     | 4.170                 | PLN                           | 15.638                          |                                               | 157                  |
|            | 08.2025          |                     | 59.274                | £                             | 43.558                          |                                               | 425                  |
|            | 07.2025          |                     | 1.771                 | DKK                           | 11.632                          |                                               | 59                   |
|            | 07.2025          | CLP                 | 637.901               | \$                            | 672                             |                                               | (12)                 |
| BSH<br>CBK | 07.2025          | CNY                 | 41.461                |                               | 5.790                           |                                               | 2                    |
|            | 07.2025          | €                   | 128                   |                               | 148                             |                                               | (3)                  |
|            | 07.2025          | £                   | 7                     |                               | 9                               |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | ¥                   | 65                    |                               | 0                               |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | NOK                 | 0                     |                               | 0                               |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | \$                  | 15                    | CAD                           | 21                              |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          |                     | 0                     | CHF                           | 0                               |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          |                     | 674                   | CLP                           | 637.901                         |                                               | 9                    |
|            | 07.2025          |                     | 276                   | CNH                           | 1.982                           |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          |                     | 123.679               | CNY                           | 886.650                         |                                               | 94                   |
|            | 07.2025          |                     | 1                     | DKK                           | 5                               |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          |                     | 4.304                 | €                             | 3.722                           |                                               | 65                   |
| DUB        | 07.2025          |                     | 2.748                 | £                             | 2.050                           |                                               | 62                   |
|            | 07.2025          |                     | 6.560                 | IDR                           | 107.041.135                     |                                               | 33                   |
|            | 07.2025          |                     | 16                    | SEK                           | 154                             |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          | CNY                 | 1.483                 | \$                            | 208                             |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          | \$                  | 672                   | CLP                           | 637.901                         |                                               | 12                   |
|            | 08.2025          |                     | 5.790                 | CNY                           | 41.357                          |                                               | 2                    |
|            | 07.2025          | DKK                 | 8.757                 | \$                            | 1.375                           |                                               | (3)                  |
|            | 07.2025          | €                   | 297.601               |                               | 345.246                         |                                               | (4.092)              |
|            | 07.2025          | \$                  | 14                    | SGD                           | 18                              |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          |                     | 1.375                 | DKK                           | 8.735                           |                                               | 3                    |
|            | 08.2025          |                     | 345.246               | €                             | 296.948                         |                                               | 4.087                |
|            | 07.2025          | CHF                 | 6.803                 | \$                            | 8.498                           |                                               | (49)                 |
| FAR        | 07.2025          | DKK                 | 11.902                |                               | 1.870                           |                                               | (2)                  |
|            | 07.2025          | ¥                   | 10.384.031            |                               | 71.338                          |                                               | (551)                |
|            | 07.2025          | SGD                 | 143                   |                               | 112                             |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | \$                  | 17.943                | AUD                           | 27.810                          |                                               | 282                  |
|            | 07.2025          |                     | 8.260                 | CHF                           | 6.802                           |                                               | 285                  |
|            | 07.2025          |                     | 111.004               | ¥                             | 15.924.437                      |                                               | (759)                |
|            | 07.2025          |                     | 5.913                 | SEK                           | 56.637                          |                                               | 30                   |
|            | 07.2025          |                     | 36                    | SGD                           | 47                              |                                               | 0                    |
|            | 08.2025          |                     | 8.498                 | CHF                           | 6.775                           |                                               | 49                   |
|            | 08.2025          |                     | 1.870                 | DKK                           | 11.872                          |                                               | 2                    |
|            | 08.2025          |                     | 71.338                | ¥                             | 10.345.843                      |                                               | 551                  |
|            | 08.2025          |                     | 112                   | SGD                           | 143                             |                                               | 0                    |
| GLM        | 07.2025          | SGD                 | 56                    | \$                            | 44                              |                                               | 0                    |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.818                 | CAD                           | 2.505                           |                                               | 18                   |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |      |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|------|
| IND        | 07.2025          | \$                  | 2.327                 | THB                           | 75.989                          | \$ 10                                          | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          |                     | 44                    | SGD                           | 55                              | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SEK                 | 56.863                | \$                            | 6.011                           | 44                                             | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | \$                  | 6.011                 | SEK                           | 56.741                          | (44)                                           | 0,00                 |      |
| JPM        | 07.2025          | IDR                 | 156.091               | \$                            | 10                              | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SGD                 | 117                   |                               | 92                              | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.365                 | DKK                           | 9.014                           | 53                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 2.590                 | NZD                           | 4.342                           | 46                                             | 0,00                 |      |
| MBC        | 07.2025          |                     | 960                   | SGD                           | 1.234                           | 8                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 37                    | TWD                           | 1.096                           | 1                                              | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          |                     | 92                    | SGD                           | 117                             | 1                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CAD                 | 53.600                | \$                            | 38.993                          | (289)                                          | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | COP                 | 6.622.931             |                               | 1.618                           | (4)                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CZK                 | 141                   |                               | 7                               | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | €                   | 36                    |                               | 41                              | (1)                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | PLN                 | 15.612                |                               | 4.322                           | 2                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SGD                 | 3.123                 |                               | 2.415                           | (37)                                           | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | THB                 | 75.989                |                               | 2.331                           | (7)                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 935                   | AUD                           | 1.461                           | 22                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 34.847                | CAD                           | 47.861                          | 229                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 12                    | CHF                           | 10                              | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 0                     | CNH                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 120                   | CNY                           | 858                             | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 36.710                | €                             | 31.814                          | 636                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 3.521                 | £                             | 2.592                           | 31                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 1.897                 | ILS                           | 6.668                           | 84                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 13.694                | ¥                             | 1.994.413                       | 140                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 15.539                | KRW                           | 21.323.651                      | 233                                            | 0,00                 |      |
| 07.2025    |                  | 2.310               | SGD                   | 2.963                         | 17                              | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    | CNY              | 855                 | \$                    | 120                           | 0                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    | \$               | 38.993              | CAD                   | 53.511                        | 290                             | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 1.610               | COP                   | 6.622.931                     | 4                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 7                   | CZK                   | 141                           | 0                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 4.322               | PLN                   | 15.622                        | (2)                             | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 2.415               | SGD                   | 3.116                         | 38                              | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 2.331               | THB                   | 75.869                        | 8                               | 0,00                                           |                      |      |
| MYI        | 07.2025          | ¥                   | 3.491.924             | \$                            | 23.958                          | (218)                                          | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | NOK                 | 10.407                |                               | 1.032                           | 3                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 2.182                 | CZK                           | 48.033                          | 99                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 0                     | HUF                           | 79                              | 0                                              | 0,00                 |      |
| 07.2025    |                  | 2.490               | ¥                     | 359.728                       | 0                               | 0,00                                           |                      |      |
| 07.2025    |                  | 4.876               | MXN                   | 94.924                        | 148                             | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 23.958              | ¥                     | 3.479.087                     | 218                             | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 1.032               | NOK                   | 10.405                        | 0                               | 0,00                                           |                      |      |
| 07.2025    | MYR              | 26.805              | \$                    | 6.328                         | (41)                            | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    | \$               | 6.339               | MYR                   | 26.805                        | 38                              | 0,00                                           |                      |      |
| 07.2025    |                  | 7.988               | ¥                     | 1.149.991                     | 0                               | 0,00                                           |                      |      |
| RYL SCX    | 07.2025          | CNY                 | 946.297               | \$                            | 132.129                         | 30                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | ¥                   | 38.900                |                               | 269                             | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | MXN                 | 94.924                |                               | 4.938                           | (87)                                           | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SGD                 | 622                   |                               | 482                             | (6)                                            | 0,00                 |      |
| 07.2025    | \$               | 3.915               | CNH                   | 28.063                        | 2                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 132.129             | CNY                   | 943.760                       | 33                              | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 269                 | ¥                     | 38.757                        | 0                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 4.908               | MXN                   | 94.706                        | 88                              | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 482                 | SGD                   | 621                           | 6                               | 0,00                                           |                      |      |
| SOG        | 07.2025          | ¥                   | 5.763.326             | \$                            | 39.926                          | 26                                             | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | NOK                 | 1.084                 |                               | 108                             | 1                                              | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          | \$                  | 39.926                | ¥                             | 5.742.177                       | (26)                                           | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          |                     | 108                   | NOK                           | 1.083                           | (1)                                            | 0,00                 |      |
| SSB        | 07.2025          | CNH                 | 1.531                 | \$                            | 214                             | 0                                              | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 52.693                | £                             | 38.916                          | 636                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          |                     | 813                   | KRW                           | 1.113.092                       | 11                                             | 0,00                 |      |
|            | 08.2025          |                     | 214                   | CNH                           | 1.527                           | 0                                              | 0,00                 |      |
| UAG        | 07.2025          | CNH                 | 28.515                | \$                            | 3.980                           | (1)                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | CZK                 | 47.755                |                               | 2.265                           | (3)                                            | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | IDR                 | 106.885.044           |                               | 6.561                           | (23)                                           | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | KRW                 | 23.830.598            |                               | 17.483                          | (143)                                          | 0,00                 |      |
| 07.2025    | \$               | 826                 | HUF                   | 294.273                       | 38                              | 0,00                                           |                      |      |
| 07.2025    |                  | 1.622               | ¥                     | 234.717                       | 3                               | 0,00                                           |                      |      |
| 07.2025    |                  | 1.023               | NOK                   | 10.391                        | 4                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 3.980               | CNH                   | 28.444                        | 1                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 2.265               | CZK                   | 47.706                        | 3                               | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 6.554               | IDR                   | 106.885.044                   | 26                              | 0,00                                           |                      |      |
| 08.2025    |                  | 17.514              | KRW                   | 23.830.598                    | 126                             | 0,00                                           |                      |      |
|            |                  |                     |                       |                               | \$ 19.667                       | \$ (7.118)                                     | \$ 12.549            | 0,07 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 934.386              | \$ 1.094.054             | \$ 0                             | \$ (2.775)                         | \$ (2.775)                                           | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$ 1.096.452           | € 934.386                | 2.770                            | 0                                  | 2.770                                                | 0,02                    |
| BOA        | 07.2025          | 1.214.099              | 1.067.763                | 39.294                           | 0                                  | 39.294                                               | 0,23                    |
| BPS        | 07.2025          | € 22.671               | \$ 25.771                | 0                                | (842)                              | (842)                                                | (0,01)                  |
| BRC        | 07.2025          | 17.893                 | 20.472                   | 0                                | (531)                              | (531)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1.207.805           | € 1.063.520              | 40.608                           | 0                                  | 40.608                                               | 0,24                    |
| CBK        | 07.2025          | € 53.357               | \$ 61.327                | 0                                | (1.306)                            | (1.306)                                              | (0,01)                  |
| DUB        | 07.2025          | 1.025.243              | 1.189.385                | 0                                | (14.096)                           | (14.096)                                             | (0,08)                  |
|            | 08.2025          | \$ 1.189.385           | € 1.022.996              | 14.078                           | 0                                  | 14.078                                               | 0,08                    |
| MBC        | 07.2025          | € 78.287               | \$ 90.654                | 0                                | (1.242)                            | (1.242)                                              | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 1.765               | € 1.523                  | 23                               | 0                                  | 23                                                   | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          | € 1.016.686            | \$ 1.192.217             | 0                                | (1.219)                            | (1.219)                                              | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 1.138.830           | € 1.008.063              | 44.483                           | 0                                  | 44.483                                               | 0,26                    |
|            | 08.2025          | 1.194.819              | 1.016.686                | 1.220                            | 0                                  | 1.220                                                | 0,01                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 142.476                       | \$ (22.011)                        | \$ 120.465                                           | 0,71                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 110.123              | \$ 151.110               | \$ 204                           | \$ 0                               | \$ 204                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 151.131             | £ 110.123                | 0                                | (203)                              | (203)                                                | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | £ 64                   | \$ 86                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | 121.005                | 164.616                  | 0                                | (1.202)                            | (1.202)                                              | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 155.410             | £ 115.096                | 2.313                            | (1)                                | 2.312                                                | 0,01                    |
|            | 08.2025          | 162.729                | 119.584                  | 1.166                            | 0                                  | 1.166                                                | 0,01                    |
| CBK        | 07.2025          | £ 478                  | \$ 640                   | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 799                 | £ 587                    | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | 158.794                | 117.871                  | 2.731                            | 0                                  | 2.731                                                | 0,02                    |
| MBC        | 07.2025          | £ 1.964                | \$ 2.663                 | 0                                | (29)                               | (29)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 2.442               | £ 1.801                  | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | £ 118.529              | \$ 162.527               | 100                              | 0                                  | 100                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 158.251             | £ 116.875                | 1.909                            | 0                                  | 1.909                                                | 0,01                    |
|            | 08.2025          | 162.548                | 118.529                  | 0                                | (98)                               | (98)                                                 | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | £ 68                   | \$ 92                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 8.455                         | \$ (1.550)                         | \$ 6.905                                             | 0,04                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend und Class W NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | \$ 24                  | NOK 243                  | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | NOK 2.623              | \$ 260                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 45                  | NOK 458                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | NOK 2.288              | \$ 231                   | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 82.942              | NOK 844.846              | 544                              | 0                                  | 544                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | NOK 6.802              | \$ 674                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.830               | NOK 39.040               | 28                               | 0                                  | 28                                                   | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | NOK 425                | \$ 42                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | 779.477                | 77.263                   | 240                              | (3)                                | 237                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 83.447              | NOK 848.471              | 396                              | 0                                  | 396                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 74.520                 | 751.550                  | 0                                | (240)                              | (240)                                                | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | NOK 49.784             | \$ 4.902                 | 9                                | (27)                               | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 564                 | NOK 5.671                | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | NOK 829.885            | \$ 82.657                | 650                              | 0                                  | 650                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          | \$ 82.657              | NOK 829.725              | 0                                | (650)                              | (650)                                                | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | 75.303                 | 764.709                  | 264                              | 0                                  | 264                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 2.138                         | \$ (924)                           | \$ 1.214                                             | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | NZD 33.130             | \$ 19.938                | \$ 0                             | \$ (173)                           | \$ (173)                                             | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1                   | NZD 2                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 19.875                 | 32.990                   | 173                              | 0                                  | 173                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | 19.323                 | 32.331                   | 303                              | 0                                  | 303                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | 19.412                 | 32.550                   | 347                              | 0                                  | 347                                                  | 0,01                    |
| MBC        | 07.2025          | NZD 574                | \$ 345                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 19.138              | NZD 32.073               | 331                              | 0                                  | 331                                                  | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| RYL        | 07.2025          | NZD                    | 15                       | \$                               | 9                                  | \$ 0                                                 | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          |                        | 529                      |                                  | 319                                | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 21                       | NZD                              | 35                                 | (2)                                                  | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | NZD                    | 32.931                   | \$                               | 19.989                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 20.011                   | NZD                              | 32.931                             | (2)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    | 2                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 1.156                              | \$ (180)                                             | \$ 976                  |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |      |     |      |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|------|-----|------|
| BPS        | 07.2025          | SEK                    | 491                      | \$                               | 51                                 | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 2                        | SEK                              | 21                                 | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
| BRC        | 07.2025          | SEK                    | 284                      | \$                               | 30                                 | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 25                       | SEK                              | 244                                | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
| CBK        | 07.2025          | SEK                    | 154.380                  | \$                               | 16.288                             | \$                                                   | 89                      | 0,00 |     |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 2                        | SEK                              | 16                                 | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
|            | 08.2025          |                        | 16.087                   |                                  | 152.143                            |                                                      | (89)                    | 0,00 |     |      |
| FAR        | 07.2025          |                        | 15.709                   |                                  | 150.466                            |                                                      | 79                      | 0,00 |     |      |
| IND        | 07.2025          | SEK                    | 151.645                  | \$                               | 16.029                             | \$                                                   | 118                     | 0,00 |     |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 16.029                   | SEK                              | 151.318                            |                                                      | (118)                   | 0,00 |     |      |
| MBC        | 07.2025          | SEK                    | 229                      | \$                               | 24                                 | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
| MYI        | 07.2025          | \$                     | 15.121                   | SEK                              | 145.317                            | \$                                                   | 127                     | 0,00 |     |      |
| RYL        | 07.2025          | SEK                    | 436                      | \$                               | 46                                 | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 0                        | SEK                              | 1                                  | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
| SCX        | 07.2025          | SEK                    | 29                       | \$                               | 3                                  | \$                                                   | 0                       | 0,00 |     |      |
| UAG        | 07.2025          | \$                     | 15.709                   | SEK                              | 150.946                            | \$                                                   | 129                     | 0,00 |     |      |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 542                                | \$                                                   | (207)                   | \$   | 335 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II und Class W SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD                    | 119.451                  | \$ 93.284                        | \$ 0                               | \$ (502)                                             | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 93.284                   | SGD 119.172                      | 517                                | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        | 456                      | 587                              | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | SGD                    | 2.233                    | \$ 1.739                         | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | \$                     | 116.703                  | SGD 150.342                      | 1.337                              | 0                                                    | 0,01                    |
| FAR        | 07.2025          | SGD                    | 262.164                  | \$ 205.556                       | 0                                  | (281)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 232.509                  | SGD 299.141                      | 2.360                              | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 205.556                  | 261.539                          | 304                                | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | SGD                    | 115.715                  | \$ 90.778                        | 0                                  | (75)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 90.778                   | SGD 115.437                      | 83                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | SGD                    | 120.620                  | \$ 94.205                        | 0                                  | (499)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 251.092                  | SGD 322.531                      | 2.142                              | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 94.205                   | 120.342                          | 517                                | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | SGD                    | 297.845                  | \$ 230.316                       | 0                                  | (3.535)                                              | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 185.093                  | SGD 237.452                      | 1.341                              | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 230.316                  | 297.161                          | 3.582                              | 0                                                    | 0,02                    |
| MYI        | 07.2025          |                        | 3.503                    | 4.495                            | 26                                 | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | SGD                    | 50.661                   | \$ 39.278                        | 0                                  | (498)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 39.278                   | SGD 50.546                       | 507                                | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          |                        | 5.402                    | 6.891                            | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 12.729                        | \$ (5.404)                         | \$ 7.325                                             | 0,04                    |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (60.444) (0,36)

| BESCHREIBUNG                               | PARI (000S)  | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|--------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |              |                          |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 1.200.000 | \$ 144                   | 0,00                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |              | \$ 144                   | 0,00                         |

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                 |         |           |        |
|---------------------------------------|---------|-----------|--------|
| Ginnie Mae, TBA                       |         |           |        |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055          | 7.500   | (6.975)   | (0,04) |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |         |           |        |
| 2,000 % fällig am 01.07.2040          | 276.200 | (252.454) | (1,49) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055          | 678.576 | (537.335) | (3,17) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2055          | 354.474 | (280.803) | (1,66) |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                           | PARI (000\$) | MARKT-WERT (000\$)    | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|----------------------------------------|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 3,500 % fällig am 01.08.2055           | \$ 4.200     | \$ (3.781)            | (0,02)                |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055           | 77.900       | (77.830)              | (0,46)                |
| 6,500 % fällig am 01.07.2055 (f)       | 156.635      | (161.746)             | (0,96)                |
| <b>Summe Leerverkaufte Wertpapiere</b> |              | <b>\$ (1.320.924)</b> | <b>(7,80)</b>         |
| <b>Summe Anlagen</b>                   |              | <b>\$ 22.201.382</b>  | <b>131,06</b>         |
| <b>Sonstige Aktiva und Passiva</b>     |              | <b>\$ (5.262.074)</b> | <b>(31,06)</b>        |
| <b>Nettovermögen</b>                   |              | <b>\$ 16.939.308</b>  | <b>100,00</b>         |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Ein zum 30. Juni 2025 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,02 %):

| Emittentenbeschreibung           | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum  | Kosten          | Marktwert       | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|---------|------------------|------------|-----------------|-----------------|----------------------|
| Pantheon Senior Debt Secondaries | 6,317 % | 26.03.2026       | 18.03.2025 | \$ 5.300        | \$ 5.300        | 0,03                 |
| Project Alfa                     | 4,256   | 27.02.2026       | 28.02.2025 | 3.440           | 3.883           | 0,02                 |
|                                  |         |                  |            | <b>\$ 8.740</b> | <b>\$ 9.183</b> | <b>0,05</b>          |

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 92.288 USD (31. Dezember 2024: 255.170 USD) und Barmittel in Höhe von 29 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 425 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 453.998 USD (31. Dezember 2024: 415.013 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 168.820 USD (31. Dezember 2024: 48.100 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert            |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 21.939.542                                                   | \$ 118.973                                                   | \$ 22.058.515        |
| Investmentfonds                     | 1.481.556                                                                   | 0                                                               | 0                                                            | 1.481.556            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 8.139                                                                       | (26.048)                                                        | 0                                                            | (17.909)             |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 144                                                             | 0                                                            | 144                  |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (1.320.924)                                                     | 0                                                            | (1.320.924)          |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 1.489.695</b>                                                         | <b>\$ 20.592.714</b>                                            | <b>\$ 118.973</b>                                            | <b>\$ 22.201.382</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert            |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 17.960.328                                                   | \$ 81.313                                                    | \$ 18.041.641        |
| Investmentfonds                     | 360.869                                                                     | 788.957                                                         | 0                                                            | 1.149.826            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 10.947                                                                      | 31.941                                                          | 0                                                            | 42.888               |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 150                                                             | 0                                                            | 150                  |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (3.956.448)                                                     | 0                                                            | (3.956.448)          |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 371.816</b>                                                           | <b>\$ 14.824.928</b>                                            | <b>\$ 81.313</b>                                             | <b>\$ 15.278.057</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BOS                                | 4,250 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (18.777)  | \$ (18.795)                              | (0,11)               |
|                                    | 4,300      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (5.282)      | (5.287)                                  | (0,03)               |
| BRC                                | 1,000      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (625)      | (734)                                    | (0,01)               |
|                                    | 1,300      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (520)        | (611)                                    | 0,00                 |
|                                    | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (10.040)     | (11.795)                                 | (0,07)               |
|                                    | 4,150      | 13.03.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (13.574)  | (13.746)                                 | (0,08)               |
|                                    | 4,300      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.959)      | (2.005)                                  | (0,01)               |
|                                    | 4,400      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | (4.851)      | (4.965)                                  | (0,03)               |
| JML                                | 1,000      | 20.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (4.616)    | (5.420)                                  | (0,03)               |
|                                    | 3,500      | 01.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (4.970)   | (4.999)                                  | (0,03)               |
| MEI                                | 1,500      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (3.806)      | (3.808)                                  | (0,02)               |
|                                    | 3,850      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (2.569)      | (2.571)                                  | (0,02)               |
| MYI                                | 1,250      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (8.978)    | (10.546)                                 | (0,06)               |
|                                    | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.085)      | (1.275)                                  | (0,01)               |
| RCE                                | 2,250      | 20.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (399)     | (400)                                    | 0,00                 |
| SCX                                | 4,250      | 07.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (2.814)      | (2.842)                                  | (0,02)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (89.799)                              | (0,53)               |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (256)                         | \$ 310                             | \$ 54                           | \$ (2.909)                       | \$ 2.390                           | \$ (519)                        |
| BOA        | 47.694                           | (45.350)                           | 2.344                           | 6.983                            | (6.470)                            | 513                             |
| BPS        | 613                              | 560                                | 1.173                           | 15.523                           | (14.490)                           | 1.033                           |
| BRC        | 45.934                           | (42.970)                           | 2.964                           | 29.890                           | (25.060)                           | 4.830                           |
| BSH        | (1.906)                          | 1.310                              | (596)                           | 39                               | 110                                | 149                             |
| CBK        | (18.238)                         | 13.210                             | (5.028)                         | 22.555                           | (10.810)                           | 11.745                          |
| DUB        | 1.068                            | (740)                              | 328                             | 54.679                           | (49.350)                           | 5.329                           |
| FAR        | 17.765                           | (16.150)                           | 1.615                           | (1.940)                          | 1.710                              | (230)                           |
| GLM        | 722                              | (950)                              | (228)                           | 7.781                            | (7.290)                            | 491                             |
| GST        | (8.444)                          | (260)                              | (8.704)                         | 10.665                           | 550                                | 11.215                          |
| IND        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | 1.397                            | (1.200)                            | 197                             |
| JPM        | 3.852                            | (2.700)                            | 1.152                           | 7.843                            | (7.610)                            | 233                             |
| MBC        | (376)                            | 1.290                              | 914                             | (14.772)                         | 10.340                             | (4.432)                         |
| MYC        | (1.158)                          | 930                                | (228)                           | (706)                            | 930                                | 224                             |
| MYI        | (3.978)                          | 3.330                              | (648)                           | 105                              | 90                                 | 195                             |
| RBC        | 7.862                            | (6.460)                            | 1.402                           | (1)                              | 0                                  | (1)                             |
| RYL        | 30                               | 0                                  | 30                              | 910                              | (450)                              | 460                             |
| SCX        | (91)                             | 80                                 | (11)                            | (26.024)                         | 23.000                             | (3.024)                         |
| SOG        | (201)                            | 260                                | 59                              | (180)                            | 0                                  | (180)                           |
| SSB        | (9.712)                          | 9.910                              | 198                             | 1.564                            | (1.140)                            | 424                             |
| TOR        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | (8.646)                          | 7.800                              | (846)                           |
| UAG        | 1.313                            | (1.710)                            | (397)                           | (1.553)                          | 1.180                              | (373)                           |
| WST        | (142.937)                        | 131.630                            | (11.307)                        | 12.758                           | (12.720)                           | 38                              |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 35,17             | 24,01             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 22,67             | 26,95             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,57              | 0,02              |
| Investmentfonds                                                        | 3,92              | 3,28              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,22              | 0,11              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,44              | 0,24              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,75              | 0,72              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,00              | 0,00              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 36,26             | 44,67             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                                                             | 2,87              | 1,78              |
| Belgien                                                                                | 0,19              | 0,18              |
| Kanada                                                                                 | 5,71              | 5,77              |
| Kaimaninseln                                                                           | 2,09              | 1,69              |
| Chile                                                                                  | 0,08              | 0,08              |
| China                                                                                  | 0,06              | 0,07              |
| Tschechische Republik                                                                  | 0,00              | 0,00              |
| Dänemark                                                                               | 0,70              | 2,54              |
| Ägypten                                                                                | 0,20              | k. A.             |
| Finnland                                                                               | k. A.             | 0,01              |
| Frankreich                                                                             | 7,20              | 2,74              |
| Deutschland                                                                            | 0,40              | 0,55              |
| Ungarn                                                                                 | 0,55              | 0,42              |
| Indonesien                                                                             | 0,10              | k. A.             |
| International                                                                          | 0,18              | 0,17              |
| Irland                                                                                 | 3,10              | 3,35              |
| Israel                                                                                 | 1,10              | 1,23              |
| Italien                                                                                | 1,02              | 1,16              |
| Japan                                                                                  | 7,43              | 4,91              |
| Jersey, Kanalinselfn                                                                   | k. A.             | 0,02              |
| Luxemburg                                                                              | 0,14              | 0,13              |
| Malaysia                                                                               | 0,95              | 1,10              |
| Mexiko                                                                                 | 0,15              | 0,04              |
| Multinational                                                                          | 0,05              | 0,06              |
| Niederlande                                                                            | 1,07              | 0,93              |
| Neuseeland                                                                             | 0,10              | 0,09              |
| Nigeria                                                                                | 0,09              | 0,08              |
| Norwegen                                                                               | 0,30              | 0,34              |
| Peru                                                                                   | 0,88              | 0,89              |
| Polen                                                                                  | 0,54              | 0,36              |
| Portugal                                                                               | 0,01              | 0,02              |
| Katar                                                                                  | 0,07              | 0,08              |
| Rumänien                                                                               | 1,21              | 1,01              |
| Saudi-Arabien                                                                          | 1,37              | 0,82              |
| Singapur                                                                               | 1,15              | 0,85              |
| Slowakei                                                                               | 0,09              | k. A.             |
| Südafrika                                                                              | 0,77              | 0,78              |
| Südkorea                                                                               | 1,64              | 2,02              |
| Spanien                                                                                | 4,66              | 0,71              |
| Supranational                                                                          | 0,25              | 0,39              |
| Schweiz                                                                                | 1,29              | 1,36              |
| Thailand                                                                               | 0,64              | 0,69              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 0,13              | 0,04              |
| Großbritannien                                                                         | 7,61              | 6,05              |
| USA                                                                                    | 71,14             | 67,89             |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,94              | 0,75              |
| Investmentfonds                                                                        | 8,75              | 7,28              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,37              | 0,11              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | (0,02)            | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,11              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,21)            | (0,57)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,02              | 0,04              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | 0,07              |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | k. A.             | 0,08              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,01)            | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,11)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | (0,01)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,00              |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | (0,05)            | 0,19              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (1,35)            | 1,25              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,04              | (0,77)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,00              | 0,00              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (7,80)            | (25,03)           |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (31,06)           | 3,33              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |



| Beschreibung                              | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung | Pari<br>(000S)                         | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                         | Pari<br>(000S)                   | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |          |        |      |      |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------|----------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|----------|--------|------|------|
| Übertragbare Wertpapiere                  |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| Kreditbeteiligungen und -abtretung        |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| Republic of Panama                        |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | Nordea Kredit Realkreditaktieselskab |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 4,804 % fällig am 01.04.2027              | €              | 7.400                    | \$ 8.727                          | 0,22         | Doctors Co. An Interinsurance Exchange |                          |                                   |                                      | 1,215 % fällig am 30.04.2029     | € 1.800                  | \$ 2.015                          | 0,05     |        |      |      |
| Unternehmensanleihen und Wechsel          |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| Banken und Finanzen                       |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| ABN AMRO Bank NV                          |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 3,000 % fällig am 25.02.2031              |                | 7.400                    | 8.744                             | 0,21         | EQT AB                                 |                          |                                   |                                      | 1,000 % fällig am 01.10.2050     | DKK                      | 0                                 | 0        | 0,00   |      |      |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC  |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 2,375 % fällig am 06.04.2028         |                                  |                          |                                   | € 5.000  | 5.826  | 0,14 |      |
| 4,500 % fällig am 06.05.2030              | \$             | 800                      | 799                               | 0,02         | Equinix Europe Financing Corp. LLC     |                          |                                   |                                      | 3,250 % fällig am 19.05.2029     | 7.000                    | 8.272                             | 0,20     |        |      |      |
| 5,000 % fällig am 06.05.2035              |                | 2.200                    | 2.199                             | 0,05         | Europäische Investitionsbank           |                          |                                   |                                      | 0,750 % fällig am 15.07.2027     | AUD                      | 5.000                             | 3.101    | 0,08   |      |      |
| American Tower Corp.                      |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 3,300 % fällig am 03.02.2028         |                                  |                          |                                   | 1.000    | 652    | 0,02 |      |
| 0,875 % fällig am 21.05.2029              | €              | 2.100                    | 2.285                             | 0,06         | GA Global Funding Trust                |                          |                                   |                                      | 5,500 % fällig am 08.01.2029     | \$ 3.900                 | 3.999                             | 0,10     |        |      |      |
| 3,900 % fällig am 16.05.2030              |                | 2.700                    | 3.281                             | 0,08         | Goldman Sachs Group, Inc.              |                          |                                   |                                      | 2,650 % fällig am 21.10.2032 (e) | 21.300                   | 18.827                            | 0,46     |        |      |      |
| 5,450 % fällig am 15.02.2034              | \$             | 5.000                    | 5.151                             | 0,13         | 5,016 % fällig am 23.10.2035 (e)       |                          |                                   |                                      | 13.000                           | 12.848                   | 0,32                              |          |        |      |      |
| Aviation Capital Group LLC                |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 5,536 % fällig am 28.01.2036 (e)     |                                  |                          |                                   | 5.600    | 5.745  | 0,14 |      |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025              |                | 1.000                    | 999                               | 0,02         | HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH     |                          |                                   |                                      | 3,875 % fällig am 05.06.2030     | € 4.400                  | 5.309                             | 0,13     |        |      |      |
| Bank of America Corp.                     |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | HSBC Holdings PLC                    |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 2,687 % fällig am 22.04.2032              |                | 2.000                    | 1.795                             | 0,04         | 4,856 % fällig am 23.05.2033           |                          |                                   |                                      | 13.300                           | 16.883                   | 0,41                              |          |        |      |      |
| 3,036 % fällig am 22.09.2026              | €              | 8.000                    | 9.411                             | 0,23         | IHG Finance LLC                        |                          |                                   |                                      | 3,625 % fällig am 27.09.2031     | 14.600                   | 17.213                            | 0,42     |        |      |      |
| 5,015 % fällig am 22.07.2033              | \$             | 6.000                    | 6.072                             | 0,15         | 4,375 % fällig am 28.11.2029           |                          |                                   |                                      | 6.400                            | 7.880                    | 0,19                              |          |        |      |      |
| 5,288 % fällig am 25.04.2034              |                | 13.100                   | 13.367                            | 0,33         | ING Belgium S.A.                       |                          |                                   |                                      | 3,000 % fällig am 15.02.2031     | 6.600                    | 7.861                             | 0,19     |        |      |      |
| 5,511 % fällig am 24.01.2036              |                | 5.800                    | 5.966                             | 0,15         | ING Groep NV                           |                          |                                   |                                      | 5,335 % fällig am 19.03.2030     | \$ 6.200                 | 6.359                             | 0,16     |        |      |      |
| Bank of Nova Scotia                       |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 5,550 % fällig am 19.03.2035         |                                  |                          |                                   | 8.900    | 9.117  | 0,22 |      |
| 0,010 % fällig am 14.09.2029              | €              | 9.900                    | 10.465                            | 0,26         | Inter-American Development Bank        |                          |                                   |                                      | 2,500 % fällig am 14.04.2027     | AUD                      | 600                               | 387      | 0,01   |      |      |
| 3,500 % fällig am 17.04.2029              |                | 12.600                   | 15.095                            | 0,37         | Intesa Sanpaolo SpA                    |                          |                                   |                                      | 3,625 % fällig am 16.10.2030     | € 4.100                  | 4.955                             | 0,12     |        |      |      |
| Banque Federative du Credit Mutuel S.A.   |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | JAB Holdings BV                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 5,896 % fällig am 13.07.2026              | \$             | 7.700                    | 7.818                             | 0,19         | 5,000 % fällig am 12.06.2033           |                          |                                   |                                      | 6.600                            | 8.265                    | 0,20                              |          |        |      |      |
| Barclays PLC                              |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | JPMorgan Chase & Co.                 |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 4,347 % fällig am 08.05.2035              | €              | 4.600                    | 5.605                             | 0,14         | 3,588 % fällig am 23.01.2036           |                          |                                   |                                      | 5.000                            | 5.844                    | 0,14                              |          |        |      |      |
| 5,335 % fällig am 10.09.2035              | \$             | 4.100                    | 4.071                             | 0,10         | 3,761 % fällig am 21.03.2034           |                          |                                   |                                      | 8.050                            | 9.643                    | 0,24                              |          |        |      |      |
| 6,224 % fällig am 09.05.2034              |                | 6.000                    | 6.370                             | 0,16         | 4,565 % fällig am 14.06.2030           |                          |                                   |                                      | \$ 5.100                         | 5.123                    | 0,13                              |          |        |      |      |
| 6,692 % fällig am 13.09.2034              |                | 700                      | 764                               | 0,02         | 5,350 % fällig am 01.06.2034           |                          |                                   |                                      | 5.300                            | 5.455                    | 0,13                              |          |        |      |      |
| BlueHub Loan Fund, Inc.                   |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 5,502 % fällig am 24.01.2036         |                                  |                          |                                   | 8.800    | 9.068  | 0,22 |      |
| 2,890 % fällig am 01.01.2027              |                | 900                      | 873                               | 0,02         | 5,581 % fällig am 22.04.2030           |                          |                                   |                                      | 6.900                            | 7.166                    | 0,18                              |          |        |      |      |
| 3,099 % fällig am 01.01.2030              |                | 1.900                    | 1.710                             | 0,04         | Jyske Realkredit A/S                   |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| BNP Paribas S.A.                          |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 1,000 % fällig am 01.10.2050         |                                  |                          |                                   | DKK      | 0      | 0    | 0,00 |
| 5,786 % fällig am 13.01.2033              |                | 3.500                    | 3.643                             | 0,09         | 1,500 % fällig am 01.07.2050           |                          |                                   |                                      |                                  | 0                        | 0                                 | 0,00     |        |      |      |
| BPCE S.A.                                 |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 1,500 % fällig am 01.10.2050         |                                  |                          |                                   |          | 0      | 0    | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 11.01.2029              | €              | 5.400                    | 6.541                             | 0,16         | 1,500 % fällig am 01.10.2053           |                          |                                   |                                      | 17.703                           | 2.265                    | 0,06                              |          |        |      |      |
| 5,748 % fällig am 19.07.2033              | \$             | 6.100                    | 6.256                             | 0,15         | 2,000 % fällig am 01.10.2047           |                          |                                   |                                      | 0                                | 0                        | 0,00                              |          |        |      |      |
| Brookfield Finance, Inc.                  |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | KEB Hana Bank                        |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 2,724 % fällig am 15.04.2031              |                | 3.350                    | 3.031                             | 0,07         | 3,750 % fällig am 04.05.2026           |                          |                                   |                                      | € 16.200                         | 19.261                   | 0,47                              |          |        |      |      |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A. |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | Kookmin Bank                         |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 2,750 % fällig am 06.09.2030              | €              | 11.300                   | 13.320                            | 0,33         | 0,052 % fällig am 15.07.2025           |                          |                                   |                                      | 2.100                            | 2.463                    | 0,06                              |          |        |      |      |
| 2,875 % fällig am 25.03.2031              |                | 9.700                    | 11.452                            | 0,28         | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 3,000 % fällig am 12.01.2034              |                | 13.000                   | 15.104                            | 0,37         | 0,010 % fällig am 05.05.2027           |                          |                                   |                                      | 16.000                           | 18.127                   | 0,44                              |          |        |      |      |
| CaixaBank S.A.                            |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | Landwirtschaftliche Rentenbank       |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 4,125 % fällig am 09.02.2032              |                | 4.400                    | 5.383                             | 0,13         | 2,500 % fällig am 11.05.2032           |                          |                                   |                                      | 10.600                           | 12.337                   | 0,30                              |          |        |      |      |
| Canadian Imperial Bank of Commerce        |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | Lloyds Banking Group PLC             |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 2,625 % fällig am 01.10.2029              |                | 16.300                   | 19.205                            | 0,47         | 3,875 % fällig am 14.05.2032           |                          |                                   |                                      | 4.200                            | 5.067                    | 0,12                              |          |        |      |      |
| CBRE Services, Inc.                       |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 5,679 % fällig am 05.01.2035         |                                  |                          |                                   | \$ 4.600 | 4.724  | 0,12 |      |
| 5,950 % fällig am 15.08.2034              | \$             | 4.400                    | 4.635                             | 0,11         | 5,721 % fällig am 05.06.2030           |                          |                                   |                                      | 7.300                            | 7.584                    | 0,19                              |          |        |      |      |
| Cie de Financement Foncier S.A.           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | Low Income Investment Fund           |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 3,000 % fällig am 24.04.2032              | €              | 7.200                    | 8.472                             | 0,21         | 3,386 % fällig am 01.07.2026           |                          |                                   |                                      | 750                              | 736                      | 0,02                              |          |        |      |      |
| 3,125 % fällig am 06.06.2030              |                | 6.000                    | 7.196                             | 0,18         | 3,711 % fällig am 01.07.2029           |                          |                                   |                                      | 1.950                            | 1.834                    | 0,05                              |          |        |      |      |
| Citigroup, Inc.                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | MDGH GMTN RSC Ltd.                   |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 3,668 % fällig am 24.07.2028              | \$             | 12.000                   | 11.815                            | 0,29         | 5,500 % fällig am 28.04.2033           |                          |                                   |                                      | 1.400                            | 1.458                    | 0,04                              |          |        |      |      |
| 4,542 % fällig am 19.09.2030              |                | 8.700                    | 8.662                             | 0,21         | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.   |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| Community Preservation Corp.              |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 5,426 % fällig am 17.04.2035         |                                  |                          |                                   | 5.200    | 5.313  | 0,13 |      |
| 2,867 % fällig am 01.02.2030              |                | 3.300                    | 3.036                             | 0,07         | Morgan Stanley                         |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| Cooperative Rabobank UA                   |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 3,622 % fällig am 01.04.2031         |                                  |                          |                                   | 14.700   | 14.100 | 0,35 |      |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033              |                | 1.600                    | 1.494                             | 0,04         | 3,790 % fällig am 21.03.2030           |                          |                                   |                                      | € 6.200                          | 7.497                    | 0,18                              |          |        |      |      |
| 4,875 % fällig am 01.11.2030              | £              | 15.000                   | 20.721                            | 0,51         | 3,955 % fällig am 21.03.2035           |                          |                                   |                                      | 15.500                           | 18.620                   | 0,46                              |          |        |      |      |
| Coventry Building Society                 |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 5,656 % fällig am 18.04.2030         |                                  |                          |                                   | \$ 5.100 | 5.298  | 0,13 |      |
| 0,010 % fällig am 07.07.2028              | €              | 600                      | 655                               | 0,02         | National Australia Bank Ltd.           |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 2,625 % fällig am 01.10.2029              |                | 4.200                    | 4.939                             | 0,12         | 3,146 % fällig am 05.02.2031           |                          |                                   |                                      | € 11.000                         | 13.168                   | 0,32                              |          |        |      |      |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.        |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | Nationwide Building Society          |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 3,000 % fällig am 01.12.2030              |                | 5.700                    | 6.793                             | 0,17         | 3,000 % fällig am 24.03.2032           |                          |                                   |                                      | 5.300                            | 6.259                    | 0,15                              |          |        |      |      |
| CTP NV                                    |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   | 4,302 % fällig am 08.03.2029         |                                  |                          |                                   | \$ 300   | 298    | 0,01 |      |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026              |                | 244                      | 279                               | 0,01         |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026              |                | 483                      | 562                               | 0,01         |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| Deutsche Bank AG                          |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 1,375 % fällig am 17.02.2032              |                | 1.800                    | 1.889                             | 0,05         |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030              |                | 1.900                    | 2.093                             | 0,05         |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |
|                                           |                |                          |                                   |              |                                        |                          |                                   |                                      |                                  |                          |                                   |          |        |      |      |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Becton Dickinson & Co.<br>4,874 % fällig am 08.02.2029                 | \$ 4.400       | \$ 4.464                 | 0,11                              | Eurogrid GmbH<br>3,598 % fällig am 01.02.2029                        | € 3.300        | \$ 3.982                 | 0,10                              | 6,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055             | \$ 552.424     | \$ 569.641               | 13,96                             |
| Broadcom, Inc.<br>3,137 % fällig am 15.11.2035 (e)                     | 4.100          | 3.460                    | 0,09                              | Hanwha Energy USA Holdings Corp.<br>4,375 % fällig am 02.07.2028 (a) | \$ 24.500      | 24.616                   | 0,60                              |                                                          |                | 2.219.509                | 54,40                             |
| 3,419 % fällig am 15.04.2033                                           | 800            | 726                      | 0,02                              | National Grid PLC<br>4,275 % fällig am 16.01.2035                    | € 8.730        | 10.680                   | 0,26                              | <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034                                           | 11.000         | 9.830                    | 0,24                              | 5,809 % fällig am 12.06.2033                                         | \$ 3.800       | 3.996                    | 0,10                              | <b>U.S. Treasury Bonds</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,800 % fällig am 15.10.2034                                           | 7.000          | 6.919                    | 0,17                              | New York State Electric & Gas Corp.<br>5,650 % fällig am 15.08.2028  | 4.000          | 4.148                    | 0,10                              | 1,875 % fällig am 15.02.2041 (f)                         | 42.500         | 29.245                   | 0,72                              |
| 4,926 % fällig am 15.05.2037                                           | 10.600         | 10.293                   | 0,25                              | Pacific Gas & Electric Co.<br>5,800 % fällig am 15.05.2034           | 4.700          | 4.702                    | 0,11                              | 2,250 % fällig am 15.08.2049                             | 5.875          | 3.687                    | 0,09                              |
| Burberry Group PLC<br>5,750 % fällig am 20.06.2030                     | £ 8.800        | 12.073                   | 0,30                              | 6,700 % fällig am 01.04.2053                                         | 8.000          | 8.031                    | 0,20                              | 2,375 % fällig am 15.11.2049                             | 14.075         | 9.057                    | 0,22                              |
| Continental Wind LLC<br>6,000 % fällig am 28.02.2033                   | \$ 1.377       | 1.417                    | 0,03                              | Seymour Trent Utilities Finance PLC<br>3,875 % fällig am 04.08.2035  | € 3.300        | 3.901                    | 0,10                              | 2,875 % fällig am 15.05.2052                             | 3.700          | 2.605                    | 0,06                              |
| Elevance Health, Inc.<br>5,375 % fällig am 15.06.2034                  | 5.200          | 5.317                    | 0,13                              | Southern California Edison Co.<br>5,450 % fällig am 01.03.2035       | \$ 7.700       | 7.563                    | 0,19                              | 3,000 % fällig am 15.02.2048                             | 8.500          | 6.318                    | 0,15                              |
| Eli Lilly & Co.<br>4,600 % fällig am 14.08.2034                        | 10.200         | 10.111                   | 0,25                              | Stedin Holding NV<br>3,625 % fällig am 20.06.2031                    | € 6.200        | 7.510                    | 0,18                              | 3,000 % fällig am 15.08.2048                             | 13.150         | 9.730                    | 0,24                              |
| Gatwick Funding Ltd.<br>3,625 % fällig am 16.10.2035                   | € 5.200        | 6.076                    | 0,15                              | United Utilities Water Finance PLC<br>3,500 % fällig am 27.02.2033   | 14.900         | 17.385                   | 0,43                              | 3,000 % fällig am 15.02.2049                             | 6.325          | 4.662                    | 0,11                              |
| 3,875 % fällig am 24.06.2035                                           | 8.800          | 10.258                   | 0,25                              |                                                                      |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 15.11.2048                             | 20.900         | 16.540                   | 0,41                              |
| Haleon UK Capital PLC<br>4,625 % fällig am 18.09.2033                  | £ 4.100        | 5.444                    | 0,13                              |                                                                      |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am<br>15.08.2044 (e)(f)                   | 82.600         | 75.698                   | 1,86                              |
| Hanwha Q Cells Americas Holdings Corp.<br>5,000 % fällig am 27.07.2028 | \$ 6.500       | 6.620                    | 0,16                              |                                                                      |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.11.2054 (e)                         | 140.000        | 133.459                  | 3,27                              |
| HCA, Inc.<br>5,600 % fällig am 01.04.2034                              | 9.500          | 9.724                    | 0,24                              |                                                                      |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.02.2055 (e)                         | 51.900         | 50.538                   | 1,24                              |
| 5,750 % fällig am 01.03.2035                                           | 4.000          | 4.116                    | 0,10                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)</b>  |                |                          |                                   |
| Informa PLC<br>3,250 % fällig am 23.10.2030                            | € 5.600        | 6.557                    | 0,16                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.10.2025                             | 5.439          | 5.421                    | 0,13                              |
| IQVIA, Inc.<br>6,250 % fällig am 01.02.2029                            | \$ 4.400       | 4.602                    | 0,11                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.07.2031                             | 22.619         | 20.823                   | 0,51                              |
| Keurig Dr Pepper, Inc.<br>5,050 % fällig am 15.03.2029                 | 4.300          | 4.398                    | 0,11                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.01.2032                             | 29.276         | 26.546                   | 0,65                              |
| Kraft Heinz Foods Co.<br>3,500 % fällig am 15.03.2029                  | € 1.400        | 1.677                    | 0,04                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 15.01.2028                             | 11.053         | 10.849                   | 0,27                              |
| Micron Technology, Inc.<br>5,800 % fällig am 15.01.2035                | \$ 7.400       | 7.656                    | 0,19                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.07.2032                             | 1.656          | 1.545                    | 0,04                              |
| Motability Operations Group PLC<br>3,625 % fällig am 22.01.2033        | € 4.900        | 5.773                    | 0,14                              |                                                                      |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 15.01.2033                             | 36.720         | 35.105                   | 0,86                              |
| 3,875 % fällig am 24.01.2034                                           | 4.600          | 5.487                    | 0,13                              |                                                                      |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 15.01.2029                             | 4.407          | 4.587                    | 0,11                              |
| 4,000 % fällig am 17.01.2030                                           | 2.600          | 3.177                    | 0,08                              |                                                                      |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.04.2029                             | 780            | 852                      | 0,02                              |
| 4,250 % fällig am 17.06.2035                                           | 3.600          | 4.375                    | 0,11                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Notes</b>                               |                |                          |                                   |
| Norsk Hydro ASA<br>3,625 % fällig am 23.01.2032                        | 1.300          | 1.535                    | 0,04                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,375 % fällig am 30.09.2027                             | 2.900          | 2.693                    | 0,07                              |
| NXP BV<br>3,400 % fällig am 01.05.2030                                 | \$ 5.600       | 5.302                    | 0,13                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 30.11.2027                             | 12.800         | 11.901                   | 0,29                              |
| Oracle Corp.<br>4,900 % fällig am<br>06.02.2033 (e)                    | 11.900         | 11.936                   | 0,29                              |                                                                      |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 31.01.2028                             | 11.700         | 10.857                   | 0,27                              |
| RELX Capital, Inc.<br>5,250 % fällig am 27.03.2035                     | 9.900          | 10.134                   | 0,25                              |                                                                      |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.02.2034                             | 7.200          | 7.127                    | 0,17                              |
| Sandoz Finance BV<br>4,000 % fällig am 26.03.2035                      | € 6.800        | 8.143                    | 0,20                              |                                                                      |                |                          |                                   |                                                          |                | 479.845                  | 11,76                             |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV<br>3,375 % fällig am 22.02.2037   | 3.700          | 4.265                    | 0,10                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                    |                |                          |                                   |
| Stryker Corp.<br>3,625 % fällig am 11.09.2036                          | 13.500         | 15.788                   | 0,39                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>American Home Mortgage Assets Trust</b>               |                |                          |                                   |
| Synopsys, Inc.<br>4,850 % fällig am 01.04.2030                         | \$ 3.900       | 3.955                    | 0,10                              |                                                                      |                |                          |                                   | 4,624 % fällig am 25.10.2046                             | 957            | 484                      | 0,01                              |
| T-Mobile USA, Inc.<br>4,700 % fällig am 15.01.2035                     | 7.800          | 7.560                    | 0,19                              |                                                                      |                |                          |                                   | 5,339 % fällig am 25.10.2046                             | 73             | 47                       | 0,00                              |
| 5,050 % fällig am 15.07.2033                                           | 7.600          | 7.655                    | 0,19                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>American Home Mortgage Investment Trust</b>           |                |                          |                                   |
| UnitedHealth Group, Inc.<br>4,500 % fällig am 15.04.2033               | 6.800          | 6.630                    | 0,16                              |                                                                      |                |                          |                                   | 6,326 % fällig am 25.09.2035                             | 151            | 57                       | 0,00                              |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % fällig am 15.04.2032 (a)           | € 8.600        | 10.246                   | 0,25                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Atrium Hotel Portfolio Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| Weir Group, Inc.<br>5,350 % fällig am 06.05.2030                       | \$ 7.000       | 7.100                    | 0,17                              |                                                                      |                |                          |                                   | 5,539 % fällig am 15.12.2036                             | 4.407          | 4.311                    | 0,11                              |
| Workday, Inc.<br>3,800 % fällig am 01.04.2032                          | 4.300          | 4.042                    | 0,10                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                          |                |                          |                                   |
|                                                                        |                | 288.260                  | 7,06                              |                                                                      |                |                          |                                   | 4,607 % fällig am 25.11.2036                             | 564            | 290                      | 0,01                              |
| <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                                          |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>               |                |                          |                                   |
| AES Corp.<br>5,450 % fällig am 01.06.2028                              | 11.700         | 11.959                   | 0,29                              |                                                                      |                |                          |                                   | 4,774 % fällig am 25.06.2047                             | 811            | 720                      | 0,02                              |
| Electricité de France S.A.<br>5,950 % fällig am 22.04.2034             | 10.000         | 10.432                   | 0,26                              |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Braccan Mortgage Funding PLC</b>                      |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 23.05.2033                                           | 4.000          | 4.288                    | 0,10                              |                                                                      |                |                          |                                   | 5,077 % fällig am 15.02.2067                             | £ 7.113        | 9.775                    | 0,24                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Canada Square Funding PLC</b>                         |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 5,019 % fällig am 17.06.2058                             | 1.408          | 1.931                    | 0,05                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 5,189 % fällig am 17.06.2058                             | 2.511          | 3.445                    | 0,08                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                      |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,939 % fällig am 25.07.2037                             | \$ 6           | 5                        | 0,00                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Citigroup Commercial Mortgage Trust</b>               |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 3,209 % fällig am 10.05.2049                             | 2.100          | 2.073                    | 0,05                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>               |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 5,178 % fällig am 25.12.2035                             | 298            | 190                      | 0,00                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Commercial Mortgage Trust</b>                         |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,228 % fällig am 10.05.2051                             | 1.700          | 1.662                    | 0,04                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,674 % fällig am 25.06.2036                             | 58             | 55                       | 0,00                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.07.2046                             | 360            | 322                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.08.2047                             | 652            | 577                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.11.2034                             | 57             | 57                       | 0,00                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.12.2036                             | 1.030          | 423                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b> |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.04.2046                             | 1.851          | 532                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 5,014 % fällig am 25.03.2035                             | 272            | 241                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 5,114 % fällig am 25.03.2035                             | 56             | 53                       | 0,00                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.07.2036                             | 241            | 117                      | 0,00                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.12.2036                             | 601            | 267                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.03.2037                             | 579            | 258                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.11.2047                             | 92             | 44                       | 0,00                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Curzon Mortgages PLC</b>                              |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 5,482 % fällig am 28.07.2049                             | £ 9.498        | 13.056                   | 0,32                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | <b>Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust</b>     |                |                          |                                   |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.09.2047                             | \$ 607         | 521                      | 0,01                              |
|                                                                        |                |                          |                                   |                                                                      |                |                          |                                   | 4,994 % fällig am 25.08.2036                             | 3.457          | 3.103                    | 0,08                              |





# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd. |                |                          |                                   | France Government International Bond          |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 12.08.2032 PEN           | 52.700         | \$ 15.362                | 0,38                              |
| 5,602 % fällig am 16.07.2031 \$              | 1.167          | \$ 1.168                 | 0,03                              | 0,000 % fällig am 25.11.2029 (b) €            | 800            | \$ 844                   | 0,02                              | 6,900 % fällig am 12.08.2037               | 20.600         | 5.917                    | 0,14                              |
| Madison Park Euro Funding DAC                |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 25.02.2028                  | 24.800         | 28.088                   | 0,69                              | 6,950 % fällig am 12.08.2031               | 3.120          | 956                      | 0,02                              |
| 3,029 % fällig am 15.01.2032 €               | 3.169          | 3.708                    | 0,09                              | 0,750 % fällig am 25.05.2052                  | 7.700          | 4.308                    | 0,11                              | 7,300 % fällig am 12.08.2033               | 58.500         | 17.989                   | 0,44                              |
| 3,079 % fällig am 15.07.2032                 | 5.187          | 6.072                    | 0,15                              | 2,750 % fällig am 25.10.2027                  | 24.700         | 29.441                   | 0,72                              | Poland Government International Bond       |                |                          |                                   |
| OCP Euro CLO DAC                             |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 25.02.2029                  | 5.100          | 6.072                    | 0,15                              | 3,875 % fällig am 14.02.2033 €             | 7.700          | 9.481                    | 0,23                              |
| 3,116 % fällig am 22.09.2034                 | 2.000          | 2.347                    | 0,06                              | 2,750 % fällig am 25.02.2030                  | 104.000        | 123.351                  | 3,02                              | 4,250 % fällig am 14.02.2043               | 900            | 1.060                    | 0,03                              |
| Palmer Square European Loan Funding DAC      |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 25.05.2056                  | 2.400          | 2.664                    | 0,07                              | 4,875 % fällig am 12.02.2030 \$            | 2.800          | 2.858                    | 0,07                              |
| 2,999 % fällig am 15.10.2031                 | 1.903          | 2.229                    | 0,05                              | Hungary Government International Bond         |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 04.10.2033               | 2.200          | 2.190                    | 0,05                              |
| 3,259 % fällig am 15.01.2033                 | 3.710          | 4.358                    | 0,11                              | 4,500 % fällig am 16.06.2034                  | 7.000          | 8.294                    | 0,20                              | 5,125 % fällig am 18.09.2034               | 5.700          | 5.735                    | 0,14                              |
| Providus CLO DAC                             |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 22.09.2032 \$               | 9.500          | 9.932                    | 0,24                              | 5,375 % fällig am 12.02.2035               | 2.100          | 2.143                    | 0,05                              |
| 3,439 % fällig am 15.10.2038                 | 6.400          | 7.523                    | 0,18                              | Indonesia Government International Bond       |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 04.04.2053               | 1.600          | 1.493                    | 0,04                              |
| Sculptor European CLO DAC                    |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.01.2037 €                | 1.800          | 2.141                    | 0,05                              | Province of British Columbia               |                |                          |                                   |
| 3,055 % fällig am 14.01.2032                 | 3.950          | 4.632                    | 0,11                              | 5,600 % fällig am 15.01.2035 (e) \$           | 1.800          | 1.881                    | 0,05                              | 4,150 % fällig am 18.06.2034 CAD           | 23.800         | 17.993                   | 0,44                              |
| 3,329 % fällig am 15.10.2034                 | 8.697          | 10.187                   | 0,25                              | Israel Government International Bond          |                |                          |                                   | Province of Ontario                        |                |                          |                                   |
| Segovia European CLO DAC                     |                |                          |                                   | 3,800 % fällig am 13.05.2060                  | 1.700          | 1.110                    | 0,03                              | 3,650 % fällig am 02.06.2033               | 6.200          | 4.569                    | 0,11                              |
| 3,116 % fällig am 20.07.2032                 | 2.450          | 2.880                    | 0,07                              | 4,500 % fällig am 17.01.2033                  | 2.100          | 2.009                    | 0,05                              | 4,150 % fällig am 02.06.2034               | 14.100         | 10.662                   | 0,26                              |
| Steele Creek CLO Ltd.                        |                |                          |                                   | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro             |                |                          |                                   | Province of Quebec                         |                |                          |                                   |
| 5,768 % fällig am 15.10.2030 \$              | 734            | 735                      | 0,02                              | 4,000 % fällig am 30.10.2031 €                | 20.000         | 25.044                   | 0,61                              | 3,600 % fällig am 01.09.2033               | 77.600         | 56.842                   | 1,39                              |
| Toro European CLO DAC                        |                |                          |                                   | Japan Finance Organization for Municipalities |                |                          |                                   | 4,450 % fällig am 01.09.2034               | 5.400          | 4.166                    | 0,10                              |
| 2,953 % fällig am 15.02.2034 €               | 4.931          | 5.771                    | 0,14                              | 0,010 % fällig am 02.02.2028                  | 15.100         | 16.692                   | 0,41                              | Qatar Government International Bond        |                |                          |                                   |
| Trinitas CLO Ltd.                            |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 16.01.2030                  | 5.400          | 6.362                    | 0,16                              | 4,625 % fällig am 29.05.2029 \$            | 4.900          | 4.980                    | 0,12                              |
| Venture CLO Ltd.                             |                |                          |                                   | Japan Government International Bond           |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 29.05.2034 (e)           | 7.400          | 7.546                    | 0,18                              |
| 5,778 % fällig am 15.01.2032                 | 1.826          | 1.828                    | 0,05                              | 0,100 % fällig am 01.01.2026 ¥                | 3.310.000      | 22.872                   | 0,56                              | Queensland Treasury Corp.                  |                |                          |                                   |
| Wind River CLO Ltd.                          |                |                          |                                   | 0,100 % fällig am 10.03.2028 (c)              | 3.115.979      | 22.338                   | 0,55                              | 1,500 % fällig am 20.08.2032 AUD           | 4.300          | 2.319                    | 0,06                              |
| 5,581 % fällig am 18.07.2031                 | 65             | 65                       | 0,00                              | 0,100 % fällig am 10.03.2029 (c)              | 1.327.469      | 9.558                    | 0,23                              | 1,750 % fällig am 20.07.2034               | 25.200         | 12.832                   | 0,31                              |
|                                              |                | 158.868                  | 3,89                              | 0,400 % fällig am 20.06.2029                  | 1.730.000      | 11.743                   | 0,29                              | 2,000 % fällig am 22.08.2033               | 3.400          | 1.835                    | 0,04                              |
|                                              |                | 221.296                  | 5,42                              | 0,400 % fällig am 20.06.2040                  | 1.953.000      | 10.708                   | 0,26                              | 4,500 % fällig am 22.08.2035               | 25.900         | 16.404                   | 0,40                              |
|                                              |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 20.09.2046                  | 477.000        | 2.255                    | 0,06                              | 5,250 % fällig am 21.07.2036               | 7.200          | 4.798                    | 0,12                              |
|                                              |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 20.03.2049                  | 1.571.000      | 6.935                    | 0,17                              | RAK Capital                                |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 0,700 % fällig am 20.12.2048                  | 108.000        | 506                      | 0,01                              | 5,000 % fällig am 12.03.2035 \$            | 6.000          | 6.085                    | 0,15                              |
|                                              |                |                          |                                   | 0,700 % fällig am 20.06.2051                  | 1.502.000      | 6.544                    | 0,16                              | Region of Ile de France                    |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 1,300 % fällig am 20.06.2052                  | 620.000        | 3.118                    | 0,08                              | 2,230 % fällig am 19.07.2032 €             | 6.000          | 6.700                    | 0,16                              |
|                                              |                |                          |                                   | 1,400 % fällig am 20.09.2052                  | 260.000        | 1.336                    | 0,03                              | Bundesrepublik Deutschland                 |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 20.09.2043                  | 1.683.000      | 10.329                   | 0,25                              | 0,000 % fällig am 15.08.2031 (b)           | 53.800         | 55.131                   | 1,35                              |
|                                              |                |                          |                                   | 1,800 % fällig am 20.09.2044                  | 930.000        | 5.915                    | 0,14                              | 2,300 % fällig am 15.02.2033               | 10.000         | 11.642                   | 0,29                              |
|                                              |                |                          |                                   | 1,800 % fällig am 20.03.2054                  | 1.448.000      | 8.051                    | 0,20                              | Romania Government International Bond      |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 20.12.2044                  | 4.225.000      | 27.697                   | 0,68                              | 1,375 % fällig am 02.12.2029               | 1.170          | 1.203                    | 0,03                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,200 % fällig am 20.06.2054                  | 769.000        | 4.685                    | 0,11                              | 2,000 % fällig am 28.01.2032               | 200            | 191                      | 0,00                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,200 % fällig am 20.03.2064                  | 2.337.000      | 13.010                   | 0,32                              | 2,000 % fällig am 14.04.2033               | 6.600          | 5.947                    | 0,15                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,300 % fällig am 20.12.2054                  | 5.186.000      | 32.275                   | 0,79                              | 2,124 % fällig am 16.07.2031               | 100            | 98                       | 0,00                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,400 % fällig am 20.03.2045                  | 2.593.000      | 18.072                   | 0,44                              | 2,125 % fällig am 07.03.2028               | 18.400         | 20.830                   | 0,51                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,400 % fällig am 20.03.2055                  | 2.030.000      | 12.912                   | 0,32                              | 2,625 % fällig am 02.12.2040               | 500            | 366                      | 0,01                              |
|                                              |                |                          |                                   | Junta de Andalucía                            |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 14.04.2041               | 600            | 440                      | 0,01                              |
|                                              |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 30.04.2031 €                | 1.400          | 1.439                    | 0,04                              | 2,875 % fällig am 13.04.2042               | 2.000          | 1.465                    | 0,04                              |
|                                              |                |                          |                                   | Kommunalbanken A/S                            |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 07.02.2034               | 5.600          | 5.623                    | 0,14                              |
|                                              |                |                          |                                   | 1,900 % fällig am 19.01.2027 AUD              | 800            | 511                      | 0,01                              | 5,625 % fällig am 22.02.2036               | 7.000          | 7.831                    | 0,19                              |
|                                              |                |                          |                                   | Korea Development Bank                        |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 10.09.2034               | 3.700          | 4.387                    | 0,11                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.02.2027 \$               | 11.200         | 11.280                   | 0,28                              | 6,625 % fällig am 27.09.2029               | 7.700          | 9.749                    | 0,24                              |
|                                              |                |                          |                                   | Korea Housing Finance Corp.                   |                |                          |                                   | Saudi Arabia Government International Bond |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 0,010 % fällig am 29.06.2026 €                | 1.300          | 1.493                    | 0,04                              | 3,375 % fällig am 05.03.2032               | 21.800         | 25.507                   | 0,62                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,742 % fällig am 05.03.2030                  | 8.700          | 10.227                   | 0,25                              | Serbia Government International Bond       |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 3,124 % fällig am 18.03.2029                  | 8.500          | 10.171                   | 0,25                              | 1,000 % fällig am 23.09.2028               | 3.100          | 3.362                    | 0,08                              |
|                                              |                |                          |                                   | 3,714 % fällig am 11.04.2027                  | 5.000          | 6.010                    | 0,15                              | 1,650 % fällig am 03.03.2033               | 3.000          | 2.891                    | 0,07                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,475 % fällig am 06.04.2026 AUD              | 10.900         | 7.154                    | 0,18                              | 2,050 % fällig am 23.09.2036               | 2.550          | 2.278                    | 0,06                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 27.08.2027 \$               | 4.000          | 4.057                    | 0,10                              | Singapore Government International Bond    |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | Kuntarahoitus Oyj                             |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 01.07.2039 SGD           | 2.532          | 2.000                    | 0,05                              |
|                                              |                |                          |                                   | 0,050 % fällig am 06.09.2029 €                | 12.700         | 13.520                   | 0,33                              | 2,750 % fällig am 01.03.2035               | 15.050         | 12.365                   | 0,30                              |
|                                              |                |                          |                                   | Malaysia Government International Bond        |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 01.06.2054               | 20.529         | 19.187                   | 0,47                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,632 % fällig am 15.04.2031 MYR              | 20.600         | 4.717                    | 0,12                              | South Africa Government International Bond |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 3,519 % fällig am 20.04.2028                  | 104.662        | 25.123                   | 0,62                              | 8,000 % fällig am 31.01.2030 ZAR           | 205.400        | 11.366                   | 0,28                              |
|                                              |                |                          |                                   | 3,582 % fällig am 15.07.2032                  | 3.070          | 739                      | 0,02                              | 8,875 % fällig am 28.02.2035               | 440.100        | 23.125                   | 0,57                              |
|                                              |                |                          |                                   | Malaysia Government Investment Issue          |                |                          |                                   | Spain Government International Bond        |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 4,193 % fällig am 07.10.2032                  | 16.550         | 4.124                    | 0,10                              | 0,000 % fällig am 31.01.2028 (b) €         | 32.150         | 35.798                   | 0,88                              |
|                                              |                |                          |                                   | Mexico Government International Bond          |                |                          |                                   | 1,450 % fällig am 31.10.2071               | 500            | 272                      | 0,01                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,490 % fällig am 25.05.2032 €                | 4.500          | 5.353                    | 0,13                              | 2,400 % fällig am 31.05.2028               | 21.850         | 25.825                   | 0,63                              |
|                                              |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 27.04.2051 \$               | 500            | 389                      | 0,01                              | 2,500 % fällig am 31.05.2027               | 2.700          | 3.200                    | 0,08                              |
|                                              |                |                          |                                   | Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap        |                |                          |                                   | 2,700 % fällig am 31.01.2030               | 23.695         | 28.115                   | 0,69                              |
|                                              |                |                          |                                   | 0,875 % fällig am 21.03.2046 €                | 3.800          | 2.547                    | 0,06                              | 3,150 % fällig am 30.04.2035               | 16.230         | 19.026                   | 0,47                              |
|                                              |                |                          |                                   | Nederlandse Waterschapsbank NV                |                |                          |                                   | 3,200 % fällig am 31.10.2035               | 9.000          | 10.538                   | 0,26                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 13.09.2027                  | 38.200         | 45.207                   | 1,11                              | 3,450 % fällig am 30.07.2066               | 1.450          | 1.489                    | 0,04                              |
|                                              |                |                          |                                   | New South Wales Treasury Corp.                |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 31.01.2041               | 2.900          | 3.333                    | 0,08                              |
|                                              |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 20.03.2034 AUD              | 5.700          | 2.953                    | 0,07                              | 3,550 % fällig am 31.10.2033               | 53.748         | 65.681                   | 1,61                              |
|                                              |                |                          |                                   | Ontario Teachers' Finance Trust               |                |                          |                                   | Svensk Exportkredit AB                     |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 0,900 % fällig am 20.05.2041 €                | 1.400          | 1.105                    | 0,03                              | 2,000 % fällig am 30.06.2027               | 5.500          | 6.428                    | 0,16                              |
|                                              |                |                          |                                   | 1,850 % fällig am 03.05.2032                  | 4.000          | 4.378                    | 0,11                              | Thailand Government International Bond     |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | Peru Government International Bond            |                |                          |                                   | 2,410 % fällig am 17.03.2035 THB           | 122.610        | 4.044                    | 0,10                              |
|                                              |                |                          |                                   | 2,780 % fällig am 01.12.2060 \$               | 1.500          | 810                      | 0,02                              | 2,500 % fällig am 17.11.2029               | 609.880        | 19.620                   | 0,48                              |
|                                              |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 30.03.2036                  | 9.300          | 9.318                    | 0,23                              | 3,775 % fällig am 25.06.2032               | 105.810        | 3.743                    | 0,09                              |

| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Treasury Corp. of Victoria   |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 31.07.2053 £ | 7.500          | \$ 4.667                 | 0,11                              |
| 2,000 % fällig am 17.09.2035 | AUD 28.000     | \$ 14.013                | 0,34                              | 4,375 % fällig am 31.07.2054   | 21.200         | 25.181                   | 0,62                              |
| 2,250 % fällig am 15.09.2033 | 22.300         | 12.259                   | 0,30                              | 5,375 % fällig am 31.01.2056   | 4.300          | 5.985                    | 0,15                              |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032 | 8.800          | 5.708                    | 0,14                              |                                |                | 1.567.370                | 38,41                             |
| United Kingdom Gilt          |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
| 1,250 % fällig am 31.07.2051 | £ 7.100        | 4.256                    | 0,10                              | Summe Übertragbare Wertpapiere |                | \$ 5.875.506             | 144,00                            |

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## FUTURES

| Beschreibung                                           | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Australia Government 3-Year Note September Futures     | Short | 09.2025     | 25                   | \$ (6)                                   | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures    | Short | 09.2025     | 3.129                | (2.141)                                  | (0,05)               |
| Canada Government 5-Year Bond September Futures        | Long  | 09.2025     | 186                  | 100                                      | 0,00                 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures       | Long  | 09.2025     | 572                  | 443                                      | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures                            | Short | 09.2025     | 1.420                | 704                                      | 0,02                 |
| Euro-BTP September Futures                             | Long  | 09.2025     | 2.258                | 1.010                                    | 0,02                 |
| Euro-Bund September Futures                            | Short | 09.2025     | 1.922                | 2.102                                    | 0,05                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures               | Short | 09.2025     | 43                   | 114                                      | 0,00                 |
| Euro-OAT September Futures                             | Short | 09.2025     | 1.460                | 399                                      | 0,01                 |
| Euro-Schatz September Futures                          | Short | 09.2025     | 287                  | 56                                       | 0,00                 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures        | Short | 09.2025     | 504                  | (1.335)                                  | (0,03)               |
| Short Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2025     | 1.423                | 281                                      | 0,01                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 1.611                | 1.256                                    | 0,03                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 5.268                | 6.049                                    | 0,15                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures           | Long  | 09.2025     | 1.175                | 2.361                                    | 0,06                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures          | Long  | 09.2025     | 2.291                | 5.705                                    | 0,14                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures   | Short | 09.2025     | 127                  | (392)                                    | (0,01)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures             | Long  | 09.2025     | 646                  | 1.902                                    | 0,04                 |
|                                                        |       |             |                      | \$ 18.608                                | 0,45                 |

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------|-----------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 109.000    | 25.07.2025    | 61                   | \$ (24)  | \$ (2)    | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112.500       | 25.07.2025    | 61                   | (25)     | (32)      | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                    | € 129.000     | 25.07.2025    | 113                  | (52)     | (45)      | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                   | 132.500       | 25.07.2025    | 113                  | (60)     | (19)      | 0,00                 |
|                                                                |               |               |                      | \$ (161) | \$ (98)   | 0,00                 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                      |          | \$ 18.510 | 0,45                 |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.06.2030       | \$ 234.700                | \$ 565                                   | 0,02                 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,000 %         | 17.06.2027       | £ 95.700    | \$ (1.376)                               | (0,03)               |
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2030       | 87.900      | 1.389                                    | 0,03                 |
| Erhalt                            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2035       | 27.800      | (221)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2027       | 20.600      | (1)                                      | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(3)</sup>            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 18.03.2031       | 68.200      | 70                                       | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2055       | 7.600       | (270)                                    | (0,01)               |
| Zahlung <sup>(3)</sup>            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 4,000           | 17.03.2028       | 235.100     | 2.371                                    | 0,06                 |
| Erhalt <sup>(3)</sup>             | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000           | 17.09.2030       | INR 457.100 | (47)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 17.03.2031       | ¥ 1.500.000 | (272)                                    | (0,01)               |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050           | 15.12.2031       | 1.981.000   | (359)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400           | 19.06.2039       | 430.000     | 303                                      | 0,01                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,600           | 18.12.2029       | 6.340.000   | (382)                                    | (0,01)               |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750           | 19.03.2027       | 9.590.000   | 93                                       | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 0,750 %         | 19.03.2030       | ¥ 7.820.000 | \$ 73                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000           | 18.06.2030       | 110.000     | 5                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000           | 19.03.2032       | 15.730.000  | 415                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000           | 18.09.2034       | 15.500.000  | (723)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000           | 18.12.2034       | 395.000     | (62)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000           | 19.03.2035       | 8.770.000   | (115)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000           | 19.06.2044       | 6.450.000   | (3.256)                                         | (0,08)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,500           | 18.09.2054       | 1.100       | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,500           | 18.12.2054       | 280.000     | 147                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS   | 2,500           | 17.09.2030       | SGD 13.500  | (220)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS   | 2,750           | 18.09.2029       | 102.220     | (3.745)                                         | (0,09)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 2,965           | 30.11.2026       | \$ 53.060   | 1.202                                           | 0,03                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000           | 19.03.2027       | 269.940     | (1.824)                                         | (0,04)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000           | 19.03.2030       | 144.520     | (3.502)                                         | (0,09)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2027       | 104.900     | (156)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2030       | 145.100     | (1.040)                                         | (0,03)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 19.03.2035       | 71.850      | (1.844)                                         | (0,05)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2035       | 104.800     | (605)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 19.03.2055       | 3.500       | 11                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,525           | 04.09.2034       | 4.800       | 106                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,550           | 21.08.2034       | 9.700       | 197                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,599           | 28.08.2034       | 10.800      | 170                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,600           | 30.06.2027       | 134.180     | (624)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,600           | 28.08.2034       | 11.350      | 183                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,611           | 28.08.2034       | 1.350       | 20                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,620           | 30.11.2029       | 318.217     | (3.224)                                         | (0,08)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,645           | 07.08.2034       | 2.000       | 24                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,700           | 20.02.2049       | 400         | 15                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2026       | 16.900      | (225)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 15.05.2032       | 46.068      | (659)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 20.06.2034       | 50.000      | (1.787)                                         | (0,04)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,765           | 15.02.2055       | 15.900      | 448                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,772           | 15.02.2055       | 1.800       | 48                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,773           | 04.03.2055       | 8.300       | 223                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,804           | 15.02.2055       | 8.200       | 175                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,806           | 15.02.2055       | 4.000       | 84                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,836           | 15.05.2034       | 8.600       | (130)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,840           | 30.06.2031       | 34.900      | (579)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,847           | 15.05.2034       | 5.100       | (81)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,851           | 28.02.2029       | 12.100      | (169)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,860           | 15.05.2034       | 9.100       | (154)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,861           | 15.02.2055       | 3.000       | 33                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,862           | 28.02.2029       | 22.600      | (326)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,866           | 15.02.2055       | 2.400       | 24                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,899           | 11.03.2035       | 10.200      | (140)                                           | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,900           | 15.02.2035       | 240.586     | (4.714)                                         | (0,12)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,905           | 15.08.2026       | 41.700      | (77)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,905           | 12.03.2035       | 5.100       | (75)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,930           | 24.03.2035       | 10.200      | (172)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,930           | 25.06.2055       | 7.343       | (52)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,931           | 15.11.2054       | 900         | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,955           | 15.11.2054       | 5.500       | (27)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,959           | 15.11.2054       | 15.800      | (90)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,960           | 27.06.2055       | 1.924       | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,964           | 15.11.2054       | 4.400       | (29)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,975           | 21.03.2035       | 5.100       | (106)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,988           | 30.11.2027       | 62.800      | 834                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,996           | 15.11.2054       | 11.000      | (136)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000           | 20.06.2026       | 19.200      | (303)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,005           | 29.09.2055       | 15.964      | (157)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,020           | 15.05.2026       | 35.200      | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,100           | 15.11.2052       | 31.300      | (638)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,111           | 15.11.2054       | 17.440      | (574)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,130           | 15.11.2054       | 10.460      | (379)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,193           | 30.11.2027       | 42.200      | 687                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250           | 20.12.2025       | 179.153     | (1.095)                                         | (0,03)                  |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,740           | 01.06.2034       | CAD 1.300   | 12                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850           | 01.09.2029       | 27.000      | 295                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850           | 01.06.2033       | 3.700       | (35)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,880           | 01.09.2033       | 11.700      | (22)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2033       | 5.200       | (66)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2034       | 11.100      | (65)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,180           | 01.06.2033       | 40.600      | (721)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                 | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250           | 20.12.2028       | 12.100      | 322                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250           | 18.12.2034       | 4.900       | 24                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250           | 21.06.2053       | 2.600       | 153                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,300           | 01.06.2033       | 17.300      | (542)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,400           | 01.06.2033       | 2.700       | (78)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                 | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 19.03.2026       | 113.500     | 721                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 01.06.2032       | 17.300      | (202)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 01.09.2033       | 14.000      | (682)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                 | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,898           | 19.06.2026       | 26.500      | 268                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                 | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,925           | 19.06.2026       | 72.400      | 741                                             | 0,02                    |

| Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz        | Variabler Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag     | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|------------------------------------|-----------------|------------------|----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,283 %         | 14.02.2027       | CHF 4.200      | \$ 142                                          | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,294           | 10.02.2027       | 15.500         | 517                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS | 0,343           | 16.05.2027       | 6.300          | 226                                             | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 3-Month CNY-CNREPOFIX              | 1,500           | 18.06.2030       | CNY 2.256.900  | 1.343                                           | 0,03                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 3-Month KRW-KORIBOR                | 2,500           | 17.09.2035       | KRW 56.583.900 | (386)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 3-Month KRW-KORIBOR                | 2,750           | 19.03.2035       | 14.521.730     | 76                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 3-Month NZD-BBR                    | 3,750           | 15.06.2027       | NZD 1.100      | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 3-Month NZD-BBR                    | 4,750           | 19.06.2029       | 25.800         | 569                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 3-Month SEK-STIBOR                 | 2,474           | 03.02.2030       | SEK 100.400    | 227                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW               | 1,750           | 16.03.2027       | AUD 3.000      | 92                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month AUD-BBR-BBSW               | 3,500           | 18.03.2031       | 15.500         | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW               | 3,750           | 19.03.2030       | 343.600        | 1.461                                           | 0,04                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW               | 4,000           | 21.06.2033       | 50.100         | 1.578                                           | 0,04                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW               | 4,250           | 19.03.2035       | 44.900         | 319                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW               | 4,500           | 19.03.2035       | 106.600        | 2.119                                           | 0,05                    |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW               | 4,500           | 18.06.2035       | 3.700          | 47                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR                 | 1,913           | 30.01.2029       | CZK 7.400      | 21                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                | 0,064           | 17.11.2052       | € 1.300        | 308                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 0,250           | 15.09.2036       | 1.400          | (95)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 0,451           | 27.05.2050       | 1.700          | (846)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 1,795           | 11.10.2029       | 13.450         | (150)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 1,923           | 11.10.2029       | 41.600         | (189)                                           | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,000           | 17.09.2027       | 222.600        | (860)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,028           | 11.10.2029       | 69.600         | (101)                                           | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,250           | 17.09.2030       | 23.600         | 54                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,250           | 17.09.2035       | 311.710        | (942)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,250           | 21.09.2037       | 11.890         | (228)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,250           | 21.09.2042       | 6.060          | (940)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,250           | 17.09.2055       | 21.650         | 794                                             | 0,02                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,270           | 12.03.2055       | 26.400         | 1.178                                           | 0,03                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,278           | 12.03.2055       | 54.900         | 2.416                                           | 0,06                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,282           | 12.03.2055       | 4.400          | 192                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,750           | 18.09.2039       | 11.700         | (453)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,780           | 02.05.2029       | 20.200         | 586                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                | 2,950           | 12.06.2029       | 18.500         | 680                                             | 0,02                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                | 3,000           | 15.03.2033       | 58.910         | (299)                                           | (0,01)                  |
|                                                |                                    |                 |                  |                | \$ (17.830)                                     | (0,44)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                    |                 |                  |                | \$ (17.265)                                     | (0,42)                  |

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,650    | 11.03.2026    | 4.062                     | \$ 28  | \$ 30     | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000   | 25.08.2025    | 5.069                     | 23     | 30        | 0,00                    |
| BRC        | Call - OTC USD versus SEK | SEK 10,200    | 26.11.2025    | 8.288                     | 51     | 50        | 0,00                    |
| GLM        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,100      | 17.12.2025    | 1.023                     | 117    | 84        | 0,01                    |
| JPM        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,600    | 22.12.2025    | 11.367                    | 51     | 59        | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 395,000   | 29.09.2025    | 6.104                     | 31     | 25        | 0,00                    |
| MBC        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,098      | 23.12.2025    | 1.023                     | 119    | 80        | 0,00                    |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,750    | 09.12.2025    | 4.302                     | 26     | 33        | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,550        | 16.12.2025    | 10.241                    | 46     | 45        | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus CZK  | 24,700        | 16.12.2025    | 7.237                     | 45     | 49        | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,110      | 24.11.2025    | 25.891                    | 121    | 82        | 0,00                    |
|            |                           |               |               |                           | \$ 658 | \$ 567    | 0,01                    |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                        | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| BPS        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,570 %       | 13.08.2025    | 234.000                   | \$ 328 | \$ 0      | 0,00                    |
| GLM        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,700         | 20.08.2025    | 125.000                   | 160    | 0         | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,570         | 13.08.2025    | 5.400                     | 7      | 0         | 0,00                    |
|            |                                     |                            |                                             |               |               |                           | \$ 495 | \$ 0      | 0,00                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| GLM        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 53,500    | 11.12.2025    | 6.533                     | \$ (212) | \$ (174)  | (0,01)               |
| UAG        | Call - OTC USD versus TRY | 54,000        | 16.12.2025    | 4.105                     | (135)    | (111)     | 0,00                 |
|            |                           |               |               |                           | \$ (347) | \$ (285)  | (0,01)               |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|------------|-----------|----------------------|
| BRC        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,350 %       | 25.09.2025    | 128.100                   | \$ (1.230) | \$ (37)   | 0,00                 |
| GLM        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,330         | 25.09.2025    | 16.200                    | (178)      | (5)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775         | 07.07.2025    | 4.900                     | (15)       | (43)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125         | 07.07.2025    | 4.900                     | (15)       | 0         | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664         | 14.07.2025    | 14.600                    | (43)       | (70)      | (0,01)               |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669         | 07.07.2025    | 5.000                     | (19)       | (17)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715         | 02.07.2025    | 7.800                     | (28)       | (32)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725         | 03.07.2025    | 9.800                     | (37)       | (52)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019         | 07.07.2025    | 5.000                     | (19)       | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064         | 14.07.2025    | 14.600                    | (43)       | (2)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065         | 02.07.2025    | 7.800                     | (28)       | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075         | 03.07.2025    | 9.800                     | (37)       | 0         | 0,00                 |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | \$ (1.692) | \$ (258)  | (0,01)               |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | South Korea Government International Bond | (1,000) %                      | 20.06.2030       | \$ 5.500                  | \$ (176)                                  | \$ (11)                                         | \$ (187)  | 0,00                 |
| JPM        | South Korea Government International Bond | (1,000)                        | 20.06.2030       | 5.680                     | (181)                                     | (12)                                            | (193)     | (0,01)               |
|            |                                           |                                |                  |                           | \$ (357)                                  | \$ (23)                                         | \$ (380)  | (0,01)               |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                         | Zahlung                                                                                               | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag<br>erhaltener<br>Währung | Nennbetrag<br>gelieferter<br>Währung | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|------------|----------------------|
| CBK        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,410 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.12.2026       | \$ 161.826                          | JPY 23.960.000                       | \$ 279                                       | \$ 17                                           | \$ 296     | 0,00                 |
|            | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,462 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030       | 37.377                              | 5.700.000                            | (83)                                         | 77                                              | (6)        | 0,00                 |
| GLM        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,459 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030       | 1.310                               | 200.000                              | (5)                                          | 3                                               | (2)        | 0,00                 |
| GST        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,414 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 15.10.2026       | 157.021                             | 24.856.000                           | (2.209)                                      | 71                                              | (2.138)    | (0,05)               |
| MYC        | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,430 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030       | 2.504                               | 380.000                              | (6)                                          | 1                                               | (5)        | 0,00                 |
|            |                                                                                                                                |                                                                                                       |                  |                                     |                                      | \$ (2.024)                                   | \$ 169                                          | \$ (1.855) | (0,05)               |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------------------------|-------------------------|--------------------|------------------|-------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| BPS        | Zahlung <sup>(1)</sup>                  | 3-Month CNY-CNREPOFIX   | 1,500 %            | 18.03.2031       | CNY 934.300 | \$ (300)                                     | \$ 467                                          | \$ 167    | 0,00                    |
|            | Zahlung                                 | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,500              | 19.03.2030       | MYR 49.330  | (51)                                         | 215                                             | 164       | 0,00                    |
|            | Erhalt                                  | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,750              | 18.09.2034       | MYR 21.940  | (60)                                         | (89)                                            | (149)     | 0,00                    |
| CBK        | Zahlung <sup>(1)</sup>                  | 3-Month CNY-CNREPOFIX   | 1,500              | 18.03.2031       | CNY 488.200 | 0                                            | 87                                              | 87        | 0,00                    |
| GST        | Zahlung                                 | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,500              | 19.03.2030       | MYR 134.050 | 61                                           | 386                                             | 447       | 0,01                    |
|            | Erhalt                                  | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,750              | 20.09.2033       | 59.060      | 374                                          | (784)                                           | (410)     | (0,01)                  |
| JPM        | Erhalt                                  | 3-Month MYR-KLIBOR      | 3,750              | 19.03.2035       | 25.350      | 19                                           | (189)                                           | (170)     | 0,00                    |
| SCX        | Zahlung <sup>(1)</sup>                  | 3-Month CNY-CNREPOFIX   | 1,500              | 18.03.2031       | CNY 108.200 | 50                                           | (31)                                            | 19        | 0,00                    |
|            |                                         |                         |                    |                  |             | \$ 93                                        | \$ 62                                           | \$ 155    | 0,00                    |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD                    | 38 \$                    | 28                               | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 57.625                   | 7.998                            | 0                                  | (55)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 110.126                  | AUD 169.530                      | 975                                | 975                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 15 CHF                   | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 189.016 €                | 161.438                          | 489                                | 489                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.069 NZD                | 5.100                            | 27                                 | 27                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 169.530                  | \$ 110.191                       | 0                                  | (981)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | CHF                    | 12                       | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 181.458                  | 25.332                           | 0                                  | (96)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 161.173                  | 189.127                          | 0                                  | (478)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | NZD                    | 5.100                    | 3.073                            | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 28                       | CAD 38                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 3.435                    | \$ 2.237                         | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 153.800                  | 1.070                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 3.421.114                | 2.510                            | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | \$                     | 2.234                    | IDR 36.454.146                   | 11                                 | 11                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 8.180                    | PEN 29.653                       | 176                                | 176                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.439                    | SGD 3.123                        | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 13.069                   | \$ 1.827                         | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | HUF                    | 573.608                  | € 1.419                          | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 3.116                    | \$ 2.439                         | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 870                      | 27                               | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 4.448                    | MXN 84.371                       | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 12.2025          | PEN                    | 29.762                   | \$ 8.180                         | 0                                  | (171)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 433                      | 76                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 3.249                    | RON 16.414                       | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 19                       | \$ 22                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 34.052                   | 25                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 6.150                    | 608                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 8.560                    | 891                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | THB                    | 1.841                    | 56                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 174.223                  | 5.362                            | 0                                  | (636)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 13.769                   | BRL 76.751                       | 293                                | 293                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.777                    | CNY 19.877                       | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4.952                    | IDR 80.791.464                   | 24                                 | 24                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 117                      | KRW 160.783                      | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 384                      | THB 12.589                       | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.425                    | TWD 42.408                       | 34                                 | 34                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 109.640                  | \$ 15.350                        | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CZK                    | 214                      | 10                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 144.985                  | 4.448                            | 0                                  | (591)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 359                      | CNH 2.563                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.818                    | CNY 13.002                       | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2.581                    | INR 224.363                      | 29                                 | 29                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 3.016                    | MXN 57.439                       | 10                                 | 10                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 08.2025          |                        | 3.140                    | TRY 130.215                      | 33                                 | 33                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 5.796                    | TWD 183.833                      | 594                                | 594                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          | €                      | 3.495                    | RON 17.697                       | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.191.651                | \$ 1.353.602                     | 0                                  | (45.215)                                             | (1,10)                  |
|            | 07.2025          | ILS                    | 26.174                   | 7.518                            | 0                                  | (255)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 460.539                  | 337                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 3.605                    | 355                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 6.931                    | € 6.108                          | 239                                | 239                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 198.378                  | £ 145.813                        | 1.436                              | 1.436                                                | 0,03                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.728                    | ILS 12.586                       | 10                                 | 10                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 14                       | NOK 144                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 99                       | PLN 370                          | 4                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 29.072                   | TRY 1.181.451                    | 363                                | 363                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 264.904                  | \$ 14.647                        | 0                                  | (236)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CZK                    | 2.115                    | 95                               | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 143.351                  | 195.071                          | 0                                  | (1.398)                                              | (0,03)                  |
|            | 08.2025          | THB                    | 23                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 7.887                    | TRY 326.968                      | 86                                 | 86                                                   | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BSH<br>CBK | 09.2025          | MYR                    | 58.149                   | \$ 13.795                        | \$ 0                               | \$ (70)                                              | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 9.247                    | 2.531                            | 0                                  | (69)                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025          | \$                     | 978                      | TRY 45.753                       | 21                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 13.946                   | \$ 2.124                         | 0                                  | (70)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 82                       | 59                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 35.948                   | 5.017                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 4.835                    | 5.527                            | 0                                  | (148)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 26.415.769               | 19.282                           | 0                                  | (250)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | PEN                    | 46.074                   | 12.499                           | 0                                  | (480)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | SEK                    | 11.010                   | 1.160                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 96.350                   | 2.897                            | 0                                  | (69)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 301.635                  | 9.271                            | 0                                  | (1.113)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 26.480                   | CNY 189.744                      | 60                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.601                    | £ 1.904                          | 11                                 | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4.307                    | IDR 70.130.355                   | 13                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 6.362                    | ¥ 905.800                        | 0                                  | (91)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 355                      | KRW 487.880                      | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 15.182                   | PEN 54.174                       | 78                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.370                    | TWD 70.225                       | 48                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | EGP                    | 20.402                   | \$ 380                           | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PEN                    | 7.562                    | 2.007                            | 0                                  | (122)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 335.209                  | 10.287                           | 0                                  | (1.365)                                              | (0,03)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.430                    | CNH 10.247                       | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 18.754                   | CNY 134.107                      | 31                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 19.328                   | INR 1.665.928                    | 64                                 | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 73                       | PEN 264                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 10.860                   | \$ 566                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 54.200                   | 15.157                           | 0                                  | (79)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 1.360                    | KZT 701.080                      | 0                                  | (39)                                                 | 0,00                    |
|            | 11.2025          | PEN                    | 40.186                   | \$ 10.974                        | 0                                  | (304)                                                | (0,01)                  |
|            | 12.2025          |                        | 2.672                    | 722                              | 0                                  | (28)                                                 | 0,00                    |
| DUB        | 01.2026          | ¥                      | 470.000                  | 3.463                            | 143                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 99                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 12.710                   | 3.667                            | 0                                  | (107)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 436.358                  | 320                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PEN                    | 29.669                   | 8.053                            | 0                                  | (308)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | SGD                    | 322                      | 250                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.622                    | CNY 18.712                       | 1                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.648                    | DKK 10.496                       | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 311                      | IDR 5.070.064                    | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 200                      | KZT 105.750                      | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.315                    | TWD 39.090                       | 31                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 178                      | \$ 25                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 10.470                   | 1.648                            | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 5.825                    | RON 29.569                       | 0                                  | (40)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | THB                    | 350.434                  | \$ 10.789                        | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 8.742                    | CNH 62.881                       | 69                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 8.959                    | INR 773.070                      | 37                                 | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | KZT                    | 209.502                  | \$ 386                           | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 147                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 2.298                    | KZT 1.192.659                    | 0                                  | (51)                                                 | 0,00                    |
| FAR        | 12.2025          |                        | 1.984                    | 1.054.583                        | 0                                  | (53)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 8.762                    | \$ 10.640                        | 0                                  | (367)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH                    | 29.313                   | 4.079                            | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 18.162.514               | 126.605                          | 865                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 812                      | 632                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 35.207                   | BRL 201.293                      | 1.673                              | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025          |                        | 11.383                   | CHF 9.113                        | 65                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.242                    | DKK 14.266                       | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 11                       | £ 8                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 69.727                   | ¥ 10.149.407                     | 538                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 6.382                    | PLN 23.536                       | 129                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.961                    | SGD 2.501                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 9.075                    | \$ 11.383                        | 0                                  | (66)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 115.721                  | 16.172                           | 0                                  | (44)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 14.231                   | 2.242                            | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 10.112.082               | 69.727                           | 0                                  | (539)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | SGD                    | 2.495                    | 1.961                            | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 4.281                    | INR 370.254                      | 26                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 6.312                    | MXN 122.912                      | 141                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 45                       | PEN 163                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | BRL                    | 277.866                  | \$ 50.111                        | 0                                  | (800)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | €                      | 3.872                    | RON 19.538                       | 0                                  | (34)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PEN                    | 8.096                    | \$ 2.174                         | 0                                  | (106)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 29.722                   | 914                              | 0                                  | (109)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.445                    | CNY 17.525                       | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.021                    | IDR 16.635.223                   | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 762                      | SGD 971                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 222                      | THB 7.395                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 89                       | TWD 2.880                        | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 877                      | \$ 48                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €                      | 687                      | RON 3.490                        | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| IND        | 08.2025          | SGD                    | 969 \$                   | 762                              | \$ 0                               | \$ (1)                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.010 EGP                | 55.654                           | 90                                 | 90                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.890 HUF                | 651.497                          | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 59 THB                   | 1.937                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MYR                    | 87.610 \$                | 20.810                           | 0                                  | (79)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 50.111 BRL               | 282.178                          | 812                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 09.2025          |                        | 1.287 KZT                | 670.171                          | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025          | TRY                    | 35.012 \$                | 751                              | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 01.2026          | ¥                      | 1.320.000                | 9.806                            | 482                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.071 SEK                | 19.595                           | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK                    | 19.553 \$                | 2.071                            | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 58.578                   | 1.949                            | 0                                  | (87)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 350                      | 427                              | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 55.537                   | 7.695                            | 0                                  | (67)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 10.807                   | 1.637                            | 0                                  | (64)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 472.488                  | 3.290                            | 19                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 2.673.674                | 1.954                            | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 5.100                    | 3.042                            | 0                                  | (54)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 21.530                   | 16.761                           | 0                                  | (143)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 176.348                  | 5.423                            | 0                                  | (648)                                                | (0,02)                  |
| JPM        | 07.2025          | \$                     | 6.319 CNY                | 45.251                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 107 £                    | 78                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 12.544 PLN               | 46.427                           | 299                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.597 SGD                | 2.045                            | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 101.038 \$               | 5.654                            | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 169.982                  | 23.709                           | 0                                  | (110)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 2.040                    | 1.597                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 242.715                  | 7.432                            | 0                                  | (1.004)                                              | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.886 INR                | 250.235                          | 25                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 75 TWD                   | 2.450                            | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025          | HUF                    | 590.585 €                | 1.465                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 2.359 \$                 | 1.521                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 186.616                  | 135.873                          | 0                                  | (893)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | CHF                    | 12                       | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 26.625                   | 3.695                            | 0                                  | (26)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 20.734                   | 2.893                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 28.877                   | 33.130                           | 0                                  | (767)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 17.346                   | 23.534                           | 0                                  | (236)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | HKD                    | 10.081                   | 1.289                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 1.102.868                | 7.664                            | 31                                 | (2)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | SGD                    | 51.721                   | 40.316                           | 0                                  | (292)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | THB                    | 48.366                   | 1.461                            | 0                                  | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 84.858                   | 2.604                            | 0                                  | (318)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 135.869 CAD              | 186.766                          | 1.005                              | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 7.057 €                  | 6.118                            | 125                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.852 £                  | 2.848                            | 51                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.035 IDR                | 16.826.980                       | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.368 ¥                  | 343.800                          | 12                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 760 PLN                  | 2.844                            | 27                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 42.146 SGD               | 54.504                           | 647                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 104 TWD                  | 3.084                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 186.454 \$               | 135.869                          | 0                                  | (1.009)                                              | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | CNH                    | 163.281                  | 22.582                           | 0                                  | (299)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | SGD                    | 54.379                   | 42.146                           | 0                                  | (655)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | THB                    | 597.147                  | 18.484                           | 49                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 131.303                  | 4.053                            | 0                                  | (511)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 15.762 CNH               | 113.058                          | 81                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2.893 CNY                | 20.666                           | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 630 EGP                  | 34.694                           | 55                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 11 \$                    | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | €                      | 52                       | 60                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 455                      | 624                              | 1                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 414.091                  | 2.866                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 717 €                    | 612                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.339 £                  | 976                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 22.173 ¥                 | 3.233.492                        | 213                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 497 MYR                  | 2.103                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 741 NOK                  | 7.472                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 33 PLN                   | 123                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 117.950                  | 16.475                           | 0                                  | (53)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 3.221.605                | 22.173                           | 0                                  | (213)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | NOK                    | 7.471                    | 741                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.023 CNH                | 14.621                           | 26                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 757 CNY                  | 5.413                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | CAD                    | 11.378 \$                | 8.001                            | 0                                  | (366)                                                | (0,01)                  |
|            | 12.2025          | CZK                    | 46.101 €                 | 1.827                            | 0                                  | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 169.100 \$               | 1.175                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 47.722                   | 6.668                            | 0                                  | (19)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 193                      | 56                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | TWD                    | 10.065                   | 346                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 4.679 CNY                | 33.558                           | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 410 EGP                  | 22.185                           | 34                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.470 £                  | 1.824                            | 29                                 | 0                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| SOG        | 07.2025          | \$                     | 4.748 IDR                | 77.365.113                       | \$ 17                              | \$ 17                                                | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 1.740 ¥                  | 252.312                          | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 8.416 SGD                | 10.856                           | 107                                | 107                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 3.945 TWD                | 117.212                          | 90                                 | 90                                                   | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | CNH                    | 203.210                  | \$ 28.447                        | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | ¥                      | 3.997                    | 28                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | SGD                    | 10.831                   | 8.416                            | 0                                  | (109)                                                | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | TWD                    | 47.573                   | 1.458                            | 0                                  | (196)                                                | (0,01)                  |        |
|            | 08.2025          | \$                     | 3.021 INR                | 259.387                          | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | €                      | 51                       | \$ 58                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | RON                    | 893                      | 204                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.250 ¥                  | 469.066                          | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 77 NOK                   | 778                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | ¥                      | 467.345                  | \$ 3.250                         | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | NOK                    | 778                      | 77                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | \$                     | 11                       | HUF 3.881                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          |                        | 17 INR                   | 1.495                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
|            | 12.2025          |                        | 100 EGP                  | 5.455                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |        |
|            | SSB              | 07.2025                | £                        | 134.259                          | \$ 181.789                         | 0                                                    | (2.192)                 | (0,05) |
|            | UAG              | 08.2025                | \$                       | 22 CAD                           | 29                                 | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
| 01.2026    |                  | ¥                      | 1.520.000                | \$ 10.151                        | 0                                  | (586)                                                | (0,01)                  |        |
| 07.2025    |                  | ILS                    | 1.923                    | 536                              | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | ¥                      | 270.188                  | 1.867                            | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | KRW                    | 384.314                  | 284                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | RON                    | 678                      | 154                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | THB                    | 7.680                    | 231                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  | \$                     | 284                      | KRW 384.500                      | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |        |
| 07.2025    |                  |                        | 134 NOK                  | 1.361                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |        |
| 08.2025    |                  |                        | 37.896 CNH               | 271.802                          | 191                                | 191                                                  | 0,00                    |        |
| WST        | 09.2025          |                        | 8.001 CAD                | 11.373                           | 362                                | 362                                                  | 0,01                    |        |
|            | 12.2025          | €                      | 1.827 CZK                | 46.099                           | 33                                 | 33                                                   | 0,00                    |        |
|            | 12.2025          | TRY                    | 22.395                   | \$ 477                           | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |        |
|            | 07.2025          | AUD                    | 163.736                  | 105.574                          | 0                                  | (1.729)                                              | (0,04)                  |        |
|            | 07.2025          | €                      | 104.605                  | 118.174                          | 0                                  | (4.615)                                              | (0,11)                  |        |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.355.999                | € 1.156.354                      | 1.386                              | 1.386                                                | 0,03                    |        |
|            | 07.2025          |                        | 37.426 ¥                 | 5.389.738                        | 0                                  | (113)                                                | 0,00                    |        |
|            | 08.2025          | €                      | 1.156.354                | \$ 1.358.959                     | 0                                  | (1.388)                                              | (0,03)                  |        |
|            | 08.2025          | ¥                      | 5.369.902                | 37.426                           | 113                                | 113                                                  | 0,00                    |        |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$ 15.483                          | \$ (76.500)                                          | \$ (61.017)             | (1,49) |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                    | 191.957                  | \$ 124.695                       | \$ 0                               | \$ (1.104)                                           | (0,03)                  |        |
| BOA        | 08.2025          | \$                     | 124.768                  | AUD 191.957                      | 1.110                              | 0                                                    | 1.110                   | 0,03   |
|            | 07.2025          | AUD                    | 470                      | \$ 305                           | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     | 0,00   |
| BPS        | 07.2025          | \$                     | 322                      | AUD 495                          | 3                                  | 0                                                    | 3                       | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 291                      | 448                              | 3                                  | 0                                                    | 3                       | 0,00   |
| BRC        | 07.2025          | AUD                    | 259                      | \$ 167                           | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     | 0,00   |
| CBK        | 07.2025          | \$                     | 116.486                  | AUD 180.722                      | 1.950                              | 0                                                    | 1.950                   | 0,05   |
|            | 07.2025          | AUD                    | 492                      | \$ 321                           | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     | 0,00   |
| DUB        | 07.2025          | \$                     | 114                      | AUD 175                          | 1                                  | 0                                                    | 1                       | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 19                       | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00   |
| FAR        | 07.2025          | AUD                    | 190.822                  | \$ 124.760                       | 0                                  | (296)                                                | (296)                   | (0,01) |
|            | 07.2025          | \$                     | 121.221                  | AUD 187.882                      | 1.908                              | 0                                                    | 1.908                   | 0,04   |
| JPM        | 08.2025          |                        | 124.837                  | 190.822                          | 298                                | 0                                                    | 298                     | 0,01   |
|            | 07.2025          | AUD                    | 174.561                  | \$ 114.409                       | 10                                 | 0                                                    | 10                      | 0,00   |
| MBC        | 08.2025          | \$                     | 114.480                  | AUD 174.561                      | 0                                  | (9)                                                  | (9)                     | 0,00   |
|            | 07.2025          |                        | 1.053                    | 1.634                            | 17                                 | 0                                                    | 17                      | 0,00   |
| WST        | 07.2025          |                        | 120.688                  | 187.175                          | 1.977                              | 0                                                    | 1.977                   | 0,05   |
|            |                  |                        |                          | \$ 7.277                         | \$ (1.415)                         | \$ 5.862                                             | 0,14                    |        |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                    | 279.548                  | \$ 350.003                       | \$ 0                               | \$ (1.187)                                           | (0,03)                  |
| BOA        | 08.2025          | \$                     | 350.003                  | CHF 278.391                      | 1.188                              | 1.188                                                | 0,03                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.780                    | 2.265                            | 66                                 | 66                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        | 3.422                    | 2.815                            | 115                                | 115                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | CHF                    | 392                      | \$ 481                           | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.500                    | CHF 1.226                        | 41                                 | 41                                                   | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | CHF                    | 277.331                  | \$ 346.417                       | 0                                  | (1.989)                                              | (0,05)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 330.051                  | CHF 271.788                      | 11.392                             | 11.392                                               | 0,29                    |
|            | 08.2025          |                        | 346.417                  | 276.189                          | 1.997                              | 1.997                                                | 0,05                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| JPM        | 07.2025          | \$ 1.055               | CHF 864                  | \$ 31                            | \$ 0                               | \$ 31                                                | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | 333.739                | 274.219                  | 10.756                           | 0                                  | 10.756                                               | 0,27                    |
| MYI        | 07.2025          | 1.623                  | 1.313                    | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025          | 314.321                | 257.783                  | 9.528                            | 0                                  | 9.528                                                | 0,23                    |
| SCX        | 07.2025          | 461                    | 376                      | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 35.151                        | \$ (3.187)                         | \$ 31.964                                            | 0,79                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD 282                | \$ 183                   | \$ 0                             | \$ (2)                             | \$ (2)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD 85                 | 51                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1                   | CNH 10                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 629                    | € 537                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 537                  | \$ 630                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 183                 | AUD 282                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 14                     | CNH 98                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 25                     | NZD 41                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | CNY 9.824              | \$ 1.372                 | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 1                    | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 4                  | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 29                  | COP 120.757              | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 6.209                  | € 5.460                  | 200                              | 0                                  | 200                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          | 3                      | SGD 4                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | AUD 56                 | \$ 36                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 99                  | MXN 1.935                | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 8                      | CNH 54                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | CZK 4                  | \$ 0                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 2.884                | 3.345                    | 0                                | (40)                               | (40)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 387                  | 527                      | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3                   | £ 2                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 8                      | ¥ 1.085                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 134                    | MYR 567                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 71                     | PLN 268                  | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | COP 69.126             | \$ 17                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | MXN 114                | 6                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 524                 | £ 385                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | CAD 537                | \$ 392                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CLP 9.780              | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY 1.789              | 250                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK 221                | 34                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 7                    | 8                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 503                  | 684                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR 105.228            | 6                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 3                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK 516                | 54                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 0                   | CHF 0                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 10                     | CLP 9.780                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 6                      | CNH 44                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2.446                  | CNY 17.532               | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 64                     | DKK 421                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 8                      | £ 6                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 109                    | IDR 1.779.213            | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2                      | NOK 24                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 0                      | SEK 3                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 81                     | THB 2.655                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNY 30                 | \$ 4                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 10                  | CLP 9.780                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025          | 9                      | PEN 34                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | DKK 85                 | \$ 13                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 2.601                | 3.018                    | 0                                | (36)                               | (36)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN 151                | 41                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 6                   | SGD 7                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 13                     | DKK 84                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 3.018                  | € 2.596                  | 36                               | 0                                  | 36                                                   | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | CHF 54                 | \$ 68                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK 115                | 18                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 90.480               | 622                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MYR 300                | 70                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 418                 | AUD 647                  | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 158                    | CHF 130                  | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2                      | CNH 13                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2.318                  | ¥ 332.549                | 0                                | (16)                               | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 51                     | NZD 85                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 103                    | SEK 985                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 35                     | SGD 44                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD 56                 | \$ 37                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 25                 | 20                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 68                  | CHF 54                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 10                     | CNH 73                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 08.2025          | \$                     | 18 DKK                   | 115                              | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 622 ¥                    | 90.148                           | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | MYR                    | 33 \$                    | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | RON                    | 76                       | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 8 SGD                    | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNY                    | 101 \$                   | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | MXN                    | 1.007                    | 53                               | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 10                       | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| IND        | 07.2025          | SEK                    | 413                      | 44                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.388                    | 43                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 44 SEK                   | 412                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | AUD                    | 309 \$                   | 201                              | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 390                      | 284                              | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 76                       | 94                               | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | COP                    | 120.757                  | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CZK                    | 2                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 550                      | 639                              | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 4                        | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 74                       | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 34.766                   | 239                              | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 135                      | 37                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 59                       | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 110                      | 85                               | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.267                    | 39                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 747 CAD                  | 1.026                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2 CNY                    | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 44 €                     | 38                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 35 ILS                   | 124                              | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 123 ¥                    | 17.699                           | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 332 KRW                  | 455.587                          | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5 PLN                    | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 47 SGD                   | 60                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNY                    | 17 \$                    | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 284 CAD                  | 389                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 29 COP                   | 120.757                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 0 CZK                    | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 37 PLN                   | 135                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 49 SGD                   | 63                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| RBC        | 08.2025          |                        | 39 THB                   | 1.260                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 99 \$                    | 72                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MYR                    | 234                      | 55                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 55 MYR                   | 234                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | NOK                    | 157 \$                   | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | CNY                    | 5.950                    | 831                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 190.029                  | 1.311                            | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MXN                    | 1.930                    | 100                              | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 13                       | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 87 CNH                   | 623                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 28                       | 202                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 831 CNY                  | 5.934                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 10 ¥                     | 1.458                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 100 MXN                  | 1.930                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 10 SGD                   | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | CZK                    | 416 \$                   | 19                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 937.243                  | 57                               | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 44.352                   | 307                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 94                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 48 CZK                   | 1.057                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 28 RON                   | 122                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 307 ¥                    | 44.190                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 9 NOK                    | 94                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | KRW                    | 277.745 \$               | 203                              | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.199 £                  | 884                              | 13                                 | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 77 \$                    | 106                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 5 CNH                    | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | CNH                    | 634 \$                   | 88                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CZK                    | 634                      | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR                    | 736.742                  | 45                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 177.842                  | 130                              | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | MXN                    | 5                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 0 CNH                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 14 HUF                   | 4.953                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 61 ¥                     | 8.821                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 22 NOK                   | 227                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 88 CNH                   | 632                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 30 CZK                   | 634                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 45 IDR                   | 736.742                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 131 KRW                  | 177.842                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 312                           | \$ (143)                           | \$ 169                                               | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |    |         |    |         |        |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|----|---------|----|---------|--------|
| AZD        | 07.2025          | €                   | 337.885               | \$                            | 395.623                         | \$                                             | 0                    | \$ | (1.004) | \$ | (1.004) | (0,02) |
|            | 08.2025          | \$                  | 396.490               | €                             | 337.885                         |                                                | 1.002                |    | 0       |    | 1.002   | 0,02   |
| BOA        | 07.2025          |                     | 426.992               |                               | 375.526                         |                                                | 13.820               |    | 0       |    | 13.820  | 0,34   |
|            | 07.2025          | €                   | 1.769                 | \$                            | 2.040                           |                                                | 0                    |    | (37)    |    | (37)    | 0,00   |
| BRC        | 07.2025          |                     | 5.388                 |                               | 6.165                           |                                                | 0                    |    | (160)   |    | (160)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                  | 420.111               | €                             | 369.923                         |                                                | 14.124               |    | 0       |    | 14.124  | 0,35   |
| CBK        | 07.2025          | €                   | 3.582                 | \$                            | 4.120                           |                                                | 0                    |    | (86)    |    | (86)    | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                  | 682                   | €                             | 590                             |                                                | 11                   |    | 0       |    | 11      | 0,00   |
| DUB        | 07.2025          | €                   | 370.833               | \$                            | 430.203                         |                                                | 0                    |    | (5.100) |    | (5.100) | (0,13) |
|            | 08.2025          | \$                  | 430.203               | €                             | 370.020                         |                                                | 5.092                |    | 0       |    | 5.092   | 0,12   |
| MBC        | 07.2025          | €                   | 4.836                 | \$                            | 5.575                           |                                                | 0                    |    | (102)   |    | (102)   | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                  | 191                   | €                             | 165                             |                                                | 3                    |    | 0       |    | 3       | 0,00   |
| WST        | 07.2025          | €                   | 367.737               | \$                            | 431.227                         |                                                | 0                    |    | (441)   |    | (441)   | (0,01) |
|            | 07.2025          | \$                  | 390.961               | €                             | 346.069                         |                                                | 15.272               |    | 0       |    | 15.272  | 0,37   |
|            | 08.2025          |                     | 432.169               |                               | 367.737                         |                                                | 441                  |    | 0       |    | 441     | 0,01   |
|            |                  |                     |                       | \$                            | 49.765                          | \$                                             | (6.930)              | \$ | 42.835  |    |         | 1,05   |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £                      | 36.335                   | \$                               | 49.859                             | \$ 67                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 49.866                   | £                                | 36.335                             | (67)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | £                      | 38.046                   | \$                               | 51.760                             | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 50.079                   | £                                | 37.052                             | (377)                                                | 0,02                    |
|            | 08.2025          |                        | 51.051                   |                                  | 37.515                             | (10)                                                 | 0,01                    |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    | 0                                                    |                         |
| CBK        | 07.2025          |                        | 7.263                    |                                  | 5.340                              | 366                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          |                        | 49.289                   |                                  | 36.587                             | 55                                                   | 0,02                    |
|            | 07.2025          | £                      | 1.219                    | \$                               | 1.650                              | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | \$                     | 494                      | £                                | 360                                | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 37.888                   | \$                               | 51.952                             | (2)                                                  | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | \$                     | 50.057                   | £                                | 36.969                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 51.959                   |                                  | 37.888                             | 32                                                   | 0,01                    |
| UAG        | 07.2025          | £                      | 2.819                    | \$                               | 3.819                              | 604                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    | (31)                                                 | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 2.677                         | \$ (552)                           | (45)                                                 | 0,05                    |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 2.125                                             |                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat |     | Zu zahlende<br>Währung |     | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |    |       |      |
|------------|------------------|-----|------------------------|-----|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|----|-------|------|
| BRC        | 07.2025          | \$  | 230.625                | NOK | 2.349.153                | \$                               | 1.512                              | \$                                                   | 0,04                    |    |       |      |
| CBK        | 07.2025          | NOK | 63.371                 | \$  | 6.277                    |                                  | 15                                 |                                                      | 0,00                    |    |       |      |
|            | 07.2025          | \$  | 68.631                 | NOK | 699.573                  |                                  | 498                                |                                                      | 0,01                    |    |       |      |
| FAR        | 07.2025          |     | 19.011                 |     | 193.238                  |                                  | 85                                 |                                                      | 0,00                    |    |       |      |
| MBC        | 07.2025          | NOK | 4.001                  | \$  | 398                      |                                  | 2                                  |                                                      | 0,00                    |    |       |      |
| MYI        | 07.2025          |     | 2.191.187              |     | 217.227                  |                                  | 701                                |                                                      | 0,02                    |    |       |      |
|            | 07.2025          | \$  | 165.691                | NOK | 1.684.704                |                                  | 787                                |                                                      | 0,02                    |    |       |      |
|            | 08.2025          |     | 217.227                |     | 2.190.785                |                                  | 0                                  | (699)                                                | (0,02)                  |    |       |      |
|            | 07.2025          | NOK | 7.201                  | \$  | 716                      |                                  | 4                                  |                                                      | 0,00                    |    |       |      |
| RYL        | 07.2025          | \$  | 509                    | NOK | 5.065                    |                                  | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |    |       |      |
|            | 07.2025          | NOK | 2.321.563              | \$  | 231.228                  | 1.817                            | 0                                  | 1.817                                                | 0,04                    |    |       |      |
| SOG        | 08.2025          | \$  | 231.228                | NOK | 2.321.118                | 0                                | (1.817)                            | (1.817)                                              | (0,04)                  |    |       |      |
|            | 07.2025          |     | 214.524                |     | 2.178.510                | 751                              | 0                                  | 751                                                  | 0,02                    |    |       |      |
|            |                  |     |                        |     |                          | \$                               | 6.172                              | \$                                                   | (2.525)                 | \$ | 3.647 | 0,09 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | NZD                    | 21.110                   | \$ 12.704                        | \$ 0                               | \$ (111)                                             | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 12.718                   | NZD 21.110                       | 111                                | 111                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          |                        | 12.401                   | 20.749                           | 195                                | 195                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | NZD                    | 118                      | \$ 71                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 11.913                   | NZD 19.972                       | 212                                | 212                                                  | 0,01                    |
| SOG        | 07.2025          | NZD                    | 19.260                   | \$ 11.691                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 11.703                   | NZD 19.260                       | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          | NZD                    | 20.993                   | \$ 12.720                        | 0                                  | (24)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 12.380                   | NZD 20.758                       | 221                                | 221                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 12.733                   | 20.993                           | 24                                 | 24                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 764                           | \$ (137)                           | \$ 627                                               | 0,02                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA                              | 07.2025          | SEK 412             | \$ 43                 | \$ 0                          | \$ 0                          | \$ 0                                          | 0,00                 |
| BPS                              | 07.2025          | \$ 657              | SEK 6.319             | 6                             | 0                             | 6                                             | 0,00                 |
| BRC                              | 07.2025          | 63                  | 606                   | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| CBK                              | 07.2025          | SEK 220.306         | \$ 23.243             | 127                           | 0                             | 127                                           | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 194              | SEK 1.857             | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | 23.095              | 218.424               | 0                             | (128)                         | (128)                                         | 0,00                 |
| FAR                              | 07.2025          | 22.442              | 214.951               | 112                           | 0                             | 112                                           | 0,00                 |
| IND                              | 07.2025          | SEK 216.644         | \$ 22.900             | 168                           | 0                             | 168                                           | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$ 22.900           | SEK 216.178           | 0                             | (168)                         | (168)                                         | 0,00                 |
| MBC                              | 07.2025          | SEK 761             | \$ 80                 | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| MYI                              | 07.2025          | \$ 20.784           | SEK 199.737           | 174                           | 0                             | 174                                           | 0,00                 |
| RYL                              | 07.2025          | SEK 3.153           | \$ 333                | 2                             | 0                             | 2                                             | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 391              | SEK 3.707             | 1                             | (3)                           | (2)                                           | 0,00                 |
| SCX                              | 07.2025          | SEK 111             | \$ 12                 | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| UAG                              | 07.2025          | \$ 22.442           | SEK 215.638           | 185                           | 0                             | 185                                           | 0,01                 |
|                                  |                  |                     |                       | \$ 775                        | \$ (299)                      | \$ 476                                        | 0,01                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                               | \$ 24.632                                     | 0,60                 |

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                          | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---------------------------------------|-------------|-------------------|-----------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>          |             |                   |                       |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |             |                   |                       |
| 2,000 % fällig am 01.07.2040          | \$ 44.600   | \$ (40.766)       | (1,00)                |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055          | 180.950     | (143.286)         | (3,51)                |
| 2,000 % fällig am 01.08.2055          | 100.000     | (79.217)          | (1,94)                |
| 2,500 % fällig am 01.08.2055          | 12.500      | (10.368)          | (0,25)                |
| 4,000 % fällig am 01.08.2055          | 13.800      | (12.831)          | (0,32)                |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055          | 23.110      | (22.097)          | (0,54)                |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055          | 49.600      | (49.556)          | (1,22)                |
| 6,500 % fällig am 01.07.2055 (d)      | 24.524      | (25.324)          | (0,62)                |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere       |             | \$ (383.445)      | (9,40)                |
| Summe Anlagen                         |             | \$ 5.517.938      | 135,23                |
| Sonstige Aktiva und Passiva           |             | \$ (1.437.600)    | (35,23)               |
| Nettovermögen                         |             | \$ 4.080.338      | 100,00                |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (d) Ein zum 30. Juni 2025 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (e) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 225.740 USD (31. Dezember 2024: 190.575 USD) und Barmittel in Höhe von 46 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten verpfändet.
- (f) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 25.214 USD (31. Dezember 2024: 59.644 USD) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 448 USD (31. Dezember 2024: 310 USD) als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 101.376 USD (31. Dezember 2024: 61.815 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 31.020 USD (31. Dezember 2024: 43.880 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 5.848.999                                                    | \$ 26.507                                                    | \$ 5.875.506 |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 3.564                                                                       | 22.313                                                          | 0                                                            | 25.877       |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (383.445)                                                       | 0                                                            | (383.445)    |
| Summen                        | \$ 3.564                                                                    | \$ 5.487.867                                                    | \$ 26.507                                                    | \$ 5.517.938 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 4.666.236                                                    | \$ 8.202                                                     | \$ 4.674.438        |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 8.600                                                           | 0                                                            | 8.600               |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 3.041                                                                       | (42.315)                                                        | 0                                                            | (39.274)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (817.849)                                                       | 0                                                            | (817.849)           |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 3.041</b>                                                             | <b>\$ 3.814.672</b>                                             | <b>\$ 8.202</b>                                              | <b>\$ 3.825.915</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                       | 4,250 %    | 18.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (850)     | \$ (851)                                    | (0,02)                  |
|                                           | 4,270      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (5.567)      | (5.572)                                     | (0,14)                  |
|                                           | 4,410      | 23.06.2025       | 07.07.2025         | (50.667)     | (50.717)                                    | (1,24)                  |
| BPS                                       | 4,410      | 04.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (962)        | (973)                                       | (0,02)                  |
| BRC                                       | 1,300      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (520)      | (612)                                       | (0,02)                  |
|                                           | 4,400      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (4.637)   | (4.747)                                     | (0,12)                  |
|                                           | 4,550      | 30.06.2025       | 01.07.2025         | (1.486)      | (1.486)                                     | (0,04)                  |
| MYI                                       | 1,750      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | (2.005)      | (2.023)                                     | (0,05)                  |
| SCX                                       | 4,250      | 07.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (987)        | (997)                                       | (0,02)                  |
| STR                                       | 4,490      | 30.06.2025       | 01.07.2025         | (154.000)    | (154.019)                                   | (3,77)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                    |              | <b>\$ (221.997)</b>                         | <b>(5,44)</b>           |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                   | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für<br>Rückkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                          | 4,450 %    | 23.06.2025       | 07.07.2025       | \$ (9.863)   | \$ (9.872)                                                             | (0,24)                  |
| BRC                                          | 4,450      | 18.06.2025       | 16.07.2025       | (10.844)     | (10.862)                                                               | (0,27)                  |
| TDL                                          | 4,440      | 20.06.2025       | 18.07.2025       | (4.469)      | (4.475)                                                                | (0,11)                  |
| <b>Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b> |            |                  |                  |              | <b>\$ (25.209)</b>                                                     | <b>(0,62)</b>           |

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 37 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (141)                            | \$ 30                                 | \$ (111)                        | \$ (618)                            | \$ 570                                | \$ (48)                         |
| BOA        | 13.927                              | (13.250)                              | 677                             | 1.297                               | (1.150)                               | 147                             |
| BPS        | (92)                                | 300                                   | 208                             | (871)                               | 700                                   | (171)                           |
| BRC        | (26.914)                            | 23.470                                | (3.444)                         | (8.636)                             | 5.590                                 | (3.046)                         |
| BSH        | (70)                                | (20)                                  | (90)                            | (25)                                | 0                                     | (25)                            |
| CBK        | (2.769)                             | 2.820                                 | 51                              | 5.874                               | (3.030)                               | 2.844                           |
| DUB        | (480)                               | 430                                   | (50)                            | (54)                                | 0                                     | (54)                            |
| FAR        | 16.095                              | (14.070)                              | 2.025                           | (6.408)                             | 5.680                                 | (728)                           |
| GLM        | 119                                 | (210)                                 | (91)                            | 1.817                               | (1.760)                               | 57                              |
| GST        | (2.101)                             | (60)                                  | (2.161)                         | 2.766                               | 120                                   | 2.886                           |
| IND        | (87)                                | 0                                     | (87)                            | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| JPM        | (1.191)                             | 1.490                                 | 299                             | 2.734                               | (1.500)                               | 1.234                           |
| MBC        | 7.975                               | (6.440)                               | 1535                            | (16.979)                            | 15.740                                | (1.239)                         |
| MYC        | (178)                               | 60                                    | (118)                           | (180)                               | 310                                   | 130                             |
| MYI        | 777                                 | (1.560)                               | (783)                           | 169                                 | 0                                     | 169                             |
| RBC        | 9.528                               | (7.830)                               | 1.698                           | 38                                  | 0                                     | 38                              |
| RYL        | (20)                                | 0                                     | (20)                            | 102                                 | 0                                     | 102                             |
| SCX        | (19)                                | 0                                     | (19)                            | (1.109)                             | 3.500                                 | 2.391                           |
| SOG        | 2                                   | 0                                     | 2                               | (55)                                | 0                                     | (55)                            |
| SSB        | (2.163)                             | 2.420                                 | 257                             | (82)                                | 0                                     | (82)                            |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (8.354)                             | 7.600                                 | (754)                           |
| UAG        | 1310                                | (1.940)                               | (630)                           | (4.050)                             | 4.070                                 | 20                              |
| WST        | 11.124                              | (10.550)                              | 574                             | 2.379                               | (2.630)                               | (251)                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 35,80             | 31,17             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 25,00             | 28,32             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,36              | k. A.             |
| Pensionsgeschäfte                                                      | k. A.             | 0,11              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,23              | 0,14              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,29              | 0,32              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,25              | 0,81              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 37,07             | 39,13             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,22              | k. A.             |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 30,06             | 28,04             |
| Kommunalanleihen und Wechsel                                                           | 0,09              | 0,09              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 54,40             | 45,13             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 11,76             | 8,95              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 3,64              | 3,74              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 5,42              | 6,27              |
| Staatsemissionen                                                                       | 38,41             | 24,88             |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | k. A.             | 0,81              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | k. A.             | 0,22              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,45              | 0,13              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                                  | 0,02              | k. A.             |
| Zinsswaps                                                                              | (0,44)            | (0,36)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | 0,04              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | 0,08              |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | k. A.             | 0,03              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,01)            | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,08)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | (0,01)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | k. A.             | 0,00              |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | (0,05)            | 0,20              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (1,49)            | 1,19              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 2,16              | (2,20)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (9,40)            | (20,63)           |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (35,23)           | 3,49              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

Halbjahresbericht | 30. Juni 2025 533



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                          | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>UNGARN</b>                         |             |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |             |                          |                                   |
| Hungary Government International Bond |             |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 25.07.2029          | € 1.000     | \$ 1.206                 | 0,13                              |
| 4,500 % fällig am 16.06.2034          | 1.000       | 1.185                    | 0,13                              |
| 6,250 % fällig am 22.09.2032          | \$ 1.000    | 1.045                    | 0,11                              |
| Magyar Export-Import Bank             |             |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 27.11.2031          | € 1.200     | 1.433                    | 0,15                              |
| Summe Ungarn                          |             | 4.869                    | 0,52                              |

|                                               |       |        |      |
|-----------------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>IRLAND</b>                                 |       |        |      |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>       |       |        |      |
| Accunia European CLO DAC                      |       |        |      |
| 3,229 % fällig am 15.07.2030                  | 147   | 173    | 0,02 |
| Aurium CLO DAC                                |       |        |      |
| 2,982 % fällig am 16.01.2031                  | 2.011 | 2.358  | 0,25 |
| Black Diamond CLO DAC                         |       |        |      |
| 3,123 % fällig am 15.05.2032                  | 1.341 | 1.574  | 0,17 |
| BNPP AM Euro CLO DAC                          |       |        |      |
| 3,056 % fällig am 22.07.2032                  | 2.197 | 2.572  | 0,27 |
| Cairn CLO DAC                                 |       |        |      |
| 3,059 % fällig am 15.10.2031                  | 619   | 726    | 0,08 |
| Carlyle Euro CLO DAC                          |       |        |      |
| 2,979 % fällig am 15.01.2031                  | 858   | 1.007  | 0,11 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC |       |        |      |
| 3,212 % fällig am 16.01.2033                  | 1.749 | 2.055  | 0,22 |
| Dryden Euro CLO DAC                           |       |        |      |
| 2,939 % fällig am 15.04.2033                  | 905   | 1.062  | 0,11 |
| 3,003 % fällig am 15.05.2034                  | 864   | 1.013  | 0,11 |
| Euro-Galaxy CLO DAC                           |       |        |      |
| 2,988 % fällig am 25.07.2035                  | 3.200 | 3.741  | 0,40 |
| Griffith Park CLO DAC                         |       |        |      |
| 2,795 % fällig am 21.11.2031                  | 439   | 515    | 0,05 |
| Harvest CLO DAC                               |       |        |      |
| 2,916 % fällig am 20.10.2031                  | 716   | 841    | 0,09 |
| 3,039 % fällig am 15.07.2031                  | 1.562 | 1.834  | 0,19 |
| 3,129 % fällig am 15.01.2032                  | 1.973 | 2.315  | 0,24 |
| Jubilee CLO DAC                               |       |        |      |
| 2,929 % fällig am 15.04.2031                  | 778   | 909    | 0,10 |
| Madison Park Euro Funding DAC                 |       |        |      |
| 3,079 % fällig am 15.07.2032                  | 2.194 | 2.569  | 0,27 |
| Oak Hill European Credit Partners DAC         |       |        |      |
| 2,976 % fällig am 20.10.2031                  | 1.081 | 1.267  | 0,13 |
| Sculptor European CLO DAC                     |       |        |      |
| 3,055 % fällig am 14.01.2032                  | 3.225 | 3.781  | 0,40 |
| Segovia European CLO DAC                      |       |        |      |
| 3,116 % fällig am 20.07.2032                  | 1.815 | 2.133  | 0,22 |
| Sound Point Euro CLO Funding DAC              |       |        |      |
| 2,978 % fällig am 25.05.2034                  | 4.500 | 5.260  | 0,56 |
| Toro European CLO DAC                         |       |        |      |
| 2,953 % fällig am 15.02.2034                  | 2.170 | 2.539  | 0,27 |
| Summe Irland                                  |       | 40.244 | 4,26 |

|                                      |         |        |      |
|--------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>ISRAEL</b>                        |         |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |         |        |      |
| Israel Government International Bond |         |        |      |
| 4,500 % fällig am 17.01.2033         | \$ 500  | 478    | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 30.10.2026         | € 5.400 | 6.518  | 0,69 |
| 5,375 % fällig am 12.03.2029         | \$ 700  | 715    | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 19.02.2030         | 200     | 204    | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 12.03.2034         | 1.200   | 1.217  | 0,13 |
| 5,625 % fällig am 19.02.2035         | 1.700   | 1.731  | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 12.03.2054         | 600     | 557    | 0,06 |
| Summe Israel                         |         | 11.420 | 1,21 |

|                                         |        |       |      |
|-----------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>ITALIEN</b>                          |        |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |       |      |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA     |        |       |      |
| 0,875 % fällig am 08.10.2027            | € 200  | 231   | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 05.09.2027            | 700    | 859   | 0,09 |
| Intesa Sanpaolo SpA                     |        |       |      |
| 6,625 % fällig am 20.06.2033            | \$ 600 | 652   | 0,07 |
|                                         |        | 1.742 | 0,19 |

| BESCHREIBUNG                        | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>             |             |                          |                                   |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA       |             |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 05.05.2026        | \$ 1.100    | \$ 1.111                 | 0,12                              |
| Italy Government International Bond |             |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028        | £ 100       | 143                      | 0,01                              |
|                                     |             | 1.254                    | 0,13                              |
| Summe Italien                       |             | 2.996                    | 0,32                              |

|                                         |         |       |      |
|-----------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>JAPAN</b>                            |         |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |       |      |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp.           |         |       |      |
| 0,409 % fällig am 07.11.2029            | € 1.800 | 1.918 | 0,20 |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.         |         |       |      |
| 0,010 % fällig am 15.10.2027            | 2.000   | 2.225 | 0,24 |
|                                         |         | 4.143 | 0,44 |

|                                     |             |        |      |
|-------------------------------------|-------------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>             |             |        |      |
| Japan Government International Bond |             |        |      |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)    | ¥ 1.083.965 | 7.771  | 0,82 |
| 0,400 % fällig am 20.06.2029        | 320.000     | 2.172  | 0,23 |
| 0,400 % fällig am 20.06.2040        | 421.000     | 2.308  | 0,24 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049        | 334.000     | 1.474  | 0,16 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048        | 968.000     | 4.538  | 0,48 |
| 0,700 % fällig am 20.09.2051        | 660.000     | 2.855  | 0,30 |
| 1,500 % fällig am 20.09.2043        | 366.000     | 2.246  | 0,24 |
| 1,600 % fällig am 20.12.2053        | 150.000     | 796    | 0,08 |
| 1,800 % fällig am 20.09.2044        | 650.000     | 4.134  | 0,44 |
| 1,800 % fällig am 20.03.2054        | 688.000     | 3.825  | 0,41 |
| 2,000 % fällig am 20.12.2044        | 2.005.000   | 13.144 | 1,39 |
| 2,100 % fällig am 20.09.2054        | 270.000     | 1.606  | 0,17 |
| 2,200 % fällig am 20.06.2054        | 229.000     | 1.395  | 0,15 |
| 2,200 % fällig am 20.03.2064        | 717.000     | 3.991  | 0,42 |
| 2,300 % fällig am 20.12.2054        | 748.000     | 4.655  | 0,49 |
| 2,400 % fällig am 20.03.2045        | 244.000     | 1.701  | 0,18 |
| 2,400 % fällig am 20.03.2055        | 526.000     | 3.346  | 0,35 |
| Tokyo Metropolitan Government       |             |        |      |
| 0,750 % fällig am 16.07.2025        | \$ 800      | 799    | 0,09 |
|                                     |             | 62.756 | 6,64 |
| Summe Japan                         |             | 66.899 | 7,08 |

|                                         |         |       |      |
|-----------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>LUXEMBURG</b>                        |         |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |       |      |
| CIMA Luxembourg SARL                    |         |       |      |
| 1,000 % fällig am 13.03.2027 (g)        | € 1.900 | 2.241 | 0,24 |
| <b>MALAYSIA</b>                         |         |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |       |      |
| Petronas Capital Ltd.                   |         |       |      |
| 2,480 % fällig am 28.01.2032            | \$ 400  | 349   | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 21.04.2030            | 400     | 384   | 0,04 |
| 4,550 % fällig am 21.04.2050            | 300     | 255   | 0,03 |
| 4,800 % fällig am 21.04.2060            | 300     | 258   | 0,03 |
|                                         |         | 1.246 | 0,13 |

|                                        |        |        |      |
|----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                |        |        |      |
| Malaysia Government International Bond |        |        |      |
| 2,632 % fällig am 15.04.2031 MYR       | 4.500  | 1.030  | 0,11 |
| 3,519 % fällig am 20.04.2028           | 44.429 | 10.665 | 1,13 |
| 3,582 % fällig am 15.07.2032           | 2.040  | 491    | 0,05 |
| Malaysia Government Investment Issue   |        |        |      |
| 4,193 % fällig am 07.10.2032           | 11.010 | 2.744  | 0,29 |
|                                        |        | 14.930 | 1,58 |
| Summe Malaysia                         |        | 16.176 | 1,71 |

|                                         |        |     |      |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>MEXIKO</b>                           |        |     |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |        |     |      |
| Mexico Government International Bond    |        |     |      |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115            | € 400  | 313 | 0,03 |
| <b>MULTINATIONAL</b>                    |        |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |
| Preferred Term Securities Ltd.          |        |     |      |
| 4,972 % fällig am 23.06.2035            | \$ 415 | 396 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG                            | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>NIEDERLANDE</b>                      |             |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |             |                          |                                   |
| ABN AMRO Bank NV                        |             |                          |                                   |
| 5,515 % fällig am 03.12.2035            | \$ 1.600    | \$ 1.631                 | 0,17                              |
| Coöperatieve Rabobank UA                |             |                          |                                   |
| 3,758 % fällig am 06.04.2033            | 600         | 560                      | 0,06                              |
| CTP NV                                  |             |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am 27.09.2026            | € 204       | 233                      | 0,03                              |
| 0,875 % fällig am 20.01.2026            | 335         | 390                      | 0,04                              |
| de Volksbank NV                         |             |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 26.03.2031            | 1.500       | 1.785                    | 0,19                              |
| Enel Finance International NV           |             |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 23.07.2028            | 800         | 961                      | 0,10                              |
| ING Groep NV                            |             |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 12.02.2035            | 1.000       | 1.214                    | 0,13                              |
| 5,550 % fällig am 19.03.2035            | \$ 400      | 410                      | 0,04                              |
|                                         |             | 7.184                    | 0,76                              |

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>        |       |       |      |
| Jubilee Place BV             |       |       |      |
| 3,263 % fällig am 17.10.2057 | € 583 | 685   | 0,07 |
| Summe Niederlande            |       | 7.869 | 0,83 |

|                                           |     |     |      |
|-------------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>NEUSEELAND</b>                         |     |     |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |     |     |      |
| New Zealand Government International Bond |     |     |      |
| 1,500 % fällig am 15.05.2031 NZD          | 600 | 316 | 0,03 |

|                                         |         |       |      |
|-----------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>NORWEGEN</b>                         |         |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |       |      |
| SR-Boligkredit A/S                      |         |       |      |
| 3,125 % fällig am 19.02.2032            | € 1.700 | 2.031 | 0,21 |

|                                  |       |       |      |
|----------------------------------|-------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>          |       |       |      |
| Kommunalbanken A/S               |       |       |      |
| 1,900 % fällig am 19.01.2027 AUD | 1.600 | 1.022 | 0,11 |
| Summe Norwegen                   |       | 3.053 | 0,32 |

|                                              |           |     |      |
|----------------------------------------------|-----------|-----|------|
| <b>PERU</b>                                  |           |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |           |     |      |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |           |     |      |
| 10,100 % fällig am 15.12.2043                | PEN 3.200 | 958 | 0,10 |

|                                    |       |       |      |
|------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |       |       |      |
| Peru Government International Bond |       |       |      |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032       | 100   | 29    | 0,00 |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037       | 7.000 | 2.011 | 0,21 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031       | 3.761 | 1.152 | 0,12 |
| 7,300 % fällig am 12.08.2033       | 7.000 | 2.153 | 0,23 |
| 7,600 % fällig am 12.08.2039       | 4.900 | 1.473 | 0,16 |
|                                    |       | 6.818 | 0,72 |
| Summe Peru                         |       | 7.776 | 0,82 |

|                                      |        |       |      |
|--------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>POLEN</b>                         |        |       |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |        |       |      |
| Bank Gospodarstwa Krajowego          |        |       |      |
| 3,250 % fällig am 18.03.2030         | € 700  | 833   | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 18.03.2037         | 400    | 473   | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 13.03.2039         | 700    | 820   | 0,09 |
| Poland Government International Bond |        |       |      |
| 3,625 % fällig am 11.01.2034 (i)     | 600    | 721   | 0,08 |
| 4,125 % fällig am 11.01.2044         | 400    | 465   | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 14.02.2043         | 200    | 236   | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 12.02.2030         | \$ 800 | 817   | 0,09 |
| 4,875 % fällig am 04.10.2033         | 500    | 498   | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 12.02.2035         | 500    | 510   | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 04.04.2053         | 400    | 373   | 0,04 |
| Summe Polen                          |        | 5.746 | 0,61 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>PORTUGAL</b>                         |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| Banco Espirito Santo S.A.               |       |     |      |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^          | € 400 | 110 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | € 700          | \$ 193                   | 0,02                              |
| Summe Portugal                 |                | 303                      | 0,03                              |

#### KATAR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |        |     |      |
|------------------------------|--------|-----|------|
| QatarEnergy                  |        |     |      |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031 | \$ 400 | 351 | 0,04 |

#### RUMÄNIEN STAATSEMISSIONEN

|                                       |         |        |      |
|---------------------------------------|---------|--------|------|
| Romania Government International Bond |         |        |      |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030          | € 1.000 | 1.009  | 0,11 |
| 2,000 % fällig am 28.01.2032          | 600     | 572    | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2033          | 700     | 631    | 0,07 |
| 2,124 % fällig am 16.07.2031          | 400     | 391    | 0,04 |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040          | 600     | 439    | 0,05 |
| 2,750 % fällig am 14.04.2041          | 300     | 220    | 0,02 |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042          | 500     | 366    | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 27.09.2026          | 1.700   | 2.052  | 0,22 |
| 5,125 % fällig am 24.09.2031          | 2.200   | 2.552  | 0,27 |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030          | 1.500   | 1.800  | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 30.05.2032          | 900     | 1.041  | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 22.02.2036          | 300     | 336    | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 30.05.2037 (i)      | 600     | 664    | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 10.09.2034          | 300     | 356    | 0,04 |
| Summe Rumänien                        |         | 12.429 | 1,32 |

#### SAUDI-ARABIEN STAATSEMISSIONEN

|                                            |          |        |      |
|--------------------------------------------|----------|--------|------|
| Saudi Arabia Government International Bond |          |        |      |
| 3,250 % fällig am 22.10.2030               | \$ 400   | 375    | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 05.03.2032               | € 1.400  | 1.638  | 0,17 |
| 3,750 % fällig am 05.03.2037               | 300      | 343    | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 18.01.2028               | \$ 1.900 | 1.916  | 0,20 |
| 4,750 % fällig am 16.01.2030               | 1.400    | 1.415  | 0,15 |
| 4,875 % fällig am 18.07.2033               | 900      | 904    | 0,10 |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028               | 2.900    | 2.949  | 0,31 |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031               | 2.000    | 2.076  | 0,22 |
| Summe Saudi-Arabien                        |          | 11.616 | 1,23 |

#### SERBIEN STAATSEMISSIONEN

|                                      |       |       |      |
|--------------------------------------|-------|-------|------|
| Serbia Government International Bond |       |       |      |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028         | € 600 | 651   | 0,07 |
| 2,050 % fällig am 23.09.2036         | 900   | 804   | 0,09 |
| Summe Serbien                        |       | 1.455 | 0,16 |

#### SINGAPUR UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |         |        |      |
|------------------------------|---------|--------|------|
| DBS Bank Ltd.                |         |        |      |
| 4,789 % fällig am 14.05.2027 | £ 4.200 | 5.763  | 0,61 |
| Maybank Singapore Ltd.       |         |        |      |
| 3,439 % fällig am 07.06.2027 | € 3.700 | 4.449  | 0,47 |
|                              |         | 10.212 | 1,08 |

#### STAATSEMISSIONEN

|                                         |         |        |      |
|-----------------------------------------|---------|--------|------|
| Singapore Government International Bond |         |        |      |
| 2,375 % fällig am 01.07.2039            | SGD 803 | 635    | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 01.03.2035            | 3.620   | 2.974  | 0,32 |
| 3,250 % fällig am 01.06.2054            | 4.955   | 4.631  | 0,49 |
|                                         |         | 8.240  | 0,88 |
| Summe Singapur                          |         | 18.452 | 1,96 |

#### SÜDAFRIKA STAATSEMISSIONEN

|                                            |            |       |      |
|--------------------------------------------|------------|-------|------|
| South Africa Government International Bond |            |       |      |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030               | ZAR 43.100 | 2.385 | 0,25 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035               | 89.200     | 4.687 | 0,50 |
| Summe Südafrika                            |            | 7.072 | 0,75 |

#### SÜDKOREA UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |         |       |      |
|------------------------------|---------|-------|------|
| KEB Hana Bank                |         |       |      |
| 2,875 % fällig am 23.01.2028 | € 5.700 | 6.753 | 0,71 |

| BESCHREIBUNG | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
|--------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|

#### STAATSEMISSIONEN

|                                           |                |          |      |
|-------------------------------------------|----------------|----------|------|
| Korea Development Bank                    |                |          |      |
| 4,625 % fällig am 15.02.2027              | \$ 2.600       | \$ 2.618 | 0,28 |
| Korea Housing Finance Corp.               |                |          |      |
| 3,124 % fällig am 18.03.2029              | € 1.800        | 2.154    | 0,23 |
| South Korea Government International Bond |                |          |      |
| 2,625 % fällig am 10.06.2028              | KRW 15.383.190 | 11.438   | 1,21 |
|                                           |                | 16.210   | 1,72 |
| Summe Südkorea                            |                | 22.963   | 2,43 |

#### SPANIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |          |       |      |
|------------------------------|----------|-------|------|
| Banco Santander S.A.         |          |       |      |
| 6,607 % fällig am 07.11.2028 | \$ 1.000 | 1.067 | 0,11 |

#### STAATSEMISSIONEN

|                                     |        |        |      |
|-------------------------------------|--------|--------|------|
| Autonomous Community of Catalonia   |        |        |      |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035        | € 400  | 483    | 0,05 |
| Spain Government International Bond |        |        |      |
| 0,000 % fällig am 31.01.2028 (c)    | 8.050  | 8.963  | 0,95 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2071        | 2.200  | 1.196  | 0,13 |
| 1,900 % fällig am 31.10.2052        | 300    | 233    | 0,02 |
| 2,400 % fällig am 31.05.2028        | 5.450  | 6.442  | 0,68 |
| 2,500 % fällig am 31.05.2027        | 2.300  | 2.726  | 0,29 |
| 2,700 % fällig am 31.01.2030        | 8.900  | 10.560 | 1,12 |
| 3,150 % fällig am 30.04.2035        | 6.160  | 7.221  | 0,76 |
| 3,200 % fällig am 31.10.2035        | 4.900  | 5.738  | 0,61 |
| 3,450 % fällig am 30.07.2066        | 714    | 733    | 0,08 |
| 3,550 % fällig am 31.10.2033        | 11.300 | 13.809 | 1,46 |
| 5,250 % fällig am 06.04.2029        | £ 500  | 705    | 0,08 |
|                                     |        | 58.809 | 6,23 |
| Summe Spanien                       |        | 59.876 | 6,34 |

#### SUPRANATIONAL UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                       |           |       |      |
|---------------------------------------|-----------|-------|------|
| Rat der Europäischen Entwicklungsbank |           |       |      |
| 4,375 % fällig am 09.01.2028          | 2.300     | 3.183 | 0,34 |
| Inter-American Development Bank       |           |       |      |
| 2,500 % fällig am 14.04.2027          | AUD 1.300 | 837   | 0,09 |
| Summe Supranational                   |           | 4.020 | 0,43 |

#### SCHWEDEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |       |     |      |
|------------------------------|-------|-----|------|
| EQT AB                       |       |     |      |
| 2,375 % fällig am 06.04.2028 | € 700 | 816 | 0,09 |

#### SCHWEIZ UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |          |        |      |
|------------------------------|----------|--------|------|
| UBS Group AG                 |          |        |      |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | \$ 1.150 | 1.132  | 0,12 |
| 4,194 % fällig am 01.04.2031 | 400      | 392    | 0,04 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 | 450      | 448    | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | 750      | 750    | 0,08 |
| 6,327 % fällig am 22.12.2027 | 1.100    | 1.130  | 0,12 |
| 6,442 % fällig am 11.08.2028 | 1.100    | 1.143  | 0,12 |
| 9,016 % fällig am 15.11.2033 | 1.300    | 1.608  | 0,17 |
| UBS Switzerland AG           |          |        |      |
| 2,583 % fällig am 23.09.2027 | € 4.000  | 4.729  | 0,50 |
| 3,304 % fällig am 05.03.2029 | 3.000    | 3.614  | 0,38 |
| Summe Schweiz                |          | 14.946 | 1,58 |

#### THAILAND STAATSEMISSIONEN

|                                        |            |        |      |
|----------------------------------------|------------|--------|------|
| Thailand Government International Bond |            |        |      |
| 2,410 % fällig am 17.03.2035           | THB 29.760 | 982    | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 17.11.2029           | 290.370    | 9.341  | 0,99 |
| 3,775 % fällig am 25.06.2032           | 68.870     | 2.436  | 0,26 |
| Summe Thailand                         |            | 12.759 | 1,35 |

#### VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                          |        |     |      |
|------------------------------------------|--------|-----|------|
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC |        |     |      |
| 4,500 % fällig am 06.05.2030             | \$ 200 | 200 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 06.05.2035             | 600    | 599 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
|--------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|

#### MDGH GMTN RSC Ltd.

|                                    |        |        |      |
|------------------------------------|--------|--------|------|
| 5,500 % fällig am 28.04.2033       | \$ 500 | \$ 521 | 0,06 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate |        | 1.320  | 0,14 |

#### GROSSBRITANNIEN UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                                  |          |        |      |
|----------------------------------|----------|--------|------|
| Barclays PLC                     |          |        |      |
| 4,347 % fällig am 08.05.2035     | € 800    | 975    | 0,10 |
| 5,851 % fällig am 21.03.2035     | £ 1.100  | 1.524  | 0,16 |
| 6,224 % fällig am 09.05.2034     | \$ 500   | 531    | 0,06 |
| HSBC Holdings PLC                |          |        |      |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028     | 300      | 298    | 0,03 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029     | 1.300    | 1.302  | 0,14 |
| 4,856 % fällig am 23.05.2033     | € 1.800  | 2.285  | 0,24 |
| Lloyds Banking Group PLC         |          |        |      |
| 5,250 % fällig am 04.10.2030     | £ 2.400  | 3.346  | 0,35 |
| 5,462 % fällig am 05.01.2028     | \$ 1.200 | 1.217  | 0,13 |
| 5,590 % fällig am 26.11.2035     | 1.400    | 1.425  | 0,15 |
| Nationwide Building Society      |          |        |      |
| 2,356 % fällig am 02.05.2027     | € 4.400  | 5.162  | 0,55 |
| NatWest Group PLC                |          |        |      |
| 5,778 % fällig am 01.03.2035     | \$ 2.000 | 2.078  | 0,22 |
| Santander UK Group Holdings PLC  |          |        |      |
| 7,482 % fällig am 29.08.2029     | £ 1.700  | 2.504  | 0,27 |
| Santander UK PLC                 |          |        |      |
| 3,000 % fällig am 12.03.2029     | € 3.300  | 3.942  | 0,42 |
| 4,496 % fällig am 12.12.2027     | \$ 3.900 | 3.945  | 0,42 |
| Standard Chartered PLC           |          |        |      |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032     | 2.700    | 2.380  | 0,25 |
| TP ICAP Finance PLC              |          |        |      |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028     | £ 700    | 884    | 0,09 |
| TSB Bank PLC                     |          |        |      |
| 3,319 % fällig am 05.03.2029     | € 1.300  | 1.568  | 0,17 |
| Vmed O2 UK Financing PLC         |          |        |      |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032 (b) | 2.000    | 2.383  | 0,25 |
|                                  |          | 37.749 | 4,00 |

#### NON-AGENCY-MBS

|                                 |         |        |      |
|---------------------------------|---------|--------|------|
| Auburn PLC                      |         |        |      |
| 5,074 % fällig am 20.07.2045    | £ 1.169 | 1.603  | 0,17 |
| Canada Square Funding PLC       |         |        |      |
| 5,019 % fällig am 17.06.2058    | 880     | 1.207  | 0,13 |
| Curzon Mortgages PLC            |         |        |      |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049    | 2.173   | 2.987  | 0,32 |
| Elstree Funding                 |         |        |      |
| 4,943 % fällig am 21.01.2065    | 4.112   | 5.637  | 0,60 |
| Eurosail PLC                    |         |        |      |
| 5,308 % fällig am 13.06.2045    | 217     | 297    | 0,03 |
| Harbour PLC                     |         |        |      |
| 5,332 % fällig am 28.10.2054    | 1.107   | 1.518  | 0,16 |
| Hops Hill PLC                   |         |        |      |
| 5,103 % fällig am 21.04.2056    | 1.316   | 1.810  | 0,19 |
| Mansard Mortgages PLC           |         |        |      |
| 5,008 % fällig am 15.12.2049    | 209     | 284    | 0,03 |
| Newgate Funding PLC             |         |        |      |
| 2,575 % fällig am 15.12.2050    | € 265   | 306    | 0,03 |
| Polaris PLC                     |         |        |      |
| 5,014 % fällig am 23.12.2058    | £ 502   | 688    | 0,07 |
| RMAC PLC                        |         |        |      |
| 5,437 % fällig am 15.02.2047    | 2.003   | 2.755  | 0,29 |
| Stratton Mortgage Funding PLC   |         |        |      |
| 5,214 % fällig am 25.06.2049    | 1.069   | 1.466  | 0,15 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC |         |        |      |
| 5,074 % fällig am 20.04.2051    | 2.468   | 3.384  | 0,36 |
| Winchester PLC                  |         |        |      |
| 5,188 % fällig am 21.10.2056    | 2.392   | 3.283  | 0,35 |
|                                 |         | 27.225 | 2,88 |

#### STAATSEMISSIONEN

|                              |       |       |      |
|------------------------------|-------|-------|------|
| United Kingdom Gilt          |       |       |      |
| 0,625 % fällig am 22.10.2050 | 2.700 | 1.361 | 0,14 |
| 1,250 % fällig am 31.07.2051 | 3.500 | 2.098 | 0,22 |
| 1,500 % fällig am 31.07.2053 | 1.600 | 996   | 0,11 |
| 1,750 % fällig am 22.01.2049 | 2.200 | 1.614 | 0,17 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | 1.700 | 1.808 | 0,19 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 | £ 1.700        | \$ 2.160                 | 0,23                              |
| 4,375 % fällig am 31.07.2054 | 5.600          | 6.652                    | 0,71                              |
| 5,375 % fällig am 31.01.2056 | 1.300          | 1.809                    | 0,19                              |
|                              |                | 18.498                   | 1,96                              |
| Summe Großbritannien         |                | 83.472                   | 8,84                              |

### USA

#### FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

|                                                       |       |        |      |
|-------------------------------------------------------|-------|--------|------|
| Amortizing Residential Collateral Trust               |       |        |      |
| 5,134 % fällig am 25.10.2031                          | \$ 1  | 1      | 0,00 |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust               |       |        |      |
| 5,134 % fällig am 25.06.2034                          | 70    | 71     | 0,01 |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust            |       |        |      |
| 5,049 % fällig am 25.02.2036                          | 1.431 | 1.427  | 0,15 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                   |       |        |      |
| 4,754 % fällig am 25.12.2036                          | 1.598 | 876    | 0,09 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.     |       |        |      |
| 4,574 % fällig am 25.07.2037                          | 285   | 266    | 0,03 |
| 4,714 % fällig am 25.06.2037                          | 1.007 | 961    | 0,10 |
| 5,114 % fällig am 25.12.2036                          | 9     | 7      | 0,00 |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.  |       |        |      |
| 4,562 % fällig am 25.01.2032                          | 1     | 1      | 0,00 |
| IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust  |       |        |      |
| 4,575 % fällig am 25.03.2035                          | 1.306 | 1.290  | 0,14 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                        |       |        |      |
| 4,734 % fällig am 25.05.2036                          | 1.028 | 541    | 0,06 |
| Massachusetts Educational Financing Authority         |       |        |      |
| 5,575 % fällig am 25.04.2038                          | 43    | 43     | 0,00 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                   |       |        |      |
| 4,754 % fällig am 25.08.2036                          | 4.870 | 1.654  | 0,17 |
| 4,914 % fällig am 25.10.2036                          | 1.675 | 1.500  | 0,16 |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                |       |        |      |
| 4,594 % fällig am 25.09.2037                          | 4     | 1      | 0,00 |
| 4,674 % fällig am 25.02.2037                          | 2.864 | 809    | 0,09 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                |       |        |      |
| 4,634 % fällig am 25.11.2036                          | 1.021 | 579    | 0,06 |
| 4,684 % fällig am 25.07.2036                          | 81    | 73     | 0,01 |
| New Century Home Equity Loan Trust                    |       |        |      |
| 3,464 % fällig am 20.06.2031                          | 221   | 205    | 0,02 |
| Option One Mortgage Loan Trust                        |       |        |      |
| 4,714 % fällig am 25.01.2037                          | 491   | 316    | 0,03 |
| 4,714 % fällig am 25.02.2037                          | 1.827 | 1.154  | 0,12 |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust        |       |        |      |
| 4,554 % fällig am 25.12.2036                          | 13    | 3      | 0,00 |
| Soundview Home Loan Trust                             |       |        |      |
| 4,839 % fällig am 25.12.2036                          | 2.004 | 1.994  | 0,21 |
| 4,934 % fällig am 25.11.2036                          | 1.731 | 1.639  | 0,17 |
| 5,139 % fällig am 25.11.2035                          | 54    | 54     | 0,01 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |       |        |      |
| 5,939 % fällig am 25.04.2035                          | 5     | 5      | 0,00 |
| Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.        |       |        |      |
| 5,102 % fällig am 01.04.2035                          | 353   | 361    | 0,04 |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |       |        |      |
| 4,779 % fällig am 25.01.2037                          | 1.480 | 1.472  | 0,16 |
|                                                       |       | 17.303 | 1,83 |

#### UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

|                              |          |       |      |
|------------------------------|----------|-------|------|
| American Express Co.         |          |       |      |
| 3,433 % fällig am 20.05.2032 | € 2.300  | 2.725 | 0,29 |
| American Tower Corp.         |          |       |      |
| 3,900 % fällig am 16.05.2030 | 700      | 851   | 0,09 |
| Athene Global Funding        |          |       |      |
| 3,046 % fällig am 23.02.2027 | 2.300    | 2.714 | 0,29 |
| 5,339 % fällig am 15.01.2027 | \$ 3.500 | 3.544 | 0,37 |
| Bank of America Corp.        |          |       |      |
| 3,261 % fällig am 28.01.2031 | € 1.600  | 1.892 | 0,20 |
| 5,202 % fällig am 25.04.2029 | \$ 2.400 | 2.453 | 0,26 |
| 5,511 % fällig am 24.01.2036 | 2.200    | 2.263 | 0,24 |
| Boeing Co.                   |          |       |      |
| 6,528 % fällig am 01.05.2034 | 800      | 870   | 0,09 |
| Bristol-Myers Squibb Co.     |          |       |      |
| 5,100 % fällig am 22.02.2031 | 800      | 829   | 0,09 |
| Broadcom, Inc.               |          |       |      |
| 5,050 % fällig am 15.04.2030 | 2.200    | 2.254 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Brown & Brown, Inc.                    |                |                          |                                   |
| 4,900 % fällig am 23.06.2030           | \$ 1.700       | \$ 1.717                 | 0,18                              |
| Charter Communications Operating LLC   |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.03.2042           | 1.600          | 1.142                    | 0,12                              |
| 3,900 % fällig am 01.06.2052           | 900            | 618                      | 0,07                              |
| Citigroup, Inc.                        |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 14.05.2032           | € 800          | 962                      | 0,10                              |
| Doctors Co. An Interinsurance Exchange |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 18.01.2032           | \$ 200         | 178                      | 0,02                              |
| Ford Motor Credit Co. LLC              |                |                          |                                   |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028           | 700            | 657                      | 0,07                              |
| 3,375 % fällig am 13.11.2025           | 800            | 795                      | 0,08                              |
| GA Global Funding Trust                |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 06.01.2027           | 600            | 580                      | 0,06                              |
| Glencore Funding LLC                   |                |                          |                                   |
| 5,371 % fällig am 04.04.2029           | 2.000          | 2.051                    | 0,22                              |
| Goldman Sachs Group, Inc.              |                |                          |                                   |
| 4,692 % fällig am 23.10.2030           | 900            | 903                      | 0,10                              |
| 5,207 % fällig am 28.01.2031           | 3.200          | 3.276                    | 0,35                              |
| 5,330 % fällig am 23.07.2035           | 700            | 706                      | 0,07                              |
| 5,536 % fällig am 28.01.2036 (i)       | 1.000          | 1.026                    | 0,11                              |
| 5,727 % fällig am 25.04.2030           | 2.900          | 3.019                    | 0,32                              |
| JPMorgan Chase & Co.                   |                |                          |                                   |
| 5,153 % fällig am 24.01.2029           | 2.100          | 2.100                    | 0,22                              |
| 5,502 % fällig am 24.01.2036           | 3.600          | 3.710                    | 0,39                              |
| 6,070 % fällig am 22.10.2027           | 3.000          | 3.066                    | 0,32                              |
| Lehman Brothers Holdings, Inc.         |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 16.11.2009 ^         | 700            | 0                        | 0,00                              |
| 5,625 % fällig am 24.01.2013 ^         | 600            | 0                        | 0,00                              |
| 6,200 % fällig am 26.09.2014 ^         | 1.400          | 1                        | 0,00                              |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^         | £ 1.800        | 9                        | 0,00                              |
| Morgan Stanley                         |                |                          |                                   |
| 3,790 % fällig am 21.03.2030           | € 1.300        | 1.572                    | 0,17                              |
| 3,955 % fällig am 21.03.2035           | 200            | 240                      | 0,03                              |
| 4,654 % fällig am 18.10.2030           | \$ 1.100       | 1.102                    | 0,12                              |
| 5,042 % fällig am 19.07.2030           | 900            | 916                      | 0,10                              |
| 5,367 % fällig am 13.04.2028           | 3.100          | 3.119                    | 0,33                              |
| 5,831 % fällig am 19.04.2035           | 2.200          | 2.306                    | 0,24                              |
| Morgan Stanley Bank N.A.               |                |                          |                                   |
| 5,504 % fällig am 26.05.2028           | 1.800          | 1.839                    | 0,19                              |
| Organon & Co.                          |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 30.04.2028           | 400            | 385                      | 0,04                              |
| Pacific Gas & Electric Co.             |                |                          |                                   |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027           | 100            | 95                       | 0,01                              |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047           | 100            | 71                       | 0,01                              |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046           | 300            | 224                      | 0,02                              |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045           | 100            | 76                       | 0,01                              |
| 4,550 % fällig am 01.07.2030           | 200            | 195                      | 0,02                              |
| PacificCorp                            |                |                          |                                   |
| 5,300 % fällig am 15.02.2031           | 800            | 824                      | 0,09                              |
| Philip Morris International, Inc.      |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 13.02.2029           | 800            | 814                      | 0,09                              |
| 5,125 % fällig am 13.02.2031           | 800            | 824                      | 0,09                              |
| Wells Fargo & Co.                      |                |                          |                                   |
| 4,897 % fällig am 25.07.2033           | 200            | 200                      | 0,02                              |
| 5,133 % fällig am 24.01.2028           | 4.700          | 4.704                    | 0,50                              |
| 5,211 % fällig am 03.12.2035           | 2.100          | 2.109                    | 0,22                              |
| 5,420 % fällig am 22.04.2028           | 2.300          | 2.316                    | 0,24                              |
|                                        |                | 70.842                   | 7,50                              |

#### KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL

|                                                       |     |     |      |
|-------------------------------------------------------|-----|-----|------|
| Golden State, California Tobacco Securitization Corp. |     |     |      |
| Revenue Notes, Series 2021                            |     |     |      |
| 2,158 % fällig am 01.06.2026                          | 900 | 881 | 0,09 |

#### NON-AGENCY-MBS

|                                             |     |     |      |
|---------------------------------------------|-----|-----|------|
| Adjustable Rate Mortgage Trust              |     |     |      |
| 5,460 % fällig am 25.09.2035                | 9   | 8   | 0,00 |
| American Home Mortgage Assets Trust         |     |     |      |
| 4,624 % fällig am 25.05.2046                | 153 | 134 | 0,01 |
| 5,339 % fällig am 25.10.2046                | 788 | 513 | 0,05 |
| Banc of America Funding Trust               |     |     |      |
| 4,621 % fällig am 20.10.2046                | 76  | 64  | 0,01 |
| 4,752 % fällig am 20.02.2047                | 535 | 498 | 0,05 |
| 5,078 % fällig am 20.01.2047                | 26  | 23  | 0,00 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust |     |     |      |
| 4,000 % fällig am 25.05.2034                | 6   | 5   | 0,00 |

| BESCHREIBUNG                                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,250 % fällig am 25.05.2047                                           | 106            | 96                       | 0,01                              |
| 5,032 % fällig am 25.08.2033                                           | \$ 3           | \$ 3                     | 0,00                              |
| 6,159 % fällig am 25.10.2033                                           | 4              | 3                        | 0,00                              |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                               |                |                          |                                   |
| 4,607 % fällig am 25.11.2036                                           | 345            | 177                      | 0,02                              |
| 4,905 % fällig am 25.09.2035                                           | 212            | 122                      | 0,01                              |
| 4,907 % fällig am 25.11.2035                                           | 86             | 67                       | 0,01                              |
| Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust                           |                |                          |                                   |
| 4,120 % fällig am 26.12.2046                                           | 296            | 235                      | 0,03                              |
| Chase Mortgage Finance Trust                                           |                |                          |                                   |
| 4,939 % fällig am 25.07.2037                                           | 35             | 29                       | 0,00                              |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                    |                |                          |                                   |
| 4,783 % fällig am 25.09.2037                                           | 182            | 168                      | 0,02                              |
| 4,978 % fällig am 25.08.2035                                           | 166            | 153                      | 0,02                              |
| 6,180 % fällig am 25.09.2035                                           | 8              | 8                        | 0,00                              |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates |                |                          |                                   |
| 4,841 % fällig am 25.09.2035                                           | 244            | 219                      | 0,02                              |
| CitiMortgage Alternative Loan Trust                                    |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.02.2037                                           | 1.636          | 1.348                    | 0,14                              |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                     |                |                          |                                   |
| 4,612 % fällig am 20.02.2047                                           | 618            | 497                      | 0,05                              |
| 4,784 % fällig am 25.05.2037                                           | 66             | 20                       | 0,00                              |
| 4,819 % fällig am 25.02.2037                                           | 88             | 78                       | 0,01                              |
| 4,852 % fällig am 20.07.2046                                           | 143            | 120                      | 0,01                              |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035                                           | 15             | 11                       | 0,00                              |
| 5,899 % fällig am 25.11.2035                                           | 38             | 34                       | 0,00                              |
| 5,974 % fällig am 25.11.2035                                           | 109            | 99                       | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037                                           | 1.988          | 1.020                    | 0,11                              |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037                                           | 50             | 23                       | 0,00                              |
| 6,439 % fällig am 25.11.2035                                           | 15             | 14                       | 0,00                              |
| 6,449 % fällig am 20.10.2035                                           | 951            | 681                      | 0,07                              |
| 6,500 % fällig am 25.06.2036                                           | 151            | 69                       | 0,01                              |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                      |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.05.2035                                           | 15             | 14                       | 0,00                              |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                                           | 75             | 72                       | 0,01                              |
| 5,094 % fällig am 25.02.2035                                           | 40             | 38                       | 0,00                              |
| 5,138 % fällig am 25.11.2034                                           | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 5,194 % fällig am 25.09.2034                                           | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037                                           | 878            | 383                      | 0,04                              |
| Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust                         |                |                          |                                   |
| 4,774 % fällig am 25.06.2035                                           | 64             | 62                       | 0,01                              |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                          |                |                          |                                   |
| 4,674 % fällig am 25.08.2036                                           | 327            | 298                      | 0,03                              |
| Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust                          |                |                          |                                   |
| 4,534 % fällig am 25.10.2036                                           | 3              | 2                        | 0,00                              |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust                  |                |                          |                                   |
| 4,952 % fällig am 19.08.2045                                           | 43             | 38                       | 0,00                              |
| 5,072 % fällig am 19.07.2045                                           | 2              | 0                        | 0,00                              |
| First Horizon Mortgage Pass-Through Trust                              |                |                          |                                   |
| 6,431 % fällig am 25.08.2035                                           | 13             | 9                        | 0,00                              |
| GreenPoint Mortgage Funding Trust                                      |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.11.2045                                           | 8              | 8                        | 0,00                              |
| GSR Mortgage Loan Trust                                                |                |                          |                                   |
| 5,880 % fällig am 25.03.2033                                           | 2              | 2                        | 0,00                              |
| HarborView Mortgage Loan Trust                                         |                |                          |                                   |
| 5,249 % fällig am 19.12.2036                                           | 97             | 87                       | 0,01                              |
| 6,399 % fällig am 19.10.2035                                           | 352            | 166                      | 0,02                              |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                                            |                |                          |                                   |
| 3,803 % fällig am 25.03.2036                                           | 463            | 332                      | 0,04                              |
| 4,588 % fällig am 25.12.2034                                           | 7              | 6                        | 0,00                              |
| JPMorgan Alternative Loan Trust                                        |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.10.2036                                           | 203            | 184                      | 0,02                              |
| 5,500 % fällig am 25.11.2036                                           | 2              | 1                        | 0,00                              |
| JPMorgan Mortgage Trust                                                |                |                          |                                   |
| 4,154 % fällig am 27.07.2037                                           | 128            | 120                      | 0,01                              |
| 5,537 % fällig am 25.02.2036                                           | 69             | 46                       | 0,01                              |
| 5,952 % fällig am 25.11.2033                                           | 1              | 1                        | 0,00                              |
| Madison Avenue Mortgage Trust                                          |                |                          |                                   |
| 3,673 % fällig am 10.09.2035                                           | 868            | 857                      | 0,09                              |
| MASTR Alternative Loan Trust                                           |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.03.2036                                           | 87             | 8                        | 0,00                              |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust           |                |                          |                                   |
| 4,866 % fällig am 15.12.2030                                           | 5              | 5                        | 0,00                              |
| Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust                             |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.03.2037                                           | 5.733          | 1.349                    | 0,14                              |

| BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                     | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>                     |                |                          |                                   | 5,305 % fällig am 25.02.2055                            | \$ 469         | \$ 470                   | 0,05                              | U.S. Treasury Notes              |             |                          |                                   |
| 4,584 % fällig am 25.02.2047                                      | \$ 161         | \$ 49                    | 0,01                              | 5,420 % fällig am 25.05.2043                            | 16             | 17                       | 0,00                              | 3,500 % fällig am 15.02.2033     | \$ 600      | \$ 579                   | 0,06                              |
| 4,734 % fällig am 25.06.2037                                      | 244            | 227                      | 0,02                              | 5,599 % fällig am 25.10.2044 -                          |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.05.2035 (i) | 600         | 601                      | 0,07                              |
| 4,754 % fällig am 25.03.2047                                      | 633            | 588                      | 0,06                              | 25.02.2045                                              | 132            | 122                      | 0,01                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.07.2036                                      | 1.049          | 340                      | 0,04                              | 5,705 % fällig am 25.03.2055                            | 5.804          | 5.832                    | 0,62                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.06.2046                                      | 792            | 172                      | 0,02                              | 7,355 % fällig am 01.09.2035                            | 1              | 1                        | 0,00                              | Summe USA                        |             |                          |                                   |
| 5,234 % fällig am 25.10.2045                                      | 57             | 40                       | 0,00                              | <b>Ginnie Mae</b>                                       |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                                      | 302            | 248                      | 0,03                              | 3,000 % fällig am 20.07.2046 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 6,104 % fällig am 25.11.2037                                      | 632            | 531                      | 0,06                              | 20.12.2052                                              | 12.205         | 10.810                   | 1,15                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b>        |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 20.10.2054 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 5,871 % fällig am 25.09.2035                                      | 35             | 22                       | 0,00                              | 20.06.2055                                              | 1.291          | 1.176                    | 0,12                              |                                  |             |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032                                      | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,846 % fällig am 20.01.2068                            | 644            | 645                      | 0,07                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Sequoia Mortgage Trust</b>                                     |                |                          |                                   | 4,926 % fällig am 20.02.2065                            | 251            | 251                      | 0,03                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,504 % fällig am 20.07.2037                                      | 384            | 304                      | 0,03                              | 4,952 % fällig am 20.05.2074                            | 709            | 708                      | 0,08                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,132 % fällig am 20.07.2033                                      | 7              | 7                        | 0,00                              | 5,046 % fällig am 20.04.2064                            | 263            | 264                      | 0,03                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>             |                |                          |                                   | 5,232 % fällig am 20.01.2074                            | 843            | 849                      | 0,09                              |                                  |             |                          |                                   |
| 6,174 % fällig am 25.04.2034                                      | 1              | 1                        | 0,00                              | <b>Ginnie Mae, TBA</b>                                  |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 6,525 % fällig am 25.02.2034                                      | 6              | 6                        | 0,00                              | 2,500 % fällig am 01.08.2055                            | 4.200          | 3.569                    | 0,38                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>                |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.08.2055                            | 20.600         | 18.219                   | 1,93                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.01.2037                                      | 855            | 765                      | 0,08                              | 3,500 % fällig am 01.07.2055                            | 39.060         | 35.516                   | 3,76                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.07.2046                                      | 288            | 200                      | 0,02                              | 6,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.05.2036                                      | 118            | 82                       | 0,01                              | 01.08.2055                                              | 22.400         | 22.957                   | 2,43                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.05.2036                                      | 525            | 431                      | 0,05                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                 |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 5,012 % fällig am 19.07.2034                                      | 3              | 3                        | 0,00                              | 2,500 % fällig am 01.02.2051 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 5,132 % fällig am 19.03.2034                                      | 2              | 2                        | 0,00                              | 01.01.2052                                              | 2.408          | 2.003                    | 0,21                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>      |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.04.2043 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.01.2036                                      | 143            | 119                      | 0,01                              | 01.06.2051                                              | 1.676          | 1.456                    | 0,15                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,724 % fällig am 25.10.2036                                      | 394            | 329                      | 0,04                              | 3,500 % fällig am 01.10.2034 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>                        |                |                          |                                   | 01.07.2050                                              | 1.201          | 1.114                    | 0,12                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,999 % fällig am 25.06.2047                                      | 45             | 41                       | 0,00                              | 4,000 % fällig am 01.06.2050                            | 572            | 537                      | 0,06                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Wachovia Mortgage Loan Trust LLC</b>                           |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.06.2053 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 4,883 % fällig am 25.01.2037                                      | 1.315          | 469                      | 0,05                              | 01.10.2053                                              | 18.572         | 18.605                   | 1,97                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>              |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 01.03.2054 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 3,876 % fällig am 25.05.2037                                      | 282            | 244                      | 0,03                              | 01.08.2054                                              | 11.228         | 11.424                   | 1,21                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,024 % fällig am 25.06.2037                                      | 82             | 72                       | 0,01                              | 6,500 % fällig am 01.10.2053 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 4,152 % fällig am 25.02.2037                                      | 562            | 525                      | 0,06                              | 01.04.2055                                              | 6.766          | 6.993                    | 0,74                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,182 % fällig am 27.02.2034                                      | 4              | 4                        | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>            |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 4,434 % fällig am 25.09.2036                                      | 115            | 99                       | 0,01                              | 3,000 % fällig am 01.07.2055                            | 5.500          | 4.760                    | 0,50                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,054 % fällig am 25.01.2045                                      | 10             | 9                        | 0,00                              | 4,000 % fällig am 01.07.2055                            | 2.100          | 1.953                    | 0,21                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,399 % fällig am 25.02.2046                                      | 165            | 151                      | 0,02                              | 4,500 % fällig am 01.08.2055                            | 1.000          | 956                      | 0,10                              |                                  |             |                          |                                   |
| 6,205 % fällig am 25.03.2034                                      | 1              | 1                        | 0,00                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                |                          |                                   | 01.08.2055                                              | 74.100         | 72.622                   | 7,69                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,339 % fällig am 25.07.2046                                      | 70             | 43                       | 0,01                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                            | 58.425         | 59.319                   | 6,28                              |                                  |             |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 01.08.2055                                              | 145.800        | 150.351                  | 15,93                             |                                  |             |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   |                                                         |                | 442.230                  | 46,84                             |                                  |             |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | <b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>                            |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                      |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Bonds</b>                              |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Fannie Mae</b>                                                 |                |                          |                                   | 2,250 % fällig am 15.08.2049                            | 1.450          | 910                      | 0,10                              |                                  |             |                          |                                   |
| 2,944 % fällig am 25.07.2039                                      | 288            | 262                      | 0,03                              | 2,375 % fällig am 15.11.2049                            | 350            | 225                      | 0,02                              |                                  |             |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.03.2060                                      | 630            | 544                      | 0,06                              | 3,000 % fällig am 15.02.2048                            | 2.000          | 1.487                    | 0,16                              |                                  |             |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.01.2059                                      | 1.390          | 1.244                    | 0,13                              | 3,000 % fällig am 15.08.2048                            | 325            | 240                      | 0,03                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,556 % fällig am 25.03.2034                                      | 1              | 1                        | 0,00                              | 3,000 % fällig am 15.02.2049                            | 250            | 184                      | 0,02                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,586 % fällig am 25.08.2034                                      | 1              | 1                        | 0,00                              | 3,375 % fällig am 15.11.2048                            | 4.200          | 3.324                    | 0,35                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,820 % fällig am 25.06.2036                                      | 13             | 13                       | 0,00                              | 4,125 % fällig am 15.08.2044                            | 2.800          | 2.566                    | 0,27                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,881 % fällig am 25.03.2036                                      | 3              | 3                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 15.11.2054                            | 22.800         | 21.735                   | 2,30                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,920 % fällig am 25.10.2040                                      | 29             | 29                       | 0,00                              | 4,625 % fällig am                                       |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 5,465 % fällig am 25.03.2055                                      | 2.479          | 2.479                    | 0,26                              | 15.02.2055 (i)(j)                                       | 13.500         | 13.146                   | 1,39                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,697 % fällig am 01.09.2044                                      | 30             | 30                       | 0,00                              | <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b> |                |                          |                                   |                                  |             |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.04.2043 -                                    |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.10.2025                            | 371            | 370                      | 0,04                              |                                  |             |                          |                                   |
| 25.07.2044                                                        | 64             | 67                       | 0,01                              | 0,125 % fällig am 15.07.2031                            | 3.112          | 2.865                    | 0,30                              |                                  |             |                          |                                   |
| 6,009 % fällig am 01.12.2034                                      | 5              | 5                        | 0,00                              | 0,125 % fällig am 15.01.2032                            | 1.273          | 1.154                    | 0,12                              |                                  |             |                          |                                   |
| 7,037 % fällig am 01.11.2034                                      | 27             | 28                       | 0,00                              | 0,500 % fällig am 15.01.2028                            | 6.892          | 6.765                    | 0,72                              |                                  |             |                          |                                   |
| <b>Freddie Mac</b>                                                |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.07.2032                            | 442            | 412                      | 0,04                              |                                  |             |                          |                                   |
| 2,053 % fällig am 15.01.2038 (a)                                  | 182            | 9                        | 0,00                              | 1,125 % fällig am 15.01.2033                            | 5.707          | 5.456                    | 0,58                              |                                  |             |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 15.01.2038                                      | 182            | 179                      | 0,02                              | 1,750 % fällig am 15.01.2028                            | 612            | 620                      | 0,07                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,018 % fällig am 15.12.2037 -                                    |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 15.01.2027                            | 795            | 809                      | 0,09                              |                                  |             |                          |                                   |
| 15.07.2040                                                        | 70             | 70                       | 0,01                              | 2,500 % fällig am 15.01.2029                            | 5.378          | 5.597                    | 0,59                              |                                  |             |                          |                                   |
| 5,245 % fällig am 25.11.2054                                      | 3.775          | 3.767                    | 0,40                              | 3,875 % fällig am 15.04.2029                            | 4.097          | 4.474                    | 0,47                              |                                  |             |                          |                                   |

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## FUTURES

| Beschreibung                                        | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Australia Government 3-Year Note September Futures  | Long  | 09.2025     | 27                   | \$ 6                                     | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2025     | 702                  | (472)                                    | (0,05)               |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| Beschreibung                                           | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Canada Government 5-Year Bond September Futures        | Short | 09.2025     | 20                   | \$ (11)                                  | 0,00                 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures       | Long  | 09.2025     | 373                  | 296                                      | 0,03                 |
| Euro-Bobl September Futures                            | Short | 09.2025     | 353                  | 185                                      | 0,02                 |
| Euro-BTP September Futures                             | Long  | 09.2025     | 680                  | 312                                      | 0,03                 |
| Euro-Bund September Futures                            | Short | 09.2025     | 306                  | 344                                      | 0,04                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures               | Long  | 09.2025     | 14                   | (37)                                     | (0,01)               |
| Euro-OAT September Futures                             | Short | 09.2025     | 257                  | 34                                       | 0,00                 |
| Euro-Schatz September Futures                          | Short | 09.2025     | 49                   | 11                                       | 0,00                 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures        | Short | 09.2025     | 64                   | (186)                                    | (0,02)               |
| Short Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2025     | 296                  | 58                                       | 0,01                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 66                   | 54                                       | 0,01                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 685                  | 878                                      | 0,09                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures           | Long  | 09.2025     | 156                  | 360                                      | 0,04                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures          | Long  | 09.2025     | 421                  | 1.004                                    | 0,11                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures   | Short | 09.2025     | 50                   | (246)                                    | (0,03)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures             | Long  | 09.2025     | 187                  | 553                                      | 0,06                 |
|                                                        |       |             |                      | <b>\$ 3.143</b>                          | <b>0,33</b>          |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                               | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld        | Marktwert      | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------------|----------------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | \$ 109,000    | 25.07.2025    | 15                   | \$ (6)         | \$ (1)         | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,500       | 25.07.2025    | 15                   | (6)            | (8)            | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures                | € 129,000     | 25.07.2025    | 25                   | (12)           | (10)           | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl February 2025 Futures               | 132,500       | 25.07.2025    | 25                   | (13)           | (4)            | 0,00                 |
|                                                            |               |               |                      | <b>\$ (37)</b> | <b>\$ (23)</b> | <b>0,00</b>          |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

**\$ 3.120 0,33**

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen                      | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-43 10-Year Index             | (1,000) %                   | 20.12.2034       | \$ 12.100                 | \$ (58)                                  | (0,01)               |
| CDX.IG-44 10-Year Index             | (1,000)                     | 20.06.2035       | 19.500                    | (125)                                    | (0,01)               |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index  | (1,000)                     | 20.06.2030       | € 22.550                  | (79)                                     | (0,01)               |
| iTraxx Europe Main 43 10-Year Index | (1,000)                     | 20.06.2035       | 13.400                    | (45)                                     | 0,00                 |
|                                     |                             |                  |                           | <b>\$ (307)</b>                          | <b>(0,03)</b>        |

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Index/Tranchen                      | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-43 5-Year Index              | 1,000 %                     | 20.12.2029       | \$ 32.100                 | \$ 27                                    | 0,00                 |
| CDX.IG-44 5-Year Index              | 1,000                       | 20.06.2030       | 120.300                   | 602                                      | 0,07                 |
| iTraxx Europe Main 43 10-Year Index | 1,000                       | 20.06.2035       | € 1.100                   | 2                                        | 0,00                 |
|                                     |                             |                  |                           | <b>\$ 631</b>                            | <b>0,07</b>          |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex           | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,000 %         | 17.06.2027       | £ 21.900   | \$ (315)                                 | (0,03)               |
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2030       | 21.000     | 298                                      | 0,03                 |
| Erhalt                            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2035       | 4.400      | (43)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2027       | 4.300      | 8                                        | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 18.03.2031       | 16.400     | 17                                       | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2055       | 1.100      | (35)                                     | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 4,000           | 17.03.2028       | 71.600     | 722                                      | 0,08                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>             | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS    | 6,000           | 17.09.2030       | 114.570    | (12)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 17.03.2031       | ¥ 597.300  | (182)                                    | (0,02)               |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,050           | 15.12.2031       | 851.000    | (152)                                    | (0,02)               |
| Erhalt                            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400           | 19.06.2039       | 540.000    | 610                                      | 0,06                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,450           | 15.12.2051       | 74.900     | (86)                                     | (0,01)               |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750           | 19.03.2027       | 5.930.000  | 58                                       | 0,01                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,750           | 19.03.2030       | 1.370.000  | 10                                       | 0,00                 |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,800           | 15.06.2052       | 640.000    | (953)                                    | (0,10)               |
| Erhalt                            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 18.06.2027       | 730.000    | 9                                        | 0,00                 |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000 %            | 19.03.2032       | ¥ 2.450.000 | \$ 96                                           | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 18.09.2034       | 2.660.000   | (180)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 18.12.2034       | 2.400.000   | (262)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 19.03.2035       | 1.292.700   | (60)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000              | 19.06.2044       | 1.040.000   | (523)                                           | (0,06)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,250              | 17.09.2035       | 450.000     | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,500              | 18.12.2054       | 174.300     | (97)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 2,250              | 17.09.2055       | 120.000     | 7                                               | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS   | 2,500              | 17.09.2030       | SGD 3.200   | (52)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS   | 2,750              | 18.09.2029       | 20.780      | (745)                                           | (0,08)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 2,965              | 30.11.2026       | \$ 27.900   | 508                                             | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 19.03.2027       | 61.330      | (422)                                           | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 19.03.2030       | 41.460      | (1.008)                                         | (0,11)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 18.06.2027       | 2.200       | (10)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 18.06.2030       | 800         | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 19.03.2035       | 39.170      | (1.003)                                         | (0,11)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 19.03.2055       | 3.120       | (4)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,408              | 05.09.2034       | 2.100       | 67                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,470              | 04.09.2034       | 2.200       | 59                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 18.12.2025       | 25.400      | 87                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 20.06.2054       | 4.700       | 40                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 18.12.2054       | 600         | 39                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,525              | 04.09.2034       | 3.500       | 76                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,555              | 28.08.2034       | 2.600       | 51                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,600              | 28.08.2034       | 2.450       | 40                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,611              | 28.08.2034       | 350         | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,620              | 30.11.2029       | 101.374     | (1.020)                                         | (0,11)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,662              | 31.05.2028       | 4.700       | (31)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,691              | 31.05.2028       | 11.000      | (82)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,700              | 20.02.2049       | 600         | 21                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.12.2026       | 12.000      | (101)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 17.09.2027       | 10.400      | 54                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.06.2031       | 14.600      | (144)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 15.05.2032       | 15.100      | (216)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 20.06.2034       | 5.700       | (203)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.12.2034       | 4.400       | (15)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,765              | 15.02.2055       | 4.200       | 118                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,772              | 15.02.2055       | 500         | 13                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,773              | 04.03.2055       | 2.200       | 59                                              | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,804              | 15.02.2055       | 2.100       | 45                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,806              | 15.02.2055       | 1.000       | 21                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,836              | 15.05.2034       | 1.900       | (29)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,840              | 30.06.2031       | 8.300       | (138)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,847              | 15.05.2034       | 1.100       | (18)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,851              | 28.02.2029       | 7.600       | (106)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,860              | 15.05.2034       | 2.000       | (34)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,861              | 15.02.2055       | 700         | 8                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,862              | 28.02.2029       | 7.200       | (104)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,866              | 15.02.2055       | 700         | 7                                               | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,900              | 15.02.2035       | 51.978      | (1.031)                                         | (0,11)                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,905              | 15.08.2026       | 9.200       | (17)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,930              | 25.06.2055       | 1.676       | (12)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,931              | 15.11.2054       | 3.700       | (3)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,955              | 15.11.2054       | 1.200       | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,959              | 15.11.2054       | 2.400       | (14)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,960              | 27.06.2055       | 2.072       | (17)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,964              | 15.11.2054       | 1.200       | (8)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,975              | 21.03.2035       | 1.400       | (29)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,996              | 15.11.2054       | 3.800       | (47)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000              | 20.06.2026       | 27.800      | (324)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,000              | 20.03.2054       | 3.200       | 332                                             | 0,04                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,005              | 29.09.2055       | 705         | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,020              | 15.05.2026       | 7.700       | (1)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,065              | 26.06.2055       | 1.100       | (11)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,100              | 15.11.2052       | 3.700       | (78)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,115              | 15.11.2054       | 4.320       | (145)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,130              | 15.11.2054       | 1.280       | (46)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,228              | 30.08.2025       | 200         | 1                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250              | 20.12.2025       | 119.651     | (161)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,750              | 17.07.2025       | 14.100      | (33)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,500              | 16.06.2051       | CAD 250     | 9                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,900              | 18.12.2029       | 21.800      | 914                                             | 0,10                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850              | 01.09.2029       | 4.000       | 46                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,850              | 01.06.2033       | 1.000       | (9)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,880              | 01.09.2033       | 7.300       | (14)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000              | 18.06.2027       | 7.300       | 12                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000              | 01.06.2033       | 1.400       | (18)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000              | 01.06.2034       | 4.700       | (28)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,180              | 01.06.2033       | 10.600      | (189)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250              | 15.03.2033       | 4.900       | (189)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250              | 18.12.2034       | 2.000       | 10                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,250              | 21.06.2053       | 2.300       | 135                                             | 0,01                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt variabler<br>Zinssatz       | Variable Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,300 %         | 01.06.2033       | CAD        | 14.700                                          | \$ (458) (0,05)         |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,400           | 01.06.2033       |            | 1.400                                           | (41) 0,00               |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 18.12.2025       |            | 78.200                                          | 546 0,06                |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 19.06.2026       |            | 17.300                                          | 133 0,01                |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 01.09.2033       |            | 7.000                                           | (341) (0,04)            |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,700           | 01.09.2033       |            | 3.000                                           | (143) (0,02)            |
| Erhalt                                         | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2033       |            | 800                                             | (36) 0,00               |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,898           | 19.06.2026       |            | 21.100                                          | 211 0,02                |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,925           | 19.06.2026       |            | 17.400                                          | 178 0,02                |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,283           | 14.02.2027       | CHF        | 900                                             | 8 0,00                  |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,294           | 10.02.2027       |            | 8.500                                           | 97 0,01                 |
| Zahlung                                        | 3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS  | 0,343           | 16.05.2027       |            | 1.900                                           | 22 0,00                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 3-Month CNY-CNREPOFIX               | 1,500           | 18.06.2030       | CNY        | 716.000                                         | 582 0,06                |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 3-Month KRW-KORIBOR                 | 2,500           | 17.09.2035       | KRW        | 12.784.500                                      | (95) (0,01)             |
| Zahlung                                        | 3-Month KRW-KORIBOR                 | 2,750           | 19.03.2035       |            | 12.842.590                                      | 18 0,00                 |
| Zahlung                                        | 3-Month NZD-BBR                     | 3,750           | 15.06.2027       | NZD        | 4.400                                           | 124 0,01                |
| Zahlung                                        | 3-Month NZD-BBR                     | 4,750           | 19.06.2029       |            | 5.900                                           | 130 0,01                |
| Zahlung                                        | 3-Month SEK-STIBOR                  | 2,474           | 03.02.2030       | SEK        | 53.000                                          | 120 0,01                |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,500           | 18.03.2031       | AUD        | 4.100                                           | (1) 0,00                |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,750           | 19.03.2030       |            | 91.800                                          | 406 0,04                |
| Erhalt                                         | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,000           | 18.06.2030       |            | 6.500                                           | (17) 0,00               |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250           | 15.03.2033       |            | 16.800                                          | 16 0,00                 |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250           | 19.03.2035       |            | 5.300                                           | 58 0,01                 |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 19.03.2035       |            | 26.900                                          | 524 0,06                |
| Erhalt                                         | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 18.06.2035       |            | 4.800                                           | (23) 0,00               |
| Zahlung                                        | 6-Month CZK-PRIBOR                  | 1,913           | 30.01.2029       | CZK        | 24.300                                          | (78) (0,01)             |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,451           | 27.05.2050       | €          | 300                                             | (149) (0,02)            |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,650           | 12.04.2027       |            | 2.400                                           | (62) (0,01)             |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,650           | 11.05.2027       |            | 1.800                                           | (43) 0,00               |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,700           | 11.04.2027       |            | 1.400                                           | (36) 0,00               |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,000           | 13.05.2027       |            | 2.200                                           | (43) 0,00               |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,000           | 18.05.2027       |            | 1.300                                           | (26) 0,00               |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,795           | 11.10.2029       |            | 4.500                                           | (50) (0,01)             |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,923           | 11.10.2029       |            | 10.800                                          | (49) (0,01)             |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,000           | 17.09.2027       |            | 18.400                                          | 8 0,00                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,028           | 11.10.2029       |            | 16.100                                          | (23) 0,00               |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2030       |            | 76.920                                          | 507 0,05                |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2035       |            | 94.350                                          | 73 0,01                 |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 21.09.2037       |            | 8.950                                           | (521) (0,06)            |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 21.09.2042       |            | 1.260                                           | (195) (0,02)            |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 12.03.2055       |            | 13.500                                          | 630 0,07                |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2055       |            | 1.780                                           | (92) (0,01)             |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,270           | 12.03.2055       |            | 7.500                                           | 335 0,04                |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,282           | 12.03.2055       |            | 2.300                                           | 100 0,01                |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,343           | 10.01.2030       |            | 10.600                                          | 28 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,750           | 18.09.2039       |            | 5.400                                           | (209) (0,02)            |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 3,000           | 19.03.2027       |            | 30.530                                          | 443 0,05                |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 3,000           | 15.03.2033       |            | 13.460                                          | (72) (0,01)             |
|                                                |                                     |                 |                  |            | \$ (3.720)                                      | (0,40)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                     |                 |                  |            | \$ (3.396)                                      | (0,36)                  |

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

#### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Put - OTC EUR versus CZK  | CZK 24,650    | 11.03.2026    | 1.035                     | \$ 7   | \$ 8      | 0,00                    |
|            | Put - OTC EUR versus HUF  | HUF 399,000   | 25.08.2025    | 1.197                     | 5      | 7         | 0,00                    |
| BRC        | Call - OTC USD versus SEK | SEK 10,200    | 26.11.2025    | 2.052                     | 13     | 12        | 0,00                    |
| GLM        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,100      | 17.12.2025    | 253                       | 29     | 21        | 0,01                    |

| Kontrahent | Beschreibung             | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|----------------------|
| JPM        | Put - OTC EUR versus CZK | CZK 24,600    | 22.12.2025    | 2.578                     | \$ 12  | \$ 14     | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus HUF | HUF 395,000   | 29.09.2025    | 1.437                     | 7      | 6         | 0,00                 |
| MBC        | Put - OTC EUR versus USD | \$ 1,098      | 23.12.2025    | 253                       | 29     | 20        | 0,00                 |
| MYI        | Put - OTC EUR versus CZK | CZK 24,750    | 09.12.2025    | 1.106                     | 7      | 8         | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus CZK | 24,550        | 16.12.2025    | 2.246                     | 10     | 10        | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus CZK | 24,700        | 16.12.2025    | 1.815                     | 11     | 12        | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus USD | \$ 1,110      | 24.11.2025    | 6.083                     | 29     | 19        | 0,00                 |
|            |                          |               |               |                           | \$ 159 | \$ 137    | 0,01                 |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                        | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|----------------------|
| BPS        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 4,570 %       | 13.08.2025    | 51.800                    | \$ 72  | \$ 0      | 0,00                 |
| GLM        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 4,700         | 20.08.2025    | 28.700                    | 37     | 0         | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 4,570         | 13.08.2025    | 1.200                     | 2      | 0         | 0,00                 |
|            |                                     |                         |                                   |               |               |                           | \$ 111 | \$ 0      | 0,00                 |

## VERKAUFSOPTIONEN

## DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| GLM        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 53,500    | 11.12.2025    | 1.616                     | \$ (53) | \$ (43)   | (0,01)               |
| UAG        | Call - OTC USD versus TRY | 54,000        | 16.12.2025    | 1.015                     | (33)    | (28)      | 0,00                 |
|            |                           |               |               |                           | \$ (86) | \$ (71)   | (0,01)               |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,700 %       | 21.07.2025    | 3.400                     | \$ (11)  | \$ (26)   | (0,01)               |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,050         | 21.07.2025    | 3.400                     | (11)     | (2)       | 0,00                 |
| BRC        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,350         | 25.09.2025    | 2.700                     | (26)     | (1)       | 0,00                 |
| DUB        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,330         | 25.09.2025    | 3.900                     | (43)     | (1)       | 0,00                 |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,750         | 03.07.2025    | 2.400                     | (9)      | (16)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,100         | 03.07.2025    | 2.400                     | (9)      | 0         | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,669         | 07.07.2025    | 1.200                     | (4)      | (4)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,715         | 02.07.2025    | 3.600                     | (13)     | (15)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,019         | 07.07.2025    | 1.200                     | (4)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,065         | 02.07.2025    | 3.600                     | (13)     | 0         | 0,00                 |
|            |                                       |                         |                                   |               |               |                           | \$ (143) | \$ (65)   | (0,01)               |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                           | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| GST        | South Korea Government International Bond | (1,000) %                   | 20.06.2030       | \$ 1.430                  | \$ (46)                                | \$ (3)                                    | \$ (49)   | (0,01)               |
| MYC        | South Korea Government International Bond | (1,000)                     | 20.06.2030       | 1.340                     | (43)                                   | (2)                                       | (45)      | 0,00                 |
|            |                                           |                             |                  |                           | \$ (89)                                | \$ (5)                                    | \$ (94)   | (0,01)               |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit     | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| GST        | Petroleos Mexicanos | 4,850 %                     | 07.05.2026       | \$ 4.704                  | \$ 0                                   | \$ 57                                     | \$ 57     | 0,01                 |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

### CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt                                                                                                                        | Zahlung                                                                                              | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag<br>erhaltener<br>Währung | Nennbetrag<br>gelieferter<br>Währung | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| CBK        | Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,410 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variable Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.12.2026       | \$ 45.792                           | ¥ 6.780.000                          | \$ 78                                        | \$ 5                                            | \$ 83     | 0,01                         |
| GLM        | Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,462 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variable Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030       | 9.836                               | 1.500.000                            | (21)                                         | 20                                              | (1)       | 0,00                         |
| GST        | Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,459 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variable Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030       | 328                                 | 50.000                               | (1)                                          | 1                                               | 0         | 0,00                         |
| MYC        | Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,414 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variable Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 15.10.2026       | 35.608                              | 5.636.600                            | (496)                                        | 16                                              | (480)     | (0,05)                       |
|            | Variable Zinssatz entspricht 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS abzgl. 0,430 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variable Zinssatz entspricht 1-Day JPY-MUTKCALM basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 17.09.2030       | 659                                 | 100.000                              | (1)                                          | 0                                               | (1)       | 0,00                         |
|            |                                                                                                                               |                                                                                                      |                  |                                     |                                      | \$ (441)                                     | \$ 42                                           | \$ (399)  | (0,04)                       |

### ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|--------------------------------------|------------------------|-----------------|------------------|-------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| BPS        | Zahlung <sup>(1)</sup>               | 3-Month CNY-CNREPOFIX  | 1,500 %         | 18.03.2031       | CNY 404.500 | \$ (123)                                     | \$ 195                                          | \$ 72     | 0,01                         |
|            | Zahlung                              | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,500           | 19.03.2030       | MYR 4.210   | (3)                                          | 17                                              | 14        | 0,00                         |
|            | Erhalt                               | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,750           | 18.09.2034       | 4.850       | (13)                                         | (20)                                            | (33)      | 0,00                         |
| CBK        | Zahlung <sup>(1)</sup>               | 3-Month CNY-CNREPOFIX  | 1,500           | 18.03.2031       | CNY 224.900 | 0                                            | 40                                              | 40        | 0,00                         |
| GST        | Zahlung                              | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,500           | 19.03.2030       | MYR 40.960  | 19                                           | 118                                             | 137       | 0,02                         |
|            | Erhalt                               | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,750           | 20.09.2033       | 11.320      | 72                                           | (151)                                           | (79)      | (0,01)                       |
| JPM        | Erhalt                               | 3-Month MYR-KLIBOR     | 3,750           | 19.03.2035       | 11.110      | 8                                            | (82)                                            | (74)      | (0,01)                       |
| SCX        | Zahlung <sup>(1)</sup>               | 3-Month CNY-CNREPOFIX  | 1,500           | 18.03.2031       | CNY 49.100  | 23                                           | (14)                                            | 9         | 0,00                         |
|            |                                      |                        |                 |                  |             | \$ (17)                                      | \$ 103                                          | \$ 86     | 0,01                         |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier                              | Anzahl der<br>Anteile<br>oder Einheiten | Variabler<br>Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|--------------------|-----------------------------------------|-----------------------------------------|-----------------------|------------|------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|------------------------------|
| BPS        | Erhalt             | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 47.719                                  | 1,199 %               | \$ 15.480  | 22.12.2025       | \$ 0                                         | \$ (293)                                        | \$ (293)  | (0,03)                       |
| JPM        | Erhalt             | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | k. A.                                   | 1,199                 | 10.100     | 22.09.2025       | 104                                          | (356)                                           | (252)     | (0,03)                       |
| MYC        | Erhalt             | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | k. A.                                   | 1,199                 | 2.500      | 22.09.2025       | 27                                           | (89)                                            | (62)      | (0,01)                       |
|            |                    |                                         |                                         |                       |            |                  | \$ 131                                       | \$ (738)                                        | \$ (607)  | (0,07)                       |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD 11                 | \$ 8                     | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CNH 38.799             | 5.385                    | 0                                | (37)                               | (37)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$ 39.528              | AUD 60.849               | 350                              | 0                                  | 350                                                  | 0,04                         |
|            | 07.2025          | 558                    | NZD 926                  | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | AUD 60.849             | \$ 39.551                | 0                                | (352)                              | (352)                                                | (0,04)                       |
|            | 08.2025          | CNH 55.042             | 7.655                    | 0                                | (58)                               | (58)                                                 | (0,01)                       |
|            | 08.2025          | NZD 926                | 558                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | \$ 8                   | CAD 11                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | 749                    | CNH 5.431                | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025          | AUD 822                | \$ 535                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | € 242.194              | 275.386                  | 0                                | (8.914)                            | (8.914)                                              | (0,94)                       |
|            | 07.2025          | KRW 798.027            | 585                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | PEN 739                | 197                      | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$ 616                 | CNY 4.417                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | 609                    | IDR 9.942.040            | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | 608                    | SGD 778                  | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH 2.905              | \$ 406                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | HUF 135.429            | € 335                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 08.2025          | SGD                    | 776                      | \$ 608                           | \$ 0                               | \$ (3)                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 17.774                   | 561                              | 0                                  | (57)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 939                      | MXN 17.805                       | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 4.432                    | \$ 618                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 800                      | RON 4.040                        | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 25.315                   | \$ 19                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 1.515                    | 150                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 1.075                    | 112                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 384                      | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 44.971                   | 1.384                            | 0                                  | (164)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 857                      | BRL 4.772                        | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 604                      | CNY 4.322                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.375                    | € 2.053                          | 35                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.265                    | IDR 20.632.708                   | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 90                       | THB 2.948                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 356                      | TWD 10.602                       | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 20.283                   | \$ 2.839                         | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 37.429                   | 1.148                            | 0                                  | (153)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 81                       | CNH 580                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 812                      | CNY 5.801                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 635                      | INR 55.162                       | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 636                      | MXN 12.122                       | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 611                      | TWD 17.916                       | 12                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 04.2026          | DKK                    | 73.855                   | \$ 10.551                        | 0                                  | (1.291)                                              | (0,14)                  |
|            | 05.2026          | \$                     | 414                      | KWD 126                          | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 06.2026          |                        | 261                      | 80                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 06.2027          |                        | 181                      | 55                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 05.2029          | KWD                    | 630                      | \$ 2.167                         | 95                                 | 0                                                    | 0,01                    |
| BRC        | 07.2029          |                        | 73                       | 250                              | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 05.2030          |                        | 453                      | 1.560                            | 62                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | €                      | 860                      | RON 4.356                        | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 6.931                    | \$ 1.991                         | 0                                  | (68)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 129.519                  | 95                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 1.110                    | 109                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 1.743                    | 471                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TRY                    | 1.152                    | 28                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 5.834                    | € 5.146                          | 206                                | 0                                                    | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 61.454                   | £ 45.175                         | 452                                | 0                                                    | 0,05                    |
|            | 07.2025          |                        | 987                      | ILS 3.333                        | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 56                       | KRW 77.326                       | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 15                       | NOK 157                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 71                       | PLN 265                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 7.429                    | TRY 303.993                      | 95                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 44.871                   | \$ 2.480                         | 0                                  | (41)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £                      | 44.327                   | 60.320                           | 0                                  | (432)                                                | (0,05)                  |
|            | 08.2025          | THB                    | 11                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.319                    | CNH 16.677                       | 18                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.835                    | TRY 76.020                       | 21                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MYR                    | 27.253                   | \$ 6.466                         | 0                                  | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025          | \$                     | 242                      | TRY 11.321                       | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 01.2026          | DKK                    | 18.900                   | \$ 2.706                         | 0                                  | (307)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 20.029                   | DKK 131.516                      | 663                                | 0                                                    | 0,07                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.711                    | PEN 6.186                        | 32                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 1.699                    | \$ 464                           | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 48                       | PEN 173                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025          | PEN                    | 8.388                    | \$ 2.286                         | 0                                  | (68)                                                 | (0,01)                  |
| CBK        | 12.2025          |                        | 5.467                    | 1.506                            | 0                                  | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 23                       | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 2.084                    | 291                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 1.866                    | 2.186                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 22.006.977               | 16.058                           | 0                                  | (214)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | PEN                    | 10.787                   | 2.939                            | 0                                  | (100)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | THB                    | 20.090                   | 604                              | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 78.683                   | 2.418                            | 0                                  | (290)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 11.680                   | BRL 69.377                       | 1.033                              | 0                                                    | 0,11                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.758                    | CNY 19.768                       | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.054                    | IDR 17.171.386                   | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.390                    | ¥ 340.300                        | 0                                  | (34)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.078                    | PEN 3.850                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 527                      | TWD 15.606                       | 11                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 12.353                   | \$ 1.718                         | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | EGP                    | 5.315                    | 99                               | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | PEN                    | 665                      | 176                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 85.797                   | 2.633                            | 0                                  | (349)                                                | (0,04)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 604                      | CNH 4.359                        | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2.669                    | CNY 19.084                       | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 40                       | EGP 2.202                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 4.752                    | INR 409.584                      | 15                                 | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 73                       | PEN 262                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 2.667                    | \$ 139                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | PEN                    | 9.550                    | 2.625                            | 0                                  | (60)                                                 | (0,01)                  |
|            | 09.2025          | \$                     | 350                      | KZT 180.425                      | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 01.2026          | ¥                      | 90.000                   | \$ 663                           | 27                                 | 0                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| DUB        | 02.2026          | PEN 1.729              | \$ 470                   | \$ 0                             | \$ (14)                            | \$ (14)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK 45.445             | 7.136                    | 0                                | (14)                               | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | IDR 8.242.740          | 506                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS 3.366              | 971                      | 0                                | (28)                               | (28)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 109.090            | 80                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 80                 | 62                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 536                 | CNY 3.825                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 278.214                | € 239.819                | 3.298                            | 0                                  | 3.298                                                | 0,35                    |
|            | 07.2025          | 78                     | IDR 1.267.528            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 40                     | KZT 21.150               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 320                    | TWD 9.515                | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 1.288                | RON 6.540                | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 239.293                | \$ 278.214               | 0                                | (3.294)                            | (3.294)                                              | (0,35)                  |
|            | 08.2025          | THB 167.127            | 5.145                    | 0                                | (14)                               | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 7.136               | DKK 45.334               | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 80                     | EGP 4.408                | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 2.203                  | INR 190.066              | 9                                | (1)                                | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 549                    | TWD 17.887               | 73                               | 0                                  | 73                                                   | 0,01                    |
|            | 09.2025          | KZT 53.732             | \$ 99                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN 45                 | 2                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 580                 | KZT 300.957              | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025          | 499                    | 265.240                  | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | AUD 58.659             | \$ 37.847                | 0                                | (596)                              | (596)                                                | (0,06)                  |
|            | 07.2025          | BRL 87.803             | 15.752                   | 0                                | (336)                              | (336)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | CHF 2.077              | 2.522                    | 0                                | (87)                               | (87)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH 19.736             | 2.746                    | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK 134.530            | 21.140                   | 0                                | (27)                               | (27)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 6.072.174            | 42.327                   | 289                              | 0                                  | 289                                                  | 0,03                    |
|            | 07.2025          | SGD 202                | 157                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 2.735               | CHF 2.190                | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 22.372                 | ¥ 3.256.407              | 173                              | 0                                  | 173                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025          | 1.301                  | PLN 4.796                | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 488                    | SGD 623                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF 2.181              | \$ 2.735                 | 0                                | (16)                               | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 15.175             | 2.121                    | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥ 3.244.431            | 22.372                   | 0                                | (173)                              | (173)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | SGD 621                | 488                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 21.140              | DKK 134.201              | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 1.053                  | INR 91.030               | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 11.971                 | BRL 67.202               | 156                              | 0                                  | 156                                                  | 0,02                    |
|            | 09.2025          | 1.950                  | MXN 37.976               | 44                               | 0                                  | 44                                                   | 0,01                    |
|            | 09.2025          | 0                      | PEN 1                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 953                  | RON 4.809                | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 8.492              | \$ 261                   | 0                                | (31)                               | (31)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 534                 | CNY 3.828                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 250                    | IDR 4.073.131            | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 493                    | ILS 1.673                | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 190                    | SGD 242                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | 106                    | THB 3.521                | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 152                  | RON 772                  | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 241                | \$ 190                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 190                 | EGP 10.469               | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 465                    | HUF 160.647              | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 38                     | THB 1.261                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MYR 36.828             | \$ 8.748                 | 0                                | (33)                               | (33)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$ 190                 | KZT 99.323               | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 12.2025          | TRY 8.671              | \$ 186                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 01.2026          | ¥ 260.000              | 1.932                    | 95                               | 0                                  | 95                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | \$ 114                 | SEK 1.076                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR 52.315             | \$ 605                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SEK 1.074              | 114                      | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 514                 | TWD 15.144               | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF 116                | \$ 142                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH 37.393             | 5.181                    | 0                                | (45)                               | (45)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 1.748.363          | 1.277                    | 0                                | (16)                               | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD 926                | 553                      | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 5.362              | 4.174                    | 0                                | (36)                               | (36)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 45.519             | 1.400                    | 0                                | (167)                              | (167)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 2.883               | BRL 16.066               | 61                               | 0                                  | 61                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 695                    | CNY 4.972                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 15.435                 | DKK 101.914              | 600                              | 0                                  | 600                                                  | 0,06                    |
|            | 07.2025          | 3.099                  | PLN 11.500               | 82                               | 0                                  | 82                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 398                    | SGD 509                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR 19.126             | \$ 1.070                 | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 50.835             | 7.066                    | 0                                | (58)                               | (58)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | SGD 508                | 398                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 45.419             | 1.394                    | 0                                | (185)                              | (185)                                                | (0,02)                  |
| MBC        | 08.2025          | \$ 710                 | INR 61.522               | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 61                     | TWD 2.001                | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025          | HUF 139.080            | € 345                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD 1.368              | \$ 882                   | 0                                | (14)                               | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD 53.628             | 39.046                   | 0                                | (257)                              | (257)                                                | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | CNH 17.926             | 2.488                    | 0                                | (18)                               | (18)                                                 | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025          | CNY                    | 1.202                    | \$ 168                           | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 6.041                    | 6.932                            | 0                                  | (159)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 4.530                    | 6.146                            | 0                                  | (62)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 277.347                  | 1.930                            | 10                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 12.881                   | 10.041                           | 0                                  | (73)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | THB                    | 10.085                   | 305                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 21.901                   | 672                              | 0                                  | (82)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 39.061                   | CAD 53.671                       | 281                                | (8)                                                  | 273                     |
|            | 07.2025          |                        | 1.404                    | € 1.215                          | 22                                 | 0                                                    | 22                      |
|            | 07.2025          |                        | 1.015                    | £ 749                            | 11                                 | 0                                                    | 11                      |
|            | 07.2025          |                        | 254                      | IDR 4.134.767                    | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          |                        | 1.672                    | ¥ 241.800                        | 2                                  | 0                                                    | 2                       |
|            | 07.2025          |                        | 544                      | PLN 2.037                        | 20                                 | 0                                                    | 20                      |
|            | 07.2025          |                        | 10.497                   | SGD 13.574                       | 161                                | 0                                                    | 161                     |
|            | 07.2025          |                        | 26                       | TWD 771                          | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 08.2025          | CAD                    | 52.019                   | \$ 37.906                        | 0                                  | (281)                                                | (281)                   |
|            | 08.2025          | CNH                    | 44.575                   | 6.166                            | 0                                  | (80)                                                 | (80)                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 13.543                   | 10.497                           | 0                                  | (163)                                                | (163)                   |
|            | 08.2025          | THB                    | 284.788                  | 8.815                            | 23                                 | 0                                                    | 23                      |
|            | 08.2025          | TWD                    | 33.482                   | 1.033                            | 0                                  | (131)                                                | (131)                   |
|            | 08.2025          | \$                     | 4.575                    | CNH 32.803                       | 22                                 | 0                                                    | 22                      |
|            | 08.2025          |                        | 168                      | CNY 1.198                        | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025          |                        | 130                      | EGP 7.159                        | 11                                 | 0                                                    | 11                      |
|            | 08.2025          |                        | 816                      | TWD 26.025                       | 89                                 | 0                                                    | 89                      |
| MYI        | 07.2025          | ¥                      | 137.169                  | \$ 950                           | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          | \$                     | 7.114                    | ¥ 1.037.456                      | 68                                 | 0                                                    | 68                      |
|            | 07.2025          |                        | 198                      | MYR 839                          | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 07.2025          |                        | 89                       | NOK 895                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          |                        | 7                        | PLN 25                           | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025          | CNH                    | 15.467                   | \$ 2.160                         | 0                                  | (7)                                                  | (7)                     |
|            | 08.2025          | ¥                      | 1.033.642                | 7.114                            | 0                                  | (68)                                                 | (68)                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 895                      | 89                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025          | \$                     | 165                      | CNY 1.178                        | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 09.2025          | CAD                    | 2.962                    | \$ 2.083                         | 0                                  | (95)                                                 | (95)                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 140                      | KZT 72.539                       | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     |
|            | 12.2025          | CZK                    | 11.557                   | € 458                            | 0                                  | (8)                                                  | (8)                     |
|            | 01.2026          | DKK                    | 14.730                   | \$ 2.114                         | 0                                  | (235)                                                | (235)                   |
| RYL        | 04.2026          |                        | 139.250                  | 19.817                           | 0                                  | (2.510)                                              | (2.510)                 |
|            | 07.2025          | ¥                      | 181.300                  | 1.259                            | 4                                  | 0                                                    | 4                       |
| SCX        | 08.2025          | \$                     | 273                      | CNH 1.971                        | 3                                  | 0                                                    | 3                       |
|            | 07.2025          | ILS                    | 51                       | \$ 15                            | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          | TWD                    | 2.368                    | 81                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.593                    | CNY 11.424                       | 5                                  | 0                                                    | 5                       |
|            | 07.2025          |                        | 110                      | EGP 5.952                        | 9                                  | 0                                                    | 9                       |
|            | 07.2025          |                        | 952                      | £ 703                            | 11                                 | 0                                                    | 11                      |
|            | 07.2025          |                        | 1.163                    | IDR 18.942.812                   | 4                                  | 0                                                    | 4                       |
|            | 07.2025          |                        | 9                        | ¥ 1.287                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          |                        | 2.096                    | SGD 2.704                        | 27                                 | 0                                                    | 27                      |
|            | 07.2025          |                        | 952                      | TWD 28.292                       | 22                                 | 0                                                    | 22                      |
|            | 08.2025          | CNH                    | 30.346                   | \$ 4.246                         | 0                                  | (6)                                                  | (6)                     |
|            | 08.2025          | ¥                      | 1.283                    | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025          | SGD                    | 2.697                    | 2.096                            | 0                                  | (27)                                                 | (27)                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 12.286                   | 377                              | 0                                  | (51)                                                 | (51)                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 743                      | INR 63.773                       | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
| SOG        | 07.2025          | RON                    | 1.016                    | \$ 232                           | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.043                    | ¥ 150.499                        | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
|            | 08.2025          | ¥                      | 149.946                  | \$ 1.043                         | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 08.2025          | \$                     | 3                        | HUF 1.239                        | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 08.2025          |                        | 4                        | INR 368                          | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
| SSB        | 07.2025          | £                      | 42.097                   | \$ 57.000                        | 0                                  | (687)                                                | (687)                   |
|            | 07.2025          | PEN                    | 1.894                    | 514                              | 0                                  | (19)                                                 | (19)                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 474                      | KRW 642.064                      | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
| UAG        | 07.2025          | BRL                    | 2.650                    | \$ 477                           | 0                                  | (9)                                                  | (9)                     |
|            | 07.2025          | ILS                    | 509                      | 142                              | 0                                  | (9)                                                  | (9)                     |
|            | 07.2025          | ¥                      | 89.501                   | 618                              | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
|            | 07.2025          | KRW                    | 93.167                   | 69                               | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          | RON                    | 770                      | 175                              | 0                                  | (2)                                                  | (2)                     |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.601                    | 48                               | 0                                  | (1)                                                  | (1)                     |
|            | 07.2025          | \$                     | 69                       | KRW 93.212                       | 0                                  | 0                                                    | 0                       |
|            | 07.2025          |                        | 146                      | NOK 1.480                        | 1                                  | 0                                                    | 1                       |
|            | 08.2025          | CNH                    | 16.292                   | \$ 2.277                         | 0                                  | (6)                                                  | (6)                     |
|            | 08.2025          | \$                     | 9.730                    | CNH 69.781                       | 49                                 | 0                                                    | 49                      |
|            | 09.2025          |                        | 2.083                    | CAD 2.961                        | 94                                 | 0                                                    | 94                      |
|            | 12.2025          | €                      | 458                      | CZK 11.556                       | 8                                  | 0                                                    | 8                       |
|            | 12.2025          | TRY                    | 5.540                    | \$ 118                           | 0                                  | (3)                                                  | (3)                     |
| WST        | 07.2025          | \$                     | 12.008                   | ¥ 1.729.281                      | 0                                  | (36)                                                 | (36)                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 1.722.917                | \$ 12.008                        | 36                                 | 0                                                    | 36                      |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$ 9.295                           | \$ (23.584)                                          | \$ (14.289)             |
|            |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      | (1,51)                  |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Class E USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                 | 311                   | \$ 202                        | \$ 0                          | \$ (2)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 28                    | 33                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 4                     | 5                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 46                    | 28                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 202                   | AUD 311                       | 2                             | 2                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 33                    | € 28                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 5                     | £ 4                           | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 28                    | NZD 46                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNY                 | 22                    | \$ 3                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PEN                 | 38                    | 11                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | SGD                 | 2                     | 1                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.344                 | € 1.182                       | 44                            | 44                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 10                    | PEN 38                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 11                    | 38                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 1                     | SGD 2                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 13                    | ¥ 1.868                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CZK                 | 1                     | \$ 0                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 435                   | 592                           | (4)                           | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.956                 | € 1.722                       | 67                            | 67                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 5                     | £ 4                           | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| BPS<br>BRC | 07.2025          |                     | 2                     | ¥ 327                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 58                    | MYR 243                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1                     | NOK 13                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 46                    | PLN 173                       | 2                             | 2                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 592                   | £ 435                         | 4                             | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 15                    | DKK 101                       | 1                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CLP                 | 9.626                 | \$ 10                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 0                     | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 2.497                 | 18                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 540                   | 57                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| BSH<br>CBK | 07.2025          | \$                  | 0                     | CHF 0                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 10                    | CLP 9.626                     | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 17                    | CNH 124                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.161                 | CNY 8.323                     | 1                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 12                    | DKK 79                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 30                    | € 26                          | 1                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 65                    | IDR 1.060.038                 | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 0                     | SEK 1                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNY                 | 14                    | \$ 2                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 10                    | CLP 9.626                     | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| DUB        | 08.2025          |                     | 57                    | SEK 539                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 76                    | \$ 12                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 2.401                 | 2.785                         | 0                             | (34)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 3                     | SGD 4                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 12                    | DKK 76                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 2.785                 | € 2.396                       | 33                            | 33                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 71                    | \$ 89                         | 0                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 104                   | 16                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 102.590               | 705                           | 0                             | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 2                     | 2                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | \$                  | 201                   | AUD 311                       | 3                             | 3                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 86                    | CHF 71                        | 3                             | 3                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.257                 | ¥ 180.321                     | 0                             | (9)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 27                    | NZD 46                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 56                    | SEK 538                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 8                     | SGD 10                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 89                    | CHF 71                        | 1                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 16                    | DKK 104                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 705                   | ¥ 102.213                     | 5                             | 5                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 2                     | SGD 2                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| GLM        | 07.2025          | SGD                 | 1                     | \$ 1                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 81                    | THB 2.633                     | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNY                 | 79                    | \$ 11                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 1                     | SGD 1                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 544                   | \$ 396                        | 0                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CZK                 | 2                     | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PLN                 | 172                   | 48                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 32                    | 25                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 2.633                 | 81                            | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 396                   | CAD 544                       | 3                             | 3                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          |                     | 1                     | CNY 8                         | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 33                    | € 28                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 5                     | £ 4                           | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 22                    | ILS 76                        | 1                             | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 67                    | ¥ 9.668                       | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 169                   | KRW 231.319                   | 3                             | 3                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 24                    | SGD 31                        | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNY                 | 8                     | \$ 1                          | 0                             | 0                                             | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung |           | Zu erhaltende Währung |           | Nicht realisierte Wertzunahme |         | Nicht realisierte Wertabnahme |     | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |      |
|------------|------------------|---------------------|-----------|-----------------------|-----------|-------------------------------|---------|-------------------------------|-----|-----------------------------------------------|----------------------|------|
| MYI        | 08.2025          | \$                  | 396       | CAD                   | 543       | \$                            | 3       | \$                            | 0   | \$                                            | 3                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 0         | CZK                   | 2         |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 48        | PLN                   | 173       |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 25        | SGD                   | 32        |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 81        | THB                   | 2.629     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 37.941    | \$                    | 261       |                               | 0       | (2)                           | (2) |                                               | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | NOK                 | 122       |                       | 12        |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 129       |                       | 4         |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | \$                  | 25        | CZK                   | 551       |                               | 1       |                               | 0   |                                               | 1                    | 0,00 |
|            | 07.2025          |                     | 28        | ¥                     | 4.073     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          |                     | 53        | MXN                   | 1.033     |                               | 2       |                               | 0   |                                               | 2                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 261       | ¥                     | 37.802    |                               | 2       |                               | 0   |                                               | 2                    | 0,00 |
| RBC        | 08.2025          |                     | 12        | NOK                   | 122       |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | MYR                 | 243       | \$                    | 57        |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
| SCX        | 08.2025          | \$                  | 57        | MYR                   | 243       |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | CNY                 | 8.329     | \$                    | 1.163     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
| SSB        | 07.2025          | ¥                   | 1.037     |                       | 7         |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | MXN                 | 1.033     |                       | 54        |                               | 0       | (1)                           | (1) |                                               | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | SGD                 | 6         |                       | 5         |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | \$                  | 246       | CNH                   | 1.762     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 1.163     | CNY                   | 8.306     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 7         | ¥                     | 1.033     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 54        | MXN                   | 1.033     |                               | 1       |                               | 0   |                                               | 1                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 5         | SGD                   | 6         |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 96        | \$                    | 13        |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | \$                  | 584       | £                     | 431       |                               | 7       |                               | 0   |                                               | 7                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 13        | CNH                   | 96        |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
| UAG        | 07.2025          | CNH                 | 1.790     | \$                    | 250       |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | CZK                 | 548       |                       | 26        |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
| WST        | 07.2025          | IDR                 | 1.060.038 |                       | 65        |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 231.319   |                       | 170       |                               | 0       | (1)                           | (1) |                                               | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 10        | HUF                   | 3.734     |                               | 1       |                               | 0   |                                               | 1                    | 0,00 |
|            | 07.2025          |                     | 18        | ¥                     | 2.658     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 07.2025          |                     | 12        | NOK                   | 121       |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 250       | CNH                   | 1.786     |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 26        | CZK                   | 547       |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 65        | IDR                   | 1.060.038 |                               | 0       |                               | 0   |                                               | 0                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 170       | KRW                   | 231.319   |                               | 1       |                               | 0   |                                               | 1                    | 0,00 |
|            | 07.2025          | €                   | 529       | \$                    | 620       |                               | 0       | (1)                           | (1) |                                               | 0,00                 |      |
|            | 07.2025          | ¥                   | 54.479    |                       | 378       |                               | 1       |                               | 0   |                                               | 1                    | 0,00 |
|            | 08.2025          | \$                  | 622       | €                     | 529       |                               | 1       |                               | 0   |                                               | 1                    | 0,00 |
|            | 08.2025          |                     | 378       | ¥                     | 54.279    |                               | 0       | (1)                           | (1) |                                               | 0,00                 |      |
|            |                  |                     |           |                       |           | \$ 194                        | \$ (64) | \$ 130                        |     | 0,02                                          |                      |      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional EDR (hedged) insgesamt die folgenden Devisenterminkontrakte aus: |                  |                     |                       |                               |                                 |                                               |                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| Kontrahent                                                                                                                     | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
| AZD                                                                                                                            | 07.2025          | €                   | 8.186                 | \$ 9.585                      | \$ 0                            | \$ (25)                                       | 0,00                 |
|                                                                                                                                | 07.2025          | \$                  | 8.377                 | € 7.373                       | 277                             | 0                                             | 0,03                 |
|                                                                                                                                | 08.2025          |                     | 9.606                 | 8.186                         | 24                              | 0                                             | 0,00                 |
| BOA                                                                                                                            | 07.2025          |                     | 8.844                 | 7.778                         | 287                             | 0                                             | 0,03                 |
| BRC                                                                                                                            | 07.2025          | €                   | 176                   | \$ 202                        | 0                               | (5)                                           | 0,00                 |
|                                                                                                                                | 07.2025          | \$                  | 8.852                 | € 7.795                       | 299                             | 0                                             | 0,03                 |
| CBK                                                                                                                            | 07.2025          |                     | 401                   | 348                           | 7                               | 0                                             | 0,00                 |
| DUB                                                                                                                            | 07.2025          | €                   | 8.202                 | \$ 9.515                      | 0                               | (114)                                         | (0,01)               |
|                                                                                                                                | 08.2025          | \$                  | 9.515                 | € 8.184                       | 113                             | 0                                             | 0,01                 |
| MBC                                                                                                                            | 07.2025          |                     | 872                   | 753                           | 12                              | 0                                             | 0,00                 |
|                                                                                                                                |                  |                     |                       | \$ 1.019                      | \$ (144)                        | \$ 875                                        | 0,09                 |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (14.240) (1,51)

#### BESCHREIBUNG

#### SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE

Credit Suisse AG AT1 Claim

|          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|----------|----------------|--------------------------|------------------------------|
|          |                |                          |                              |
| \$ 1.400 | \$ 168         |                          | 0,02                         |

Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte

\$ 168 0,02

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

#### US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

Uniform Mortgage-Backed Security, TBA

|                              |        |          |        |
|------------------------------|--------|----------|--------|
| 2,000 % fällig am 01.07.2040 | 15.400 | (14.076) | (1,49) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055 | 36.750 | (29.101) | (3,09) |
| 2,000 % fällig am 01.08.2055 | 50.000 | (39.608) | (4,19) |
| 2,500 % fällig am 01.08.2055 | 7.500  | (6.221)  | (0,66) |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                     | PARI (000\$) | MARKT-WERT (000\$) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|----------------------------------|--------------|--------------------|-----------------------|
| 3,500 % fällig am 01.08.2055     | \$ 6.000     | \$ (5.401)         | (0,57)                |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055     | 18.800       | (18.783)           | (1,99)                |
| 6,500 % fällig am 01.07.2055 (h) | 11.800       | (12.185)           | (1,29)                |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere  |              | \$ (125.375)       | (13,28)               |
| Summe Anlagen                    |              | \$ 1.137.506       | 120,45                |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |              | \$ (193.101)       | (20,45)               |
| Nettovermögen                    |              | \$ 944.405         | 100,00                |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: null):

| Emittentenbeschreibung | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum  | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------------------|---------|------------------|------------|----------|-----------|----------------------|
| CIMA Luxembourg SARL   | 1,000 % | 13.03.2027       | 08.05.2025 | \$ 2.143 | \$ 2.241  | 0,24                 |

(h) Ein zum 30. Juni 2025 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 5.879 USD (31. Dezember 2024: 998 USD) als Sicherheiten verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 1.850 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 25.250 USD (31. Dezember 2024: 29.542 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 14.440 USD (31. Dezember 2024: 10 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 1.265.868                                                    | \$ 4.624                                                     | \$ 1.270.492 |
| Investmentfonds                     | 6.737                                                                       | 0                                                               | 0                                                            | 6.737        |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 1.078                                                                       | (15.594)                                                        | 0                                                            | (14.516)     |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 168                                                             | 0                                                            | 168          |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (125.375)                                                       | 0                                                            | (125.375)    |
| Summen                              | \$ 7.815                                                                    | \$ 1.125.067                                                    | \$ 4.624                                                     | \$ 1.137.506 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 1.090.606                                                    | \$ 0                                                         | \$ 1.090.606 |
| Investmentfonds                     | 94.828                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 94.828       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (338)                                                                       | 15.686                                                          | 0                                                            | 15.348       |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 175                                                             | 0                                                            | 175          |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (174.563)                                                       | 0                                                            | (174.563)    |
| Summen                              | \$94.490                                                                    | \$ 931.904                                                      | \$ 0                                                         | \$ 1.026.394 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BOS                                | 4,250 %    | 18.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (977)     | \$ (978)                                 | (0,10)               |
| BRC                                | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (891)      | (1.047)                                  | (0,11)               |
|                                    | 4,150      | 20.12.2024       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (606)     | (619)                                    | (0,07)               |
| DEU                                | 4,400      | 27.06.2025       | 03.07.2025         | (1.379)      | (1.380)                                  | (0,15)               |
|                                    | 4,420      | 23.06.2025       | 07.07.2025         | (597)        | (598)                                    | (0,06)               |
| MEI                                | 1,500      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (1.202)      | (1.202)                                  | (0,13)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (5.824)                               | (0,62)               |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                            | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte <sup>(1)</sup> | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------------------------|----------------------|
| BRC                                   | 4,410 %    | 30.06.2025       | 07.07.2025       | \$ (1.877)   | \$ (1.877)                                                 | (0,20)               |
| Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte |            |                  |                  |              | \$ (1.877)                                                 | (0,20)               |

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 1 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 191                           | \$ 0                               | \$ 191                          | \$ (19)                          | \$ 0                               | \$ (19)                         |
| BOA        | (8.672)                          | 8.300                              | (372)                           | 649                              | (420)                              | 229                             |
| BPS        | (1.602)                          | 1.560                              | (42)                            | 1.327                            | (1.200)                            | 127                             |
| BRC        | 280                              | (140)                              | 140                             | 4.139                            | (3.850)                            | 289                             |
| BSH        | 587                              | (430)                              | 157                             | (2)                              | 0                                  | (2)                             |
| CBK        | 125                              | 0                                  | 125                             | 1.311                            | (660)                              | 651                             |
| DUB        | 12                               | 0                                  | 12                              | 552                              | (560)                              | (8)                             |
| FAR        | (537)                            | 240                                | (297)                           | 781                              | (660)                              | 121                             |
| GLM        | 25                               | 0                                  | 25                              | 580                              | (590)                              | (10)                            |
| GST        | (414)                            | 0                                  | (414)                           | 635                              | 0                                  | 635                             |
| IND        | 9                                | 0                                  | 9                               | 44                               | 0                                  | 44                              |
| JPM        | (72)                             | 190                                | 118                             | 782                              | (730)                              | 52                              |
| MBC        | (642)                            | 670                                | 28                              | 4.869                            | (4.070)                            | 799                             |
| MYC        | (127)                            | 10                                 | (117)                           | (42)                             | 10                                 | (32)                            |
| MYI        | (2.805)                          | 2.660                              | (145)                           | (18)                             | 0                                  | (18)                            |
| RYL        | 7                                | 0                                  | 7                               | 20                               | 0                                  | 20                              |
| SCX        | 2                                | 0                                  | 2                               | 118                              | 0                                  | 118                             |
| SOG        | (3)                              | 0                                  | (3)                             | (20)                             | 0                                  | (20)                            |
| SSB        | (698)                            | 810                                | 112                             | 690                              | (660)                              | 30                              |
| TOR        | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           | 482                              | (480)                              | 2                               |
| UAG        | 94                               | 0                                  | 94                              | 389                              | (390)                              | (1)                             |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 30,71             | 30,95             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 25,71             | 24,97             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,46              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 0,30              | 4,87              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,18              | 0,14              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,47              | 0,67              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,50              | 0,96              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,01              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 41,66             | 37,43             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                                                             | 4,20              | 1,98              |
| Belgien                                                                                | 0,50              | 0,39              |
| Kanada                                                                                 | 6,32              | 7,04              |
| Kaimaninseln                                                                           | 2,25              | 1,67              |
| Chile                                                                                  | 0,09              | 0,07              |
| China                                                                                  | 0,66              | 0,82              |
| Dänemark                                                                               | 0,42              | 0,66              |
| Ägypten                                                                                | 0,22              | k. A.             |
| Finnland                                                                               | 0,10              | 0,08              |
| Frankreich                                                                             | 7,63              | 2,87              |
| Deutschland                                                                            | 0,69              | 0,27              |
| Ungarn                                                                                 | 0,52              | 0,30              |
| Irland                                                                                 | 4,26              | 3,15              |
| Israel                                                                                 | 1,21              | 1,14              |
| Italien                                                                                | 0,32              | 0,46              |
| Japan                                                                                  | 7,08              | 3,99              |
| Luxemburg                                                                              | 0,24              | 0,05              |
| Malaysia                                                                               | 1,71              | 1,32              |
| Mexiko                                                                                 | 0,03              | 0,03              |
| Multinational                                                                          | 0,04              | 0,04              |
| Niederlande                                                                            | 0,83              | 0,85              |
| Neuseeland                                                                             | 0,03              | 0,03              |
| Norwegen                                                                               | 0,32              | 0,30              |
| Peru                                                                                   | 0,82              | 0,68              |
| Polen                                                                                  | 0,61              | 0,35              |
| Portugal                                                                               | 0,03              | 0,03              |
| Katar                                                                                  | 0,04              | 0,03              |
| Rumänien                                                                               | 1,32              | 1,03              |
| Saudi-Arabien                                                                          | 1,23              | 0,53              |
| Serbien                                                                                | 0,16              | 0,12              |
| Singapur                                                                               | 1,96              | 1,36              |
| Südafrika                                                                              | 0,75              | 0,59              |
| Südkorea                                                                               | 2,43              | 2,75              |
| Spanien                                                                                | 6,34              | 1,11              |
| Supranational                                                                          | 0,43              | 0,74              |
| Schweden                                                                               | 0,09              | 0,06              |
| Schweiz                                                                                | 1,58              | 1,44              |
| Thailand                                                                               | 1,35              | 1,22              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 0,14              | 0,05              |
| Großbritannien                                                                         | 8,84              | 6,30              |
| USA                                                                                    | 65,82             | 43,69             |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,93              | 9,88              |
| Investmentfonds                                                                        | 0,71              | 8,65              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,33              | 0,04              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | (0,03)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,07              | 0,01              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,40)            | (0,21)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | 0,04              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | 0,06              |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | k. A.             | 0,07              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,01)            | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,09)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen - Schutzkauf    | (0,01)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,00              |
| Cross-Currency Swaps                                                                   | (0,04)            | 0,16              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,01              | 0,00              |
| Total Return Swaps auf Indizes                                                         | (0,07)            | 0,07              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (1,51)            | 1,38              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,11              | (0,10)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,02              | 0,02              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (13,28)           | (15,92)           |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (20,45)           | 6,38              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

Halbjahresbericht | 30. Juni 2025 551



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Nidda Healthcare Holding GmbH</b><br>5,625 % fällig am 21.02.2030          | € 7.380        | \$ 8.848                 | 0,31                              |
| <b>WEPA Hygieneprodukte GmbH</b><br>2,875 % fällig am 15.12.2027              | 1.100          | 1.276                    | 0,04                              |
|                                                                               |                | 68.443                   | 2,36                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>TK Elevator Midco GmbH</b><br>5,848 % fällig am 30.04.2030                 | 4.600          | 5.395                    | 0,19                              |
| 7,237 % fällig am 30.04.2030                                                  | \$ 3.500       | 3.513                    | 0,12                              |
|                                                                               |                | 8.908                    | 0,31                              |
| Summe Deutschland                                                             |                | 77.351                   | 2,67                              |
| <b>IRLAND</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Jazz Securities DAC</b><br>4,375 % fällig am 15.01.2029                    | 25             | 24                       | 0,00                              |
| <b>Motion Bondco DAC</b><br>6,625 % fällig am 15.11.2027                      | 1.694          | 1.601                    | 0,06                              |
| <b>Perrigo Finance Unlimited Co.</b><br>5,375 % fällig am 30.09.2032          | € 775          | 935                      | 0,03                              |
| <b>Quercus Re DAC</b><br>10,176 % fällig am 06.01.2031                        | 250            | 301                      | 0,01                              |
| <b>Windmill Re DAC</b><br>7,599 % fällig am 05.07.2028                        | 250            | 296                      | 0,01                              |
| Summe Irland                                                                  |                | 3.157                    | 0,11                              |
| <b>ISRAEL</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Energean Israel Finance Ltd.</b><br>5,375 % fällig am 30.03.2028           | \$ 2.000       | 1.909                    | 0,07                              |
| <b>ITALIEN</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>AgriFarm SpA</b><br>4,500 % fällig am 31.10.2028                           | € 2.700        | 3.177                    | 0,11                              |
| <b>Banca Monte dei Paschi di Siena SpA</b><br>10,500 % fällig am 23.07.2029   | 3.000          | 4.412                    | 0,15                              |
| <b>Cerved Group SpA</b><br>6,000 % fällig am 15.02.2029                       | 5.398          | 6.151                    | 0,21                              |
| 7,225 % fällig am 15.02.2029                                                  | 1.300          | 1.518                    | 0,05                              |
| <b>Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC</b><br>7,500 % fällig am 15.02.2032       | \$ 5.225       | 5.295                    | 0,18                              |
| <b>Fibercop SpA</b><br>1,625 % fällig am 18.01.2029                           | € 2.300        | 2.476                    | 0,08                              |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033                                                  | \$ 1.150       | 1.123                    | 0,04                              |
| <b>FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA</b><br>5,625 % fällig am 01.08.2027    | € 2.000        | 2.376                    | 0,08                              |
| <b>IMA Industria Macchine Automatiche SpA</b><br>3,750 % fällig am 15.01.2028 | 7.600          | 8.872                    | 0,31                              |
| <b>Intesa Sanpaolo SpA</b><br>4,198 % fällig am 01.06.2032                    | \$ 8.700       | 8.007                    | 0,28                              |
| 7,700 % fällig am 17.09.2025 (d)(f)                                           | 1.600          | 1.607                    | 0,06                              |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (d)(f)                                           | € 2.000        | 2.475                    | 0,09                              |
| <b>Italmatch Chemicals SpA</b><br>7,480 % fällig am 06.02.2028                | 4.287          | 5.080                    | 0,17                              |
| 10,000 % fällig am 06.02.2028                                                 | 500            | 618                      | 0,02                              |
| <b>Lottomatica Group SpA</b><br>4,875 % fällig am 31.01.2031                  | 2.300          | 2.772                    | 0,10                              |
| <b>Mundys SpA</b><br>4,500 % fällig am 24.01.2030                             | 700            | 855                      | 0,03                              |
| <b>TeamSystem SpA</b><br>5,000 % fällig am 01.07.2031 (a)                     | 800            | 939                      | 0,03                              |
| 5,194 % fällig am 01.07.2032 (a)                                              | 4.100          | 4.814                    | 0,17                              |
| 5,779 % fällig am 31.07.2031                                                  | 2.400          | 2.826                    | 0,10                              |
| <b>Telecom Italia SpA</b><br>7,875 % fällig am 31.07.2028                     | 925            | 1.221                    | 0,04                              |
| <b>UniCredit SpA</b><br>5,459 % fällig am 30.06.2035                          | \$ 12.300      | 12.234                   | 0,42                              |
| <b>Webuild SpA</b><br>5,375 % fällig am 20.06.2029                            | € 469          | 579                      | 0,02                              |
| Summe Italien                                                                 |                | 79.427                   | 2,74                              |

| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>JAPAN</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Rakuten Group, Inc.</b><br>8,125 % fällig am 15.12.2029 (d)                | \$ 1.625       | \$ 1.593                 | 0,05                              |
| 9,750 % fällig am 15.04.2029                                                  | 3.600          | 3.953                    | 0,14                              |
| 11,250 % fällig am 15.02.2027                                                 | 2.800          | 3.047                    | 0,10                              |
| <b>SoftBank Group Corp.</b><br>4,000 % fällig am 06.07.2026                   | 2.000          | 1.971                    | 0,07                              |
| 5,125 % fällig am 19.09.2027                                                  | 2.000          | 1.979                    | 0,07                              |
| 5,375 % fällig am 08.01.2029                                                  | € 3.300        | 3.943                    | 0,14                              |
| 5,750 % fällig am 08.07.2032                                                  | 1.300          | 1.527                    | 0,05                              |
| 6,750 % fällig am 08.07.2029                                                  | \$ 5.000       | 5.110                    | 0,18                              |
| 7,000 % fällig am 08.07.2031 (h)                                              | 3.200          | 3.283                    | 0,11                              |
| Summe Japan                                                                   |                | 26.406                   | 0,91                              |
| <b>JERSEY, KANALINSELN</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>         |                |                          |                                   |
| <b>Aston Martin Capital Holdings Ltd.</b><br>10,000 % fällig am 31.03.2029    | 8.475          | 8.034                    | 0,28                              |
| 10,375 % fällig am 31.03.2029                                                 | £ 1.700        | 2.178                    | 0,08                              |
| <b>Avis Budget Finance PLC</b><br>7,000 % fällig am 28.02.2029                | € 1.200        | 1.435                    | 0,05                              |
| 7,250 % fällig am 31.07.2030                                                  | 800            | 957                      | 0,03                              |
| <b>CPUK Finance Ltd.</b><br>6,500 % fällig am 28.08.2026                      | £ 5.800        | 7.913                    | 0,27                              |
| <b>Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.</b><br>3,250 % fällig am 12.11.2025 | € 11.179       | 13.037                   | 0,45                              |
| Summe Jersey, Kanalinseln                                                     |                | 33.554                   | 1,16                              |
| <b>LIBERIA</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Royal Caribbean Cruises Ltd.</b><br>5,375 % fällig am 15.07.2027           | \$ 2.700       | 2.718                    | 0,09                              |
| <b>LUXEMBURG</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>Albion Financing 1 SARL</b><br>7,000 % fällig am 21.05.2030                | 15.025         | 15.371                   | 0,53                              |
| <b>Aroundtown Finance SARL</b><br>7,125 % fällig am 16.01.2030 (d)            | € 4.850        | 5.996                    | 0,21                              |
| 8,625 % fällig am 07.05.2029 (d)                                              | £ 665          | 924                      | 0,03                              |
| <b>Camelot Finance S.A.</b><br>4,500 % fällig am 01.11.2026                   | \$ 1.357       | 1.337                    | 0,05                              |
| <b>Cidron Aida Finco SARL</b><br>7,000 % fällig am 27.10.2031                 | € 2.400        | 2.886                    | 0,10                              |
| <b>ContourGlobal Power Holdings S.A.</b><br>3,125 % fällig am 01.01.2028      | 5.100          | 5.919                    | 0,20                              |
| 5,000 % fällig am 28.02.2030                                                  | 1.200          | 1.423                    | 0,05                              |
| <b>CPI Property Group S.A.</b><br>1,750 % fällig am 14.01.2030                | 5.000          | 5.155                    | 0,18                              |
| 4,000 % fällig am 22.01.2028                                                  | £ 2.900        | 3.792                    | 0,13                              |
| <b>Cullinan Holdco SCSp</b><br>4,625 % fällig am 15.10.2026 (h)               | € 3.100        | 3.151                    | 0,11                              |
| <b>Essendi S.A.</b><br>5,375 % fällig am 15.05.2030                           | 1.600          | 1.918                    | 0,07                              |
| 5,500 % fällig am 15.11.2031                                                  | 3.300          | 3.948                    | 0,14                              |
| 6,375 % fällig am 15.10.2029                                                  | 800            | 986                      | 0,03                              |
| <b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b><br>6,500 % fällig am 15.03.2030         | \$ 4.175       | 4.268                    | 0,15                              |
| <b>LHMC Finco 2 SARL</b><br>8,625 % fällig am 15.05.2030                      | € 500          | 612                      | 0,02                              |
| <b>Loarre Investments SARL</b><br>6,500 % fällig am 15.05.2029                | 17.000         | 20.617                   | 0,71                              |
| <b>Luna 2 SSARL</b><br>5,500 % fällig am 01.07.2032 (a)                       | 875            | 1.048                    | 0,04                              |
| <b>Matterhorn Telecom S.A.</b><br>4,500 % fällig am 30.01.2030                | 860            | 1.032                    | 0,03                              |
| <b>Millicom International Cellular S.A.</b><br>5,125 % fällig am 15.01.2028   | \$ 1.800       | 1.780                    | 0,06                              |
| <b>Motion Finco SARL</b><br>8,375 % fällig am 15.02.2032                      | 1.550          | 1.421                    | 0,05                              |
| <b>Telecom Italia Capital S.A.</b><br>6,375 % fällig am 15.11.2033            | 1.700          | 1.775                    | 0,06                              |
|                                                                               |                | 85.359                   | 2,95                              |

| BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                          |                |                          |                                   |
| <b>Albion Financing SARL</b><br>7,302 % fällig am 16.08.2029                       | \$ 0           | \$ 0                     | 0,00                              |
| Summe Luxemburg                                                                    |                | 85.359                   | 2,95                              |
| <b>MULTINATIONAL</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                    |                |                          |                                   |
| <b>Allied Universal Holdco LLC</b><br>4,625 % fällig am 01.06.2028                 | 4.000          | 3.884                    | 0,14                              |
| <b>American Airlines, Inc.</b><br>5,500 % fällig am 20.04.2026                     | 5.433          | 5.424                    | 0,19                              |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029                                                       | 10.800         | 10.797                   | 0,37                              |
| <b>Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC</b><br>2,000 % fällig am 01.09.2028      | € 13.312       | 14.846                   | 0,51                              |
| <b>Clarios Global LP</b><br>6,750 % fällig am 15.02.2030                           | \$ 300         | 312                      | 0,01                              |
| <b>Connect Finco SARL</b><br>9,000 % fällig am 15.09.2029 (h)                      | 1.450          | 1.459                    | 0,05                              |
| <b>JetBlue Airways Corp.</b><br>9,875 % fällig am 20.09.2031                       | 11.725         | 11.414                   | 0,40                              |
| <b>Toucan FinCo Ltd.</b><br>8,250 % fällig am 15.05.2030                           | € 4.400        | 5.168                    | 0,18                              |
| 9,500 % fällig am 15.05.2030                                                       | \$ 3.700       | 3.786                    | 0,13                              |
| <b>VistaJet Malta Finance PLC</b><br>6,375 % fällig am 01.02.2030 (h)              | 375            | 352                      | 0,01                              |
| 7,875 % fällig am 01.05.2027                                                       | 1.750          | 1.762                    | 0,06                              |
| 9,500 % fällig am 01.06.2028                                                       | 1.750          | 1.800                    | 0,06                              |
| Summe multinational                                                                |                | 61.004                   | 2,11                              |
| <b>NIEDERLANDE</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Ashland Services BV</b><br>2,000 % fällig am 30.01.2028                         | € 1.875        | 2.130                    | 0,07                              |
| <b>Axalta Coating Systems Dutch Holding BV</b><br>7,250 % fällig am 15.02.2031 (h) | \$ 9.400       | 9.922                    | 0,34                              |
| <b>Boels Topholding BV</b><br>6,250 % fällig am 15.02.2029                         | € 1.100        | 1.342                    | 0,05                              |
| <b>Flora Food Management BV</b><br>6,875 % fällig am 02.07.2029                    | 7.500          | 8.951                    | 0,31                              |
| <b>Goodyear Europe BV</b><br>2,750 % fällig am 15.08.2028                          | 350            | 399                      | 0,01                              |
| <b>IPD BV</b><br>5,350 % fällig am 15.06.2031                                      | 5.100          | 5.992                    | 0,21                              |
| <b>Sigma Holdco BV</b><br>5,750 % fällig am 15.05.2026                             | 2.022          | 2.372                    | 0,08                              |
| <b>Telefonica Europe BV</b><br>5,752 % fällig am 15.01.2032 (d)                    | 4.800          | 5.859                    | 0,20                              |
| <b>Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV</b><br>4,125 % fällig am 01.06.2031  | 2.400          | 2.829                    | 0,10                              |
| 4,375 % fällig am 09.05.2030                                                       | 9.100          | 10.909                   | 0,38                              |
| 5,750 % fällig am 01.12.2030                                                       | \$ 2.400       | 2.445                    | 0,08                              |
| 6,000 % fällig am 01.12.2032                                                       | 3.575          | 3.654                    | 0,13                              |
| <b>Trivium Packaging Finance BV</b><br>6,625 % fällig am 15.07.2030                | € 500          | 608                      | 0,02                              |
| 8,250 % fällig am 15.07.2030                                                       | \$ 1.275       | 1.349                    | 0,05                              |
| <b>United Group BV</b><br>3,625 % fällig am 15.02.2028                             | € 3.030        | 3.483                    | 0,12                              |
| <b>VZ Secured Financing BV</b><br>5,000 % fällig am 15.01.2032                     | \$ 5.725       | 5.098                    | 0,18                              |
| <b>ZF Europe Finance BV</b><br>3,000 % fällig am 23.10.2029                        | € 3.000        | 3.054                    | 0,10                              |
| 6,125 % fällig am 13.03.2029 (h)                                                   | 10.000         | 11.540                   | 0,40                              |
| 7,000 % fällig am 12.06.2030                                                       | 1.500          | 1.766                    | 0,06                              |
| <b>Ziggo Bond Co. BV</b><br>5,125 % fällig am 28.02.2030                           | \$ 4.175       | 3.649                    | 0,13                              |
| <b>Ziggo BV</b><br>4,875 % fällig am 15.01.2030                                    | 1.300          | 1.216                    | 0,04                              |
| Summe Niederlande                                                                  |                | 88.567                   | 3,06                              |
| <b>NORWEGEN</b><br><b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>Archer Norge A/S</b><br>9,500 % fällig am 25.02.2030                            | 2.750          | 2.841                    | 0,10                              |
| <b>TGS ASA</b><br>8,500 % fällig am 15.01.2030                                     | 7.525          | 7.797                    | 0,27                              |

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Var Energi ASA</b>                            |                |                          |                                   |
| 7,862 % fällig am 15.11.2083                     | € 1.900        | \$ 2.453                 | 0,08                              |
| Summe Norwegen                                   |                | 13.091                   | 0,45                              |
| <b>PANAMA</b>                                    |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Carnival Corp.</b>                            |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028                     | \$ 11.000      | 10.773                   | 0,37                              |
| 5,750 % fällig am 15.03.2030                     | 6.500          | 6.614                    | 0,23                              |
| 5,875 % fällig am 15.06.2031                     | 1.050          | 1.071                    | 0,04                              |
| Summe Panama                                     |                | 18.458                   | 0,64                              |
| <b>POLEN</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Synthos S.A.</b>                              |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 07.06.2028 (h)                 | € 1.600        | 1.775                    | 0,06                              |
| <b>SINGAPUR</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Seagate Data Storage Technology Pte Ltd.</b>  |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 15.07.2030                     | \$ 6.975       | 7.097                    | 0,25                              |
| <b>SLOWENIEN</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Nova Ljubljanska Banka d.d.</b>               |                |                          |                                   |
| 10,750 % fällig am 28.11.2032                    | € 2.000        | 2.707                    | 0,09                              |
| <b>SPANIEN</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Lorca Telecom Bondco S.A.</b>                 |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 30.04.2029                     | 1.600          | 1.964                    | 0,07                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>        |                |                          |                                   |
| <b>Subcalidora</b>                               |                |                          |                                   |
| 7,730 % fällig am 14.08.2029                     | 10.875         | 12.830                   | 0,44                              |
| Summe Spanien                                    |                | 14.794                   | 0,51                              |
| <b>SCHWEDEN</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Asmodee Group AB</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 15.12.2029                     | 267            | 328                      | 0,01                              |
| <b>Castellum AB</b>                              |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 02.12.2026 (d)                 | 9.300          | 10.702                   | 0,37                              |
| <b>Heimstaden Bostad AB</b>                      |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.01.2026 (d)                 | 700            | 814                      | 0,03                              |
| <b>Samhallsbyggnadsbolaget Norden Holding AB</b> |                |                          |                                   |
| 0,750 % fällig am 14.11.2028                     | 2.800          | 2.597                    | 0,09                              |
| 2,375 % fällig am 04.08.2026                     | 3.900          | 4.383                    | 0,15                              |
| <b>Verisure Holding AB</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 15.05.2030                     | 300            | 367                      | 0,01                              |
| Summe Schweden                                   |                | 19.191                   | 0,66                              |
| <b>SCHWEIZ</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>UBS Group AG</b>                              |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 13.11.2028 (d)(f)              | \$ 300         | 328                      | 0,01                              |
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Amber Finco PLC</b>                           |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 15.07.2029                     | € 1.600        | 1.969                    | 0,07                              |
| <b>Barclays PLC</b>                              |                |                          |                                   |
| 8,375 % fällig am 15.09.2031 (d)(f)              | £ 700          | 990                      | 0,03                              |
| <b>BCP Modular Services Finance PLC</b>          |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028                     | € 13.300       | 15.385                   | 0,53                              |
| 6,750 % fällig am 30.11.2029                     | 1.425          | 1.498                    | 0,05                              |
| <b>Bellis Acquisition Co. PLC</b>                |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 01.07.2031 (a)                 | 4.300          | 5.066                    | 0,18                              |
| <b>Boparan Finance PLC</b>                       |                |                          |                                   |
| 9,375 % fällig am 07.11.2029                     | £ 12.500       | 17.790                   | 0,62                              |
| <b>Burford Capital PLC</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.12.2026 (h)                 | 6.828          | 9.260                    | 0,32                              |

| BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Canary Wharf Group Investment Holdings PLC</b> |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 07.04.2026                      | € 13.100       | \$ 15.166                | 0,52                              |
| <b>Carnival PLC</b>                               |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 28.10.2029                      | 6.650          | 7.050                    | 0,24                              |
| <b>Deuce Finco PLC</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 15.06.2027                      | £ 7.000        | 9.533                    | 0,33                              |
| <b>Drax Finco PLC</b>                             |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029                      | € 4.800        | 5.902                    | 0,20                              |
| <b>EC Finance PLC</b>                             |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 15.10.2026                      | 2.000          | 2.297                    | 0,08                              |
| <b>Gatwick Airport Finance PLC</b>                |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 07.04.2026                      | £ 250          | 341                      | 0,01                              |
| <b>Heathrow Finance PLC</b>                       |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 01.03.2027                      | 2.000          | 2.661                    | 0,09                              |
| 4,125 % fällig am 01.09.2029                      | 3.333          | 4.211                    | 0,15                              |
| <b>INEOS Finance PLC</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 15.08.2030 (h)                  | € 2.100        | 2.402                    | 0,08                              |
| 6,750 % fällig am 15.05.2028                      | \$ 625         | 621                      | 0,02                              |
| <b>Market Bidco Finco PLC</b>                     |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 04.11.2027                      | £ 10.300       | 13.885                   | 0,48                              |
| <b>Marks &amp; Spencer PLC</b>                    |                |                          |                                   |
| 7,125 % fällig am 01.12.2037                      | \$ 194         | 209                      | 0,01                              |
| <b>Miller Homes Group Finco PLC</b>               |                |                          |                                   |
| 6,529 % fällig am 15.10.2030 (g)                  | € 1.700        | 2.031                    | 0,07                              |
| <b>Ocado Group PLC</b>                            |                |                          |                                   |
| 10,500 % fällig am 08.08.2029                     | £ 175          | 234                      | 0,01                              |
| 11,000 % fällig am 15.06.2030                     | 3.700          | 4.949                    | 0,17                              |
| <b>Pinnacle Bidco PLC</b>                         |                |                          |                                   |
| 8,250 % fällig am 11.10.2028                      | € 6.500        | 8.020                    | 0,28                              |
| <b>Virgin Media Secured Finance PLC</b>           |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.01.2030                      | £ 16.050       | 20.172                   | 0,70                              |
| <b>Vmed O2 UK Financing PLC</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 31.01.2031                      | \$ 8.000       | 7.334                    | 0,25                              |
| 4,750 % fällig am 15.07.2031                      | 5.000          | 4.628                    | 0,16                              |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032 (a)                  | € 9.000        | 10.723                   | 0,37                              |
| Summe Großbritannien                              |                | 174.327                  | 6,02                              |

## AKTIEN

|                                           |        |     |      |
|-------------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>USA</b>                                |        |     |      |
| <b>STAMMAKTIEN</b>                        |        |     |      |
| <b>ENERGIE</b>                            |        |     |      |
| <b>New Fortress Energy, Inc. 'A' (c)</b>  | 68.644 | 228 | 0,01 |
| <b>INDUSTRIEWERTE</b>                     |        |     |      |
| <b>Spirit Aviation Holdings, Inc. (c)</b> | 16.224 | 81  | 0,00 |
|                                           |        | 309 | 0,01 |

## PARI

## (000S)

|                                              |          |        |      |
|----------------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |          |        |      |
| <b>Acrisure LLC</b>                          |          |        |      |
| 6,750 % fällig am 01.07.2032                 | \$ 2.025 | 2.055  | 0,07 |
| <b>ADT Security Corp.</b>                    |          |        |      |
| 4,125 % fällig am 01.08.2029                 | 2.000    | 1.934  | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2032 (h)             | 11.858   | 11.391 | 0,39 |
| <b>Advance Auto Parts, Inc.</b>              |          |        |      |
| 1,750 % fällig am 01.10.2027                 | 2.000    | 1.868  | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 15.03.2032 (h)             | 1.175    | 1.030  | 0,04 |
| 3,900 % fällig am 15.04.2030                 | 325      | 305    | 0,01 |
| <b>Advantage Sales &amp; Marketing, Inc.</b> |          |        |      |
| 6,500 % fällig am 15.11.2028 (h)             | 1.075    | 839    | 0,03 |
| <b>AES Corp.</b>                             |          |        |      |
| 6,950 % fällig am 15.07.2055                 | 3.500    | 3.423  | 0,12 |
| <b>Aethon United BR LP</b>                   |          |        |      |
| 7,500 % fällig am 01.10.2029                 | 2.950    | 3.097  | 0,11 |
| <b>Albertsons Cos., Inc.</b>                 |          |        |      |
| 3,500 % fällig am 15.03.2029 (h)             | 2.125    | 2.015  | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 15.01.2027                 | 2.100    | 2.089  | 0,07 |
| <b>Alliant Holdings Intermediate LLC</b>     |          |        |      |
| 4,250 % fällig am 15.10.2027                 | 2.000    | 1.965  | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 15.04.2028                 | 20.800   | 21.158 | 0,73 |
| <b>Allied Universal Holdco LLC</b>           |          |        |      |
| 6,875 % fällig am 15.06.2030                 | 1.000    | 1.015  | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 15.02.2031                 | 5.375    | 5.620  | 0,19 |

| BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>AMC Networks, Inc.</b>                                   |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.02.2029 (h)                            | \$ 7.075       | \$ 5.675                 | 0,20                              |
| 10,250 % fällig am 15.01.2029 (h)                           | 100            | 104                      | 0,00                              |
| <b>Amentum Holdings, Inc.</b>                               |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 01.08.2032 (h)                            | 1.575          | 1.622                    | 0,06                              |
| <b>Amer Sports Co.</b>                                      |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 16.02.2031 (h)                            | 2.275          | 2.370                    | 0,08                              |
| <b>American Airlines Pass-Through Trust</b>                 |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028                                | 250            | 244                      | 0,01                              |
| <b>American Axle &amp; Manufacturing, Inc.</b>              |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.10.2029 (h)                            | 525            | 481                      | 0,02                              |
| 6,500 % fällig am 01.04.2027                                | 450            | 450                      | 0,02                              |
| 6,875 % fällig am 01.07.2028                                | 350            | 350                      | 0,01                              |
| <b>American Builders &amp; Contractors Supply Co., Inc.</b> |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 (h)                            | 5.275          | 4.994                    | 0,17                              |
| 4,000 % fällig am 15.01.2028                                | 2.650          | 2.594                    | 0,09                              |
| <b>Amsted Industries, Inc.</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.05.2030                                | 3.000          | 2.888                    | 0,10                              |
| <b>AmWINS Group, Inc.</b>                                   |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 30.06.2029                                | 7.975          | 7.755                    | 0,27                              |
| 6,375 % fällig am 15.02.2029                                | 1.375          | 1.402                    | 0,05                              |
| <b>API Group DE, Inc.</b>                                   |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 15.07.2029 (h)                            | 3.830          | 3.654                    | 0,13                              |
| 4,750 % fällig am 15.10.2029                                | 3.000          | 2.956                    | 0,10                              |
| <b>Aramark Services, Inc.</b>                               |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028                                | 3.650          | 3.639                    | 0,13                              |
| <b>Arches Buyer, Inc.</b>                                   |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 01.06.2028                                | 50             | 48                       | 0,00                              |
| <b>Archrock Partners LP</b>                                 |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 01.04.2028                                | 2.975          | 2.987                    | 0,10                              |
| <b>Arcosa, Inc.</b>                                         |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 15.04.2029                                | 2.00           | 1.936                    | 0,07                              |
|                                                             | 0              |                          |                                   |
| <b>Aris Water Holdings LLC</b>                              |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 01.04.2030                                | 4.300          | 4.440                    | 0,15                              |
| <b>Ascent Resources Utica Holdings LLC</b>                  |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 30.06.2029                                | 3.560          | 3.568                    | 0,12                              |
| 6,625 % fällig am 15.10.2032                                | 7.350          | 7.485                    | 0,26                              |
| <b>Avantor Funding, Inc.</b>                                |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 01.11.2029 (h)                            | 2.000          | 1.895                    | 0,07                              |
| 4,625 % fällig am 15.07.2028 (h)                            | 1.175          | 1.155                    | 0,04                              |
| <b>Avis Budget Car Rental LLC</b>                           |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 01.03.2029                                | 1.375          | 1.326                    | 0,05                              |
| 5,750 % fällig am 15.07.2027                                | 282            | 280                      | 0,01                              |
| <b>Axon Enterprise, Inc.</b>                                |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 15.03.2030                                | 1.800          | 1.856                    | 0,06                              |
| 6,250 % fällig am 15.03.2033                                | 1.325          | 1.368                    | 0,05                              |
| <b>Ball Corp.</b>                                           |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 15.08.2030                                | 1.750          | 1.579                    | 0,05                              |
| 3,125 % fällig am 15.09.2031 (h)                            | 200            | 180                      | 0,01                              |
| <b>Beach Acquisition Bidco LLC</b>                          |                |                          |                                   |
| 10,000 % fällig am 15.07.2033 (a)                           | 5.025          | 5.221                    | 0,18                              |
| <b>Beacon Mobility Corp.</b>                                |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 01.08.2030 (a)                            | 3.050          | 3.117                    | 0,11                              |
| <b>Block, Inc.</b>                                          |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 01.06.2026                                | 3.275          | 3.209                    | 0,11                              |
| 3,500 % fällig am 01.06.2031                                | 8.950          | 8.216                    | 0,28                              |
| 6,500 % fällig am 15.05.2032                                | 3.375          | 3.484                    | 0,12                              |
| <b>Boost Newco Borrower LLC</b>                             |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 15.01.2031                                | 5.400          | 5.736                    | 0,20                              |
| <b>Boyne USA, Inc.</b>                                      |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 15.05.2029                                | 3.523          | 3.421                    | 0,12                              |
| <b>Bread Financial Holdings, Inc.</b>                       |                |                          |                                   |
| 8,375 % fällig am 15.06.2035                                | 875            | 882                      | 0,03                              |
| <b>Buckeye Partners LP</b>                                  |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 01.03.2028                                | 600            | 591                      | 0,02                              |
| <b>Builders FirstSource, Inc.</b>                           |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 01.02.2032                                | 7.325          | 6.791                    | 0,23                              |
| 5,000 % fällig am 01.03.2030                                | 3.207          | 3.151                    | 0,11                              |
| 6,750 % fällig am 15.05.2035                                | 3.975          | 4.098                    | 0,14                              |
| <b>Burford Capital Global Finance LLC</b>                   |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 15.04.2028                                | 2.000          | 1.983                    | 0,07                              |
| 9,250 % fällig am 01.07.2031                                | 7.565          | 7.971                    | 0,28                              |
| <b>BWX Technologies, Inc.</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 30.06.2028                                | 500            | 488                      | 0,02                              |
| 4,125 % fällig am 15.04.2029                                | 2.025          | 1.954                    | 0,07                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| CACI International, Inc.<br>6,375 % fällig am 15.06.2033              | \$ 2.025       | \$ 2.092                 | 0,07                              | Crescent Energy Finance LLC<br>7,375 % fällig am 15.01.2033                            | \$ 3.375       | \$ 3.229                 | 0,11                              | Frontier Communications Holdings LLC<br>6,000 % fällig am 15.01.2030            | \$ 2.100       | \$ 2.129                 | 0,07                              |
| Calpine Corp.<br>3,750 % fällig am 01.03.2031                         | 7.000          | 6.646                    | 0,23                              | 7,625 % fällig am 01.04.2032                                                           | 2.325          | 2.272                    | 0,08                              | 8,625 % fällig am 15.03.2031                                                    | 1.200          | 1.276                    | 0,04                              |
| 4,500 % fällig am 15.02.2028                                          | 4.450          | 4.417                    | 0,15                              | Crocs, Inc.<br>4,125 % fällig am 15.08.2031                                            | 200            | 180                      | 0,01                              | Gap, Inc.<br>3,625 % fällig am 01.10.2029                                       | 75             | 70                       | 0,00                              |
| 4,625 % fällig am 01.02.2029                                          | 725            | 717                      | 0,02                              | Crown Americas LLC<br>5,875 % fällig am 01.06.2033                                     | 4.300          | 4.332                    | 0,15                              | 3,875 % fällig am 01.10.2031                                                    | 10.625         | 9.550                    | 0,33                              |
| 5,000 % fällig am 01.02.2031                                          | 1.000          | 990                      | 0,03                              | DaVita, Inc.<br>3,750 % fällig am 15.02.2031                                           | 950            | 865                      | 0,03                              | Genesee & Wyoming, Inc.<br>6,250 % fällig am 15.04.2032                         | 5.900          | 6.028                    | 0,21                              |
| 5,125 % fällig am 15.03.2028                                          | 2.775          | 2.774                    | 0,10                              | 6,750 % fällig am 15.07.2033                                                           | 6.625          | 6.845                    | 0,24                              | Genesis Energy LP<br>7,875 % fällig am 15.05.2032                               | 2.975          | 3.096                    | 0,11                              |
| Capstone Borrower, Inc.<br>8,000 % fällig am 15.06.2030               | 800            | 833                      | 0,03                              | 6,875 % fällig am 01.09.2032 (h)                                                       | 350            | 363                      | 0,01                              | 8,000 % fällig am 15.05.2033                                                    | 1.600          | 1.674                    | 0,06                              |
| Carvana Co. (13,000 % PIK)<br>13,000 % fällig am 01.06.2030 (b)       | 1.875          | 1.973                    | 0,07                              | DCLI BidCo LLC<br>7,750 % fällig am 15.11.2029                                         | 4.625          | 4.689                    | 0,16                              | 8,875 % fällig am 15.04.2030                                                    | 600            | 638                      | 0,02                              |
| Carvana Co. (14,000 % PIK)<br>14,000 % fällig am 01.06.2031 (b)       | 725            | 835                      | 0,03                              | Delek Logistics Partners LP<br>7,375 % fällig am 30.06.2033                            | 475            | 473                      | 0,02                              | Global Atlantic Fin Co.<br>4,700 % fällig am 15.10.2051                         | 1.825          | 1.792                    | 0,06                              |
| CCO Holdings LLC<br>4,500 % fällig am 15.08.2030 (h)                  | 8.475          | 8.085                    | 0,28                              | Diebold Nixdorf, Inc.<br>7,750 % fällig am 31.03.2030                                  | 850            | 904                      | 0,03                              | Global Medical Response, Inc. (9,500 % PIK)<br>9,500 % fällig am 31.10.2028 (b) | 2.633          | 2.645                    | 0,09                              |
| 4,750 % fällig am 01.03.2030                                          | 6.800          | 6.593                    | 0,23                              | Directv Financing LLC<br>5,875 % fällig am 15.08.2027                                  | 7.900          | 7.879                    | 0,27                              | Global Partners LP<br>7,125 % fällig am 01.07.2033                              | 2.150          | 2.182                    | 0,08                              |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028                                          | 16.400         | 16.260                   | 0,56                              | 10,000 % fällig am 15.02.2031 (h)                                                      | 1.700          | 1.652                    | 0,06                              | Go Daddy Operating Co. LLC<br>3,500 % fällig am 01.03.2029                      | 2.000          | 1.892                    | 0,07                              |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029                                          | 9.650          | 9.621                    | 0,33                              | Discovery Communications LLC<br>3,625 % fällig am 15.05.2030                           | 300            | 265                      | 0,01                              | 5,250 % fällig am 01.12.2027                                                    | 6.350          | 6.350                    | 0,22                              |
| Celanese U.S. Holdings LLC<br>6,500 % fällig am 15.04.2030            | 5.525          | 5.659                    | 0,20                              | DISH Network Corp.<br>11,750 % fällig am 15.11.2027                                    | 1.175          | 1.212                    | 0,04                              | Goat Holdco LLC<br>6,750 % fällig am 01.02.2032                                 | 6.650          | 6.766                    | 0,23                              |
| 6,629 % fällig am 15.07.2032 (h)                                      | 2.550          | 2.675                    | 0,09                              | DT Midstream, Inc.<br>4,125 % fällig am 15.06.2029                                     | 2.000          | 1.933                    | 0,07                              | Goodyear Tire & Rubber Co.<br>5,000 % fällig am 31.05.2026                      | 430            | 431                      | 0,01                              |
| Central Parent LLC<br>8,000 % fällig am 15.06.2029                    | 1.750          | 1.449                    | 0,05                              | EchoStar Corp.<br>10,750 % fällig am 30.11.2029                                        | 4.825          | 4.974                    | 0,17                              | 5,000 % fällig am 15.07.2029 (h)                                                | 725            | 709                      | 0,02                              |
| Central Parent, Inc.<br>7,250 % fällig am 15.06.2029                  | 400            | 327                      | 0,01                              | EchoStar Corp. (6,750 % bar oder 6,750 % PIK)<br>6,750 % fällig am 30.11.2030 (b)      | 2.600          | 2.375                    | 0,08                              | 5,250 % fällig am 30.04.2031                                                    | 225            | 216                      | 0,01                              |
| Chobani LLC<br>7,625 % fällig am 01.07.2029                           | 2.100          | 2.191                    | 0,08                              | Ellician Holdings, Inc.<br>6,500 % fällig am 01.12.2029                                | 2.875          | 2.947                    | 0,10                              | Graham Packaging Co., Inc.<br>7,125 % fällig am 15.08.2028                      | 25             | 25                       | 0,00                              |
| Chord Energy Corp.<br>6,750 % fällig am 15.03.2033                    | 8.350          | 8.536                    | 0,29                              | Embeckta Corp.<br>5,000 % fällig am 15.02.2030                                         | 2.000          | 1.809                    | 0,06                              | Graphic Packaging International LLC<br>3,500 % fällig am 15.03.2028             | 2.000          | 1.918                    | 0,07                              |
| Churchill Downs, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.01.2028                 | 325            | 321                      | 0,01                              | Emerald Borrower LP<br>6,625 % fällig am 15.12.2030                                    | 4.607          | 4.715                    | 0,16                              | 3,500 % fällig am 01.03.2029                                                    | 3.100          | 2.926                    | 0,10                              |
| 5,750 % fällig am 01.04.2030                                          | 5.750          | 5.772                    | 0,20                              | Encore Capital Group, Inc.<br>8,500 % fällig am 15.05.2030                             | 8.700          | 9.339                    | 0,32                              | Gray Media, Inc.<br>10,500 % fällig am 15.07.2029 (h)                           | 2.025          | 2.177                    | 0,07                              |
| 6,750 % fällig am 01.05.2031                                          | 5.000          | 5.145                    | 0,18                              | 9,250 % fällig am 01.04.2029                                                           | 2.400          | 2.555                    | 0,09                              | Greystar Real Estate Partners LLC<br>7,750 % fällig am 01.09.2030               | 1.225          | 1.301                    | 0,04                              |
| Civitas Resources, Inc.<br>8,625 % fällig am 01.11.2030               | 1.925          | 1.956                    | 0,07                              | Endo Finance Holdings, Inc.<br>8,500 % fällig am 15.04.2031 (h)                        | 1.300          | 1.378                    | 0,05                              | Griffon Corp.<br>5,750 % fällig am 01.03.2028                                   | 5.525          | 5.528                    | 0,19                              |
| Clarivate Science Holdings Corp.<br>3,875 % fällig am 01.07.2028      | 5.750          | 5.516                    | 0,19                              | EQT Corp.<br>4,500 % fällig am 15.01.2029                                              | 1.482          | 1.465                    | 0,05                              | Gulfport Energy Operating Corp.<br>6,750 % fällig am 01.09.2029                 | 825            | 847                      | 0,03                              |
| 4,875 % fällig am 01.07.2029 (h)                                      | 3.950          | 3.723                    | 0,13                              | 6,500 % fällig am 01.07.2027                                                           | 1.900          | 1.943                    | 0,07                              | GYP Holdings Corp.<br>4,625 % fällig am 01.05.2029                              | 2.425          | 2.432                    | 0,08                              |
| Clearway Energy Operating LLC<br>4,750 % fällig am 15.03.2028         | 525            | 519                      | 0,02                              | 7,500 % fällig am 01.06.2030                                                           | 5.850          | 6.432                    | 0,22                              | HealthEquity, Inc.<br>4,500 % fällig am 01.10.2029                              | 4.000          | 3.894                    | 0,13                              |
| Cleveland-Cliffs, Inc.<br>5,875 % fällig am 01.06.2027                | 1.025          | 1.025                    | 0,04                              | Excelerate Energy LP<br>8,000 % fällig am 15.05.2030 (h)                               | 1.575          | 1.662                    | 0,06                              | Helios Software Holdings, Inc.<br>4,625 % fällig am 01.05.2028                  | 800            | 758                      | 0,03                              |
| 6,875 % fällig am 01.11.2029                                          | 1.900          | 1.872                    | 0,06                              | Fertitta Entertainment LLC<br>4,625 % fällig am 15.01.2029                             | 2.000          | 1.917                    | 0,07                              | 8,750 % fällig am 01.05.2029                                                    | 950            | 978                      | 0,03                              |
| 7,000 % fällig am 15.03.2032 (h)                                      | 2.275          | 2.147                    | 0,07                              | 6,750 % fällig am 15.01.2030                                                           | 150            | 139                      | 0,00                              | Herc Holdings, Inc.<br>7,000 % fällig am 15.06.2030                             | 4.250          | 4.441                    | 0,15                              |
| Cloud Software Group, Inc.<br>6,500 % fällig am 31.03.2029            | 7.425          | 7.499                    | 0,26                              | First Student Bidco, Inc.<br>4,000 % fällig am 31.07.2029                              | 5.850          | 5.503                    | 0,19                              | 7,250 % fällig am 15.06.2033                                                    | 4.250          | 4.456                    | 0,15                              |
| 8,250 % fällig am 30.06.2032                                          | 3.400          | 3.622                    | 0,12                              | Focus Financial Partners LLC<br>6,750 % fällig am 15.09.2031                           | 450            | 460                      | 0,02                              | Hess Midstream Operations LP<br>5,875 % fällig am 01.03.2028                    | 2.500          | 2.539                    | 0,09                              |
| Clue Opco LLC<br>9,500 % fällig am 15.10.2031                         | 3.275          | 3.475                    | 0,12                              | Ford Motor Credit Co. LLC<br>2,900 % fällig am 16.02.2028                              | 200            | 188                      | 0,01                              | Hilcorp Energy LP<br>6,250 % fällig am 01.11.2028                               | 1.725          | 1.730                    | 0,06                              |
| Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.<br>6,750 % fällig am 15.04.2032 | 10.925         | 11.219                   | 0,39                              | 3,815 % fällig am 02.11.2027                                                           | 150            | 145                      | 0,01                              | 6,250 % fällig am 15.04.2032                                                    | 1.000          | 956                      | 0,03                              |
| 6,875 % fällig am 15.01.2030                                          | 3.050          | 3.122                    | 0,11                              | 4,125 % fällig am 17.08.2027                                                           | 2.050          | 2.004                    | 0,07                              | Hillenbrand, Inc.<br>5,000 % fällig am 15.09.2026                               | 2.000          | 2.001                    | 0,07                              |
| Cogent Communications Group LLC<br>6,500 % fällig am 01.07.2032       | 6.875          | 6.778                    | 0,23                              | 4,271 % fällig am 09.01.2027                                                           | 2.275          | 2.243                    | 0,08                              | Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>3,750 % fällig am 01.05.2029             | 509            | 488                      | 0,02                              |
| Coinbase Global, Inc.<br>3,375 % fällig am 01.10.2028                 | 3.575          | 3.354                    | 0,12                              | 5,918 % fällig am 20.03.2028                                                           | 450            | 455                      | 0,02                              | 4,000 % fällig am 01.05.2031                                                    | 3.000          | 2.823                    | 0,10                              |
| 3,625 % fällig am 01.10.2031                                          | 1.250          | 1.114                    | 0,04                              | 6,798 % fällig am 07.11.2028                                                           | 525            | 544                      | 0,02                              | Hilton Grand Vacations Borrower LLC<br>5,000 % fällig am 01.06.2029             | 3.300          | 3.176                    | 0,11                              |
| Commercial Metals Co.<br>4,125 % fällig am 15.01.2030                 | 2.000          | 1.922                    | 0,07                              | 6,800 % fällig am 12.05.2028                                                           | 525            | 543                      | 0,02                              | Hologic, Inc.<br>3,250 % fällig am 15.02.2029                                   | 3.600          | 3.433                    | 0,12                              |
| CommScope LLC<br>4,750 % fällig am 01.09.2029 (h)                     | 1.950          | 1.906                    | 0,07                              | 7,350 % fällig am 04.11.2027                                                           | 125            | 130                      | 0,00                              | 4,625 % fällig am 01.02.2028                                                    | 4.200          | 4.154                    | 0,14                              |
| Community Health Systems, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.02.2031        | 6.025          | 5.156                    | 0,18                              | Fortitude Group Holdings LLC<br>6,250 % fällig am 01.04.2030                           | 200            | 206                      | 0,01                              | Howard Midstream Energy Partners LLC<br>7,375 % fällig am 15.07.2032            | 5.175          | 5.446                    | 0,19                              |
| 5,250 % fällig am 15.05.2030                                          | 3.050          | 2.707                    | 0,09                              | Fortress Intermediate, Inc.<br>7,500 % fällig am 01.06.2031 (h)                        | 5.200          | 5.454                    | 0,19                              | 8,875 % fällig am 15.07.2028                                                    | 4.275          | 4.491                    | 0,15                              |
| 5,625 % fällig am 15.03.2027                                          | 10.845         | 10.689                   | 0,37                              | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC<br>5,875 % fällig am 15.04.2033 | 1.775          | 1.754                    | 0,06                              | HUB International Ltd.<br>7,250 % fällig am 15.06.2030                          | 4.400          | 4.601                    | 0,16                              |
| 6,000 % fällig am 15.01.2029                                          | 1.800          | 1.733                    | 0,06                              | Freedom Mortgage Corp.<br>6,625 % fällig am 15.01.2027                                 | 4.200          | 4.210                    | 0,15                              | Hudson Pacific Properties LP<br>3,250 % fällig am 15.01.2030                    | 1.000          | 819                      | 0,03                              |
| 10,875 % fällig am 15.01.2032                                         | 5.125          | 5.438                    | 0,19                              | 12,000 % fällig am 01.10.2028                                                          | 4.351          | 4.682                    | 0,16                              | Icahn Enterprises LP<br>5,250 % fällig am 15.05.2027                            | 1.592          | 1.544                    | 0,05                              |
| CoreLogic, Inc.<br>4,500 % fällig am 01.05.2028                       | 2.247          | 2.145                    | 0,07                              | 12,250 % fällig am 01.10.2030                                                          | 6.325          | 7.019                    | 0,24                              | 6,250 % fällig am 15.05.2026                                                    | 1.560          | 1.550                    | 0,05                              |
| CoreWeave, Inc.<br>9,250 % fällig am 01.06.2030                       | 775            | 793                      | 0,03                              | Freedom Mortgage Holdings LLC<br>9,250 % fällig am 01.02.2029                          | 3.231          | 3.358                    | 0,12                              | 10,000 % fällig am 15.11.2029                                                   | 1.750          | 1.735                    | 0,06                              |
| CQP Holdco LP<br>5,500 % fällig am 15.06.2031                         | 11.675         | 11.542                   | 0,40                              |                                                                                        |                |                          |                                   |                                                                                 |                |                          |                                   |
| Credit Acceptance Corp.<br>6,625 % fällig am 15.03.2030               | 700            | 710                      | 0,02                              |                                                                                        |                |                          |                                   |                                                                                 |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 15.12.2028                                          | 1.700          | 1.802                    | 0,06                              |                                                                                        |                |                          |                                   |                                                                                 |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Imola Merger Corp.</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Mauser Packaging Solutions Holding Co.</b>          |                |                          |                                   | <b>4,250 % fällig am 01.10.2028 \$</b>   | 1.475       | \$ 1.404                 | 0,05                              |
| 4,750 % fällig am 15.05.2029                               | \$ 2.575       | \$ 2.488                 | 0,09                              | 7,875 % fällig am 15.04.2027                           | \$ 5.400       | \$ 5.495                 | 0,19                              | 5,375 % fällig am 01.10.2029 (h) €       | 475         | 514                      | 0,02                              |
| <b>Ingevity Corp.</b>                                      |                |                          |                                   | <b>McGraw-Hill Education, Inc.</b>                     |                |                          |                                   | <b>ON Semiconductor Corp.</b>            |             |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 01.11.2028 (h)                           | 13.725         | 13.099                   | 0,45                              | 5,750 % fällig am 01.08.2028                           | 2.200          | 2.215                    | 0,08                              | 3,875 % fällig am 01.09.2028 \$          | 5.100       | 4.938                    | 0,17                              |
| <b>Installed Building Products, Inc.</b>                   |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 01.09.2031                           | 3.650          | 3.810                    | 0,13                              | <b>OneMain Finance Corp.</b>             |             |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 01.02.2028                               | 2.000          | 2.002                    | 0,07                              | <b>Medline Borrower LP</b>                             |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 15.01.2027             | 15.275      | 14.964                   | 0,52                              |
| <b>Insulet Corp.</b>                                       |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 01.04.2029                           | 16.025         | 15.383                   | 0,53                              | 6,625 % fällig am 15.01.2028             | 13.700      | 14.157                   | 0,49                              |
| 6,500 % fällig am 01.04.2033                               | 800            | 835                      | 0,03                              | 5,250 % fällig am 01.10.2029 (h)                       | 2.050          | 2.036                    | 0,07                              | 9,000 % fällig am 15.01.2029 (h)         | 3.325       | 3.489                    | 0,12                              |
| <b>IQVIA, Inc.</b>                                         |                |                          |                                   | <b>Merlin Entertainments Group U.S. Holdings, Inc.</b> |                |                          |                                   | <b>Open Text Holdings, Inc.</b>          |             |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 15.01.2028                               | € 5.000        | 5.724                    | 0,20                              | 7,375 % fällig am 15.02.2031                           | 4.225          | 3.778                    | 0,13                              | 4,125 % fällig am 15.02.2030             | 6.185       | 5.851                    | 0,20                              |
| 2,250 % fällig am 15.03.2029                               | 3.000          | 3.378                    | 0,12                              | <b>MGM Resorts International</b>                       |                |                          |                                   | <b>Organon &amp; Co.</b>                 |             |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 15.06.2028                               | 3.500          | 4.061                    | 0,14                              | 6,125 % fällig am 15.09.2029 (h)                       | 1.300          | 1.323                    | 0,05                              | 2,875 % fällig am 30.04.2028 €           | 11.650      | 13.360                   | 0,46                              |
| 6,250 % fällig am 01.06.2032                               | \$ 4.125       | 4.238                    | 0,15                              | <b>Midcap Financial Issuer Trust</b>                   |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 30.04.2031 (h) \$      | 3.000       | 2.606                    | 0,09                              |
| <b>Iron Mountain Information Management Services, Inc.</b> |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.05.2028                           | 700            | 694                      | 0,02                              | 6,750 % fällig am 15.05.2034             | 5.175       | 4.976                    | 0,17                              |
| 5,000 % fällig am 15.07.2032                               | 1.700          | 1.633                    | 0,06                              | <b>Midwest Gaming Borrower LLC</b>                     |                |                          |                                   | 7,875 % fällig am 15.05.2034 (h)         | 1.450       | 1.311                    | 0,05                              |
| <b>Iron Mountain, Inc.</b>                                 |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 01.05.2029                           | 6.015          | 5.798                    | 0,20                              | <b>Oxford Finance LLC</b>                |             |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.02.2031                               | 2.075          | 1.979                    | 0,07                              | <b>Miter Brands Acquisition Holdco, Inc.</b>           |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 01.02.2027             | 5.300       | 5.333                    | 0,18                              |
| 4,875 % fällig am 15.09.2027                               | 2.800          | 2.786                    | 0,10                              | 6,750 % fällig am 01.04.2032 (h)                       | 2.750          | 2.822                    | 0,10                              | <b>Panther Escrow Issuer LLC</b>         |             |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 15.07.2030                               | 800            | 790                      | 0,03                              | <b>Molina Healthcare, Inc.</b>                         |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 01.06.2031             | 10.000      | 10.394                   | 0,36                              |
| 6,250 % fällig am 15.01.2033                               | 3.200          | 3.292                    | 0,11                              | 3,875 % fällig am 15.05.2032                           | 225            | 205                      | 0,01                              | <b>Park Intermediate Holdings LLC</b>    |             |                          |                                   |
| <b>IWG U.S. Finance LLC</b>                                |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.06.2028                           | 2.625          | 2.568                    | 0,09                              | 4,875 % fällig am 15.05.2029             | 2.250       | 2.181                    | 0,08                              |
| 6,500 % fällig am 28.06.2030                               | € 2.675        | 3.375                    | 0,12                              | 6,250 % fällig am 15.01.2033                           | 2.075          | 2.113                    | 0,07                              | <b>PBF Holding Co. LLC</b>               |             |                          |                                   |
| <b>Jane Street Group</b>                                   |                |                          |                                   | <b>MPT Operating Partnership LP</b>                    |                |                          |                                   | 7,875 % fällig am 15.09.2030             | 750         | 674                      | 0,02                              |
| 6,750 % fällig am 01.05.2033                               | \$ 3.700       | 3.807                    | 0,13                              | 8,500 % fällig am 15.02.2032                           | 2.525          | 2.645                    | 0,09                              | <b>Pebblebrook Hotel LP</b>              |             |                          |                                   |
| 7,125 % fällig am 30.04.2031                               | 13.700         | 14.424                   | 0,50                              | <b>Murphy Oil USA, Inc.</b>                            |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 15.10.2029             | 2.875       | 2.892                    | 0,10                              |
| <b>Jefferson Capital Holdings LLC</b>                      |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.02.2031                           | 1.850          | 1.709                    | 0,06                              | <b>PennyMac Financial Services, Inc.</b> |             |                          |                                   |
| 9,500 % fällig am 15.02.2029                               | 2.100          | 2.223                    | 0,08                              | <b>Nationstar Mortgage Holdings, Inc.</b>              |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.02.2029             | 9.000       | 8.661                    | 0,30                              |
| <b>Kaiser Aluminum Corp.</b>                               |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.08.2028                           | 5.000          | 4.971                    | 0,17                              | 5,750 % fällig am 15.09.2031             | 2.500       | 2.453                    | 0,08                              |
| 4,625 % fällig am 01.03.2028                               | 1.725          | 1.689                    | 0,06                              | 6,500 % fällig am 01.08.2029                           | 5.700          | 5.826                    | 0,20                              | 6,875 % fällig am 15.05.2032             | 2.500       | 2.558                    | 0,09                              |
| <b>KBR, Inc.</b>                                           |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 01.02.2032                           | 4.275          | 4.443                    | 0,15                              | 7,125 % fällig am 15.11.2030             | 4.150       | 4.304                    | 0,15                              |
| 4,750 % fällig am 30.09.2028                               | 500            | 481                      | 0,02                              | <b>Navient Corp.</b>                                   |                |                          |                                   | <b>Performance Food Group, Inc.</b>      |             |                          |                                   |
| <b>Kinetik Holdings LP</b>                                 |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.03.2027 (h)                       | 875            | 872                      | 0,03                              | 4,250 % fällig am 01.08.2029             | 3.461       | 3.341                    | 0,12                              |
| 6,625 % fällig am 15.12.2028                               | 1.200          | 1.228                    | 0,04                              | 5,500 % fällig am 15.03.2029                           | 2.775          | 2.720                    | 0,09                              | <b>Permian Resources Operating LLC</b>   |             |                          |                                   |
| <b>Kodiak Gas Services LLC</b>                             |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.06.2026                           | 950            | 962                      | 0,03                              | 5,875 % fällig am 01.07.2029             | 2.525       | 2.536                    | 0,09                              |
| 7,250 % fällig am 15.02.2029                               | 1.125          | 1.164                    | 0,04                              | <b>NCR Atleos Corp.</b>                                |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.02.2033             | 9.175       | 9.266                    | 0,32                              |
| <b>Korn Ferry</b>                                          |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 01.04.2029                           | 2.400          | 2.631                    | 0,09                              | 7,000 % fällig am 15.01.2032             | 875         | 908                      | 0,03                              |
| 4,625 % fällig am 15.12.2027                               | 2.000          | 1.992                    | 0,07                              | <b>NCR Voyix Corp.</b>                                 |                |                          |                                   | <b>PetSmart, Inc.</b>                    |             |                          |                                   |
| <b>Kraken Oil &amp; Gas Partners LLC</b>                   |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.10.2028                           | 8.439          | 8.360                    | 0,29                              | 4,750 % fällig am 15.02.2028             | 875         | 854                      | 0,03                              |
| 7,625 % fällig am 15.08.2029                               | 7.275          | 7.153                    | 0,25                              | 5,125 % fällig am 15.04.2029                           | 2.000          | 1.972                    | 0,07                              | <b>PG&amp;E Corp.</b>                    |             |                          |                                   |
| <b>Kronos International, Inc.</b>                          |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 01.10.2030                           | 500            | 484                      | 0,02                              | 7,375 % fällig am 15.03.2055             | 2.050       | 1.947                    | 0,07                              |
| 3,750 % fällig am 15.09.2025                               | € 1.807        | 2.121                    | 0,07                              | <b>Neptune Bidco U.S., Inc.</b>                        |                |                          |                                   | <b>Post Holdings, Inc.</b>               |             |                          |                                   |
| <b>Ladder Capital Finance Holdings LLLP</b>                |                |                          |                                   | 9,290 % fällig am 15.04.2029 (h)                       | 2.825          | 2.753                    | 0,09                              | 4,500 % fällig am 15.09.2031             | 7.271       | 6.755                    | 0,23                              |
| 4,750 % fällig am 15.06.2029 (h) \$                        | 5.925          | 5.773                    | 0,20                              | <b>Newell Brands, Inc.</b>                             |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.04.2030             | 5.000       | 4.811                    | 0,17                              |
| <b>Lamb Weston Holdings, Inc.</b>                          |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 01.06.2028                           | 3.025          | 3.184                    | 0,11                              | 5,500 % fällig am 15.12.2029             | 10.900      | 10.860                   | 0,37                              |
| 4,125 % fällig am 31.01.2030                               | 2.000          | 1.909                    | 0,07                              | <b>Newfold Digital Holdings Group, Inc.</b>            |                |                          |                                   | <b>PRA Group, Inc.</b>                   |             |                          |                                   |
| <b>Level 3 Financing, Inc.</b>                             |                |                          |                                   | 11,750 % fällig am 15.10.2028                          | 8.775          | 6.625                    | 0,23                              | 8,875 % fällig am 31.01.2030 (h)         | 1.875       | 1.935                    | 0,07                              |
| 4,500 % fällig am 01.04.2030                               | 2.075          | 1.888                    | 0,06                              | <b>Newmark Group, Inc.</b>                             |                |                          |                                   | <b>Prime Healthcare Services, Inc.</b>   |             |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 30.06.2033                               | 3.650          | 3.717                    | 0,13                              | 7,500 % fällig am 12.01.2029                           | 11.900         | 12.598                   | 0,43                              | 9,375 % fällig am 01.09.2029             | 7.650       | 7.598                    | 0,26                              |
| 10,750 % fällig am 15.12.2030                              | 2.150          | 2.443                    | 0,08                              | <b>Nexstar Media, Inc.</b>                             |                |                          |                                   | <b>Primo Water Holdings, Inc.</b>        |             |                          |                                   |
| 11,000 % fällig am 15.11.2029                              | 3.387          | 3.889                    | 0,13                              | 4,750 % fällig am 01.11.2028 (h)                       | 1.650          | 1.608                    | 0,06                              | 3,875 % fällig am 31.10.2028 €           | 2.000       | 2.345                    | 0,08                              |
| <b>LFS Topco LLC</b>                                       |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.07.2027                           | 3.550          | 3.544                    | 0,12                              | 4,375 % fällig am 30.04.2029 \$          | 3.450       | 3.348                    | 0,12                              |
| 5,875 % fällig am 15.10.2026                               | 2.500          | 2.501                    | 0,09                              | <b>NFE Financing LLC</b>                               |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.04.2029             | 1.675       | 1.688                    | 0,06                              |
| <b>LifePoint Health, Inc.</b>                              |                |                          |                                   | 12,000 % fällig am 15.11.2029                          | 1.931          | 878                      | 0,03                              | <b>PTC, Inc.</b>                         |             |                          |                                   |
| 8,375 % fällig am 15.02.2032                               | 4.450          | 4.745                    | 0,16                              | <b>NGL Energy Operating LLC</b>                        |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.02.2028             | 1.250       | 1.216                    | 0,04                              |
| 11,000 % fällig am 15.10.2030                              | 6.096          | 6.733                    | 0,23                              | 8,125 % fällig am 15.02.2029                           | 700            | 708                      | 0,02                              | <b>Quikrete Holdings, Inc.</b>           |             |                          |                                   |
| <b>Light &amp; Wonder International, Inc.</b>              |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am 15.02.2032                           | 925            | 929                      | 0,03                              | 6,375 % fällig am 01.03.2032             | 11.675      | 12.013                   | 0,41                              |
| 7,500 % fällig am 01.09.2031                               | 925            | 969                      | 0,03                              | <b>Nissan Motor Acceptance Co. LLC</b>                 |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 01.03.2033             | 1.325       | 1.368                    | 0,05                              |
| <b>Lightning Power LLC</b>                                 |                |                          |                                   | 1,850 % fällig am 16.09.2026                           | 375            | 358                      | 0,01                              | <b>QXO Building Products, Inc.</b>       |             |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 15.08.2032 (h)                           | 2.950          | 3.107                    | 0,11                              | 5,300 % fällig am 13.09.2027                           | 325            | 321                      | 0,01                              | 6,750 % fällig am 30.04.2032 (h)         | 6.200       | 6.403                    | 0,22                              |
| <b>Lithia Motors, Inc.</b>                                 |                |                          |                                   | 6,950 % fällig am 15.09.2026                           | 1.550          | 1.569                    | 0,05                              | <b>Radiology Partners, Inc.</b>          |             |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 01.06.2029 (h)                           | 250            | 239                      | 0,01                              | 7,050 % fällig am 15.09.2028                           | 2.400          | 2.454                    | 0,08                              | 8,500 % fällig am 15.07.2032             | 1.650       | 1.656                    | 0,06                              |
| 4,375 % fällig am 15.01.2031 (h)                           | 750            | 714                      | 0,02                              | <b>Noble Finance LLC</b>                               |                |                          |                                   | <b>Raising Cane's Restaurants LLC</b>    |             |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.12.2027                               | 575            | 571                      | 0,02                              | 8,000 % fällig am 15.04.2030                           | 10.550         | 10.751                   | 0,37                              | 9,375 % fällig am 01.05.2029             | 2.275       | 2.404                    | 0,08                              |
| <b>Live Nation Entertainment, Inc.</b>                     |                |                          |                                   | <b>Novellis Corp.</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Rand Parent LLC</b>                   |             |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 15.01.2028                               | 225            | 218                      | 0,01                              | 3,875 % fällig am 15.08.2031                           | 1.400          | 1.259                    | 0,04                              | 8,500 % fällig am 15.02.2030             | 10.400      | 10.452                   | 0,36                              |
| <b>Madison IAQ LLC</b>                                     |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 30.01.2030 (h)                       | 4.275          | 4.099                    | 0,14                              | <b>Range Resources Corp.</b>             |             |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 30.06.2028                               | 3.225          | 3.135                    | 0,11                              | 6,875 % fällig am 30.01.2030                           | 1.650          | 1.707                    | 0,06                              | 4,750 % fällig am 15.02.2030             | 2.000       | 1.947                    | 0,07                              |
| <b>Marriott Ownership Resorts, Inc.</b>                    |                |                          |                                   | <b>NRG Energy, Inc.</b>                                |                |                          |                                   | <b>Raven Acquisition Holdings LLC</b>    |             |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.06.2029                               | 100            | 96                       | 0,00                              | 3,375 % fällig am 15.02.2029                           | 2.675          | 2.524                    | 0,09                              | 6,875 % fällig am 15.11.2031             | 8.900       | 8.923                    | 0,31                              |
| <b>Matador Resources Co.</b>                               |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 15.02.2031                           | 3.150          | 2.901                    | 0,10                              | <b>RFNA LP</b>                           |             |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 15.04.2033                               | 9.675          | 9.628                    | 0,33                              | 5,750 % fällig am 15.07.2029                           | 5.900          | 5.937                    | 0,20                              | 7,875 % fällig am 15.02.2030             | 1.150       | 1.178                    | 0,04                              |
| 6,500 % fällig am 15.04.2032                               | 3.125          | 3.129                    | 0,11                              | 6,000 % fällig am 01.02.2033                           | 725            | 733                      | 0,03                              | <b>RHP Hotel Properties LP</b>           |             |                          |                                   |
| <b>Match Group Holdings LLC</b>                            |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.11.2034                           | 500            | 510                      | 0,02                              | 4,500 % fällig am 15.02.2029             | 2.000       | 1.956                    | 0,07                              |
| 4,625 % fällig am 01.06.2028                               | 3.904          | 3.812                    | 0,13                              | <b>NuStar Logistics LP</b>                             |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.04.2032             | 425         | 437                      | 0,01                              |
| 5,000 % fällig am 15.12.2027                               | 1.625          | 1.617                    | 0,06                              | 6,375 % fällig am 01.10.2030 (h)                       | 3.350          | 3.474                    | 0,12                              | 6,500 % fällig am 15.06.2033             | 900         | 926                      | 0,03                              |
|                                                            |                |                          |                                   | <b>Olympus Water U.S. Holding Corp.</b>                |                |                          |                                   | <b>Ritchie Bros Holdings, Inc.</b>       |             |                          |                                   |
|                                                            |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 01.10.2028                           | € 2.000        | 2.305                    | 0,08                              | 7,750 % fällig am 15.03.2031             | 2.500       | 2.631                    | 0,09                              |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                             | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                       | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                          | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| RLJ Lodging Trust LP                     |             |                          |                                   | Stonex Escrow Issuer LLC           |             |                          |                                   | Vertiv Group Corp.                    |             |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 01.07.2026             | \$ 475      | \$ 471                   | 0,02                              | 6,875 % fällig am 15.07.2032 (a)   | \$ 1.800    | \$ 1.820                 | 0,06                              | 4,125 % fällig am 15.11.2028          | \$ 3.000    | \$ 2.928                 | 0,10                              |
| 4,000 % fällig am 15.09.2029             | 5.000       | 4.669                    | 0,16                              | Sunoco LP                          |             |                          |                                   | VF Corp.                              |             |                          |                                   |
| ROBLOX Corp.                             |             |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.05.2029       | 1.150       | 1.117                    | 0,04                              | 0,250 % fällig am 25.02.2028          | € 10.175    | 10.464                   | 0,36                              |
| 3,875 % fällig am 01.05.2030             | 2.000       | 1.889                    | 0,07                              | 7,000 % fällig am 01.05.2029       | 2.850       | 2.970                    | 0,10                              | 2,800 % fällig am 23.04.2027          | \$ 2.000    | 1.912                    | 0,07                              |
| Rocket Cos., Inc.                        |             |                          |                                   | Surgery Center Holdings, Inc.      |             |                          |                                   | 4,125 % fällig am 07.03.2026          | € 2.000     | 2.340                    | 0,08                              |
| 6,125 % fällig am 01.08.2030             | 6.000       | 6.118                    | 0,21                              | 7,250 % fällig am 15.04.2032 (h)   | 3.000       | 3.061                    | 0,11                              | VFH Parent LLC                        |             |                          |                                   |
| Rocket Mortgage LLC                      |             |                          |                                   | Tallgrass Energy Partners LP       |             |                          |                                   | 7,500 % fällig am 15.06.2031          | \$ 2.425    | 2.547                    | 0,09                              |
| 3,625 % fällig am 01.03.2029             | 1.750       | 1.664                    | 0,06                              | 5,500 % fällig am 15.01.2028       | 1.175       | 1.169                    | 0,04                              | Victra Holdings LLC                   |             |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 01.03.2031 (h)         | 1.000       | 928                      | 0,03                              | 6,000 % fällig am 01.09.2031       | 1.250       | 1.221                    | 0,04                              | 8,750 % fällig am 15.09.2029          | 425         | 446                      | 0,02                              |
| Rockies Express Pipeline LLC             |             |                          |                                   | TEGNA, Inc.                        |             |                          |                                   | Vistra Operations Co. LLC             |             |                          |                                   |
| 4,950 % fällig am 15.07.2029             | 1.275       | 1.253                    | 0,04                              | 4,625 % fällig am 15.03.2028       | 4.800       | 4.683                    | 0,16                              | 4,375 % fällig am 01.05.2029          | 4.250       | 4.145                    | 0,14                              |
| 6,750 % fällig am 15.03.2033             | 2.025       | 2.116                    | 0,07                              | 5,000 % fällig am 15.09.2029       | 3.100       | 2.963                    | 0,10                              | 6,875 % fällig am 15.04.2032          | 6.550       | 6.852                    | 0,24                              |
| RR Donnelley & Sons Co.                  |             |                          |                                   | Teleflex, Inc.                     |             |                          |                                   | 7,750 % fällig am 15.10.2031          | 1.200       | 1.276                    | 0,04                              |
| 9,500 % fällig am 01.08.2029             | 225         | 225                      | 0,01                              | 4,250 % fällig am 01.06.2028 (h)   | 2.000       | 1.955                    | 0,07                              | VM Consolidated, Inc.                 |             |                          |                                   |
| Sabre GLBL, Inc.                         |             |                          |                                   | Tenet Healthcare Corp.             |             |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.04.2029          | 2.000       | 1.965                    | 0,07                              |
| 8,625 % fällig am 01.06.2027             | 117         | 120                      | 0,00                              | 4,375 % fällig am 15.01.2030       | 6.100       | 5.910                    | 0,20                              | Walgreen Co.                          |             |                          |                                   |
| 10,750 % fällig am 15.11.2029            | 375         | 387                      | 0,01                              | TerraForm Power Operating LLC      |             |                          |                                   | 4,400 % fällig am 15.09.2042          | 380         | 351                      | 0,01                              |
| SBA Communications Corp.                 |             |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.01.2030       | 1.500       | 1.437                    | 0,05                              | Walgreens Boots Alliance, Inc.        |             |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 01.02.2029 (h)         | 3.675       | 3.474                    | 0,12                              | 5,000 % fällig am 31.01.2028       | 4.500       | 4.457                    | 0,15                              | 2,125 % fällig am 20.11.2026          | € 2.000     | 2.316                    | 0,08                              |
| Science Applications International Corp. |             |                          |                                   | Tidewater, Inc.                    |             |                          |                                   | 4,100 % fällig am 15.04.2050          | \$ 575      | 500                      | 0,02                              |
| 4,875 % fällig am 01.04.2028             | 2.000       | 1.970                    | 0,07                              | 9,125 % fällig am 15.07.2030 (a)   | 2.350       | 2.420                    | 0,08                              | 4,650 % fällig am 01.06.2046          | 275         | 257                      | 0,01                              |
| SCIH Salt Holdings, Inc.                 |             |                          |                                   | TK Elevator U.S. Newco, Inc.       |             |                          |                                   | 4,800 % fällig am 18.11.2044          | 200         | 191                      | 0,01                              |
| 4,875 % fällig am 01.05.2028             | 3.875       | 3.778                    | 0,13                              | 5,250 % fällig am 15.07.2027 (h)   | 3.525       | 3.525                    | 0,12                              | 8,125 % fällig am 15.08.2029          | 7.000       | 7.428                    | 0,26                              |
| SCIL LLC                                 |             |                          |                                   | TopBuild Corp.                     |             |                          |                                   | Wand NewCo, Inc.                      |             |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 01.11.2026             | 2.000       | 1.988                    | 0,07                              | 3,625 % fällig am 15.03.2029       | 6.900       | 6.533                    | 0,23                              | 7,625 % fällig am 30.01.2032          | 2.100       | 2.209                    | 0,08                              |
| 9,500 % fällig am 15.07.2028             | € 2.175     | 2.694                    | 0,09                              | 4,125 % fällig am 15.02.2032       | 8.925       | 8.282                    | 0,29                              | Warnmedia Holdings, Inc.              |             |                          |                                   |
| Scripps Escrow, Inc.                     |             |                          |                                   | TransDigm, Inc.                    |             |                          |                                   | 3,755 % fällig am 15.03.2027          | 550         | 539                      | 0,02                              |
| 3,875 % fällig am 15.01.2029 (h)         | \$ 1.950    | 1.699                    | 0,06                              | 6,000 % fällig am 15.01.2033       | 200         | 201                      | 0,01                              | 4,279 % fällig am 15.03.2032          | 1.200       | 1.015                    | 0,03                              |
| Sensata Technologies, Inc.               |             |                          |                                   | TriNet Group, Inc.                 |             |                          |                                   | 5,050 % fällig am 15.03.2042          | 900         | 611                      | 0,02                              |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031             | 2.100       | 1.916                    | 0,07                              | 3,500 % fällig am 01.03.2029       | 1.506       | 1.416                    | 0,05                              | Waste Pro USA, Inc.                   |             |                          |                                   |
| Service Corp. International              |             |                          |                                   | Twilio, Inc.                       |             |                          |                                   | 7,000 % fällig am 01.02.2033          | 2.175       | 2.263                    | 0,08                              |
| 3,375 % fällig am 15.08.2030             | 2.625       | 2.415                    | 0,08                              | 3,625 % fällig am 15.03.2029       | 800         | 762                      | 0,03                              | Wayfair LLC                           |             |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.12.2027             | 2.526       | 2.512                    | 0,09                              | U.S. Acute Care Solutions LLC      |             |                          |                                   | 7,250 % fällig am 31.10.2029          | 2.500       | 2.507                    | 0,09                              |
| Shift4 Payments LLC                      |             |                          |                                   | 9,750 % fällig am 15.05.2029       | 1.525       | 1.575                    | 0,05                              | 7,750 % fällig am 15.09.2030          | 1.850       | 1.866                    | 0,06                              |
| 5,500 % fällig am 15.05.2033             | € 1.225     | 1.491                    | 0,05                              | U.S. Foods, Inc.                   |             |                          |                                   | Western Digital Corp.                 |             |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 15.08.2032             | \$ 1.575    | 1.637                    | 0,06                              | 4,625 % fällig am 01.06.2030       | 1.650       | 1.608                    | 0,06                              | 2,850 % fällig                        |             |                          |                                   |
| Silgan Holdings, Inc.                    |             |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.02.2029       | 6.400       | 6.294                    | 0,22                              | am 01.02.2029 (h)                     | 4.400       | 4.083                    | 0,14                              |
| 2,250 % fällig am 01.06.2028             | € 1.900     | 2.161                    | 0,07                              | 6,875 % fällig am 15.09.2028       | 476         | 493                      | 0,02                              | WEX, Inc.                             |             |                          |                                   |
| Sirius XM Radio LLC                      |             |                          |                                   | UGI International LLC              |             |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.03.2033          | 1.125       | 1.136                    | 0,04                              |
| 3,875 % fällig am 01.09.2031 (h)         | \$ 6.925    | 6.160                    | 0,21                              | 2,500 % fällig am 01.12.2029       | € 11.430    | 12.552                   | 0,43                              | Whirlpool Corp.                       |             |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.08.2027 (h)         | 2.875       | 2.852                    | 0,10                              | UKG, Inc.                          |             |                          |                                   | 6,125 % fällig am 15.06.2030          | 2.100       | 2.120                    | 0,07                              |
| SLM Corp.                                |             |                          |                                   | 6,875 % fällig am 01.02.2031       | \$ 4.600    | 4.776                    | 0,16                              | Williams Scotsman, Inc.               |             |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 31.01.2030             | 400         | 420                      | 0,01                              | Under Armour, Inc.                 |             |                          |                                   | 6,625 % fällig am 15.04.2030          | 850         | 884                      | 0,03                              |
| SM Energy Co.                            |             |                          |                                   | 3,250 % fällig am 15.06.2026       | 2.100       | 2.073                    | 0,07                              | 7,375 % fällig am                     |             |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027             | 2.000       | 2.003                    | 0,07                              | Unisys Corp.                       |             |                          |                                   | 01.10.2031 (h)                        | 4.700       | 4.950                    | 0,17                              |
| 6,750 % fällig am 01.08.2029             | 3.450       | 3.440                    | 0,12                              | 10,625 % fällig am 15.01.2031      | 1.525       | 1.572                    | 0,05                              | Windstream Services LLC               |             |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 01.08.2032             | 1.425       | 1.406                    | 0,05                              | United Airlines, Inc.              |             |                          |                                   | 8,250 % fällig am 01.10.2031          | 12.825      | 13.442                   | 0,46                              |
| Snap, Inc.                               |             |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.04.2029 (h)   | 7.700       | 7.479                    | 0,26                              | WR Grace Holdings LLC                 |             |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 01.03.2033 (h)         | 6.150       | 6.315                    | 0,22                              | United Rentals North America, Inc. |             |                          |                                   | 4,875 % fällig am 15.06.2027          | 2.000       | 1.991                    | 0,07                              |
| Speedway Motorsports LLC                 |             |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.02.2031       | 3.000       | 2.823                    | 0,10                              | Wyndham Hotels & Resorts, Inc.        |             |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 01.11.2027             | 2.000       | 1.987                    | 0,07                              | 6,125 % fällig am 15.03.2034       | 4.225       | 4.357                    | 0,15                              | 4,375 % fällig am 15.08.2028          | 1.590       | 1.556                    | 0,05                              |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust       |             |                          |                                   | Univision Communications, Inc.     |             |                          |                                   | Wynn Las Vegas LLC                    |             |                          |                                   |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029             | 798         | 733                      | 0,03                              | 4,500 % fällig am 01.05.2029       | 6.525       | 5.939                    | 0,20                              | 5,250 % fällig am 15.05.2027          | 7.000       | 7.010                    | 0,24                              |
| SS&C Technologies, Inc.                  |             |                          |                                   | 6,625 % fällig am 01.06.2027       | 5.000       | 4.991                    | 0,17                              | Wynn Resorts Finance LLC              |             |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 30.09.2027             | 10.100      | 10.116                   | 0,35                              | 8,000 % fällig am 15.08.2028       | 3.285       | 3.336                    | 0,11                              | 6,250 % fällig am 15.03.2033          | 1.600       | 1.611                    | 0,06                              |
| Stagwell Global LLC                      |             |                          |                                   | 8,500 % fällig am                  |             |                          |                                   | 7,125 % fällig am                     |             |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 15.08.2029             | 2.800       | 2.681                    | 0,09                              | 31.07.2031 (h)                     | 2.725       | 2.730                    | 0,09                              | 15.02.2031 (h)                        | 5.925       | 6.322                    | 0,22                              |
| Standard Industries, Inc.                |             |                          |                                   | USA Compression Partners LP        |             |                          |                                   | Yum! Brands, Inc.                     |             |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am                        |             |                          |                                   | 7,125 % fällig am 15.03.2029       | 1.150       | 1.179                    | 0,04                              | 3,625 % fällig am 15.03.2031          | 5.000       | 4.621                    | 0,16                              |
| 21.11.2026                               | € 15.200    | 17.681                   | 0,61                              | USI, Inc.                          |             |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.11.2037          | 100         | 108                      | 0,00                              |
| 3,375 % fällig am                        |             |                          |                                   | 7,500 % fällig am 15.01.2032       | 500         | 528                      | 0,02                              | Zayo Group Holdings, Inc.             |             |                          |                                   |
| 15.01.2031                               | \$ 841      | 755                      | 0,03                              | Valvoline, Inc.                    |             |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.03.2027          | 3.025       | 2.840                    | 0,10                              |
| 4,375 % fällig am 15.07.2030             | 631         | 598                      | 0,02                              | 3,625 % fällig am 15.06.2031       | 6.775       | 6.140                    | 0,21                              | ZipRecruiter, Inc.                    |             |                          |                                   |
| Star Parent, Inc.                        |             |                          |                                   | Venture Global Calcasieu Pass LLC  |             |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.01.2030          | 4.750       | 4.060                    | 0,14                              |
| 9,000 % fällig am 01.10.2030             | 500         | 527                      | 0,02                              | 3,875 % fällig am 01.11.2033       | 2.500       | 2.188                    | 0,08                              | ZoomInfo Technologies LLC             |             |                          |                                   |
| Starwood Property Trust, Inc.            |             |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.08.2031       | 1.025       | 949                      | 0,03                              | 3,875 % fällig am 01.02.2029          | 3.000       | 2.823                    | 0,10                              |
| 4,375 % fällig am 15.01.2027             | 350         | 347                      | 0,01                              | Venture Global LNG, Inc.           |             |                          |                                   |                                       |             |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 15.04.2030             | 275         | 278                      | 0,01                              | 7,000 % fällig am 15.01.2030       | 13.600      | 13.760                   | 0,48                              |                                       |             |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 01.07.2030             | 2.125       | 2.196                    | 0,08                              | 8,125 % fällig am 01.06.2028       | 6.450       | 6.670                    | 0,23                              | KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG    |             |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 15.10.2030             | 1.600       | 1.656                    | 0,06                              | 8,375 % fällig am 01.06.2031       | 1.150       | 1.195                    | 0,04                              | B&G Foods, Inc.                       |             |                          |                                   |
| Station Casinos LLC                      |             |                          |                                   | 9,500 % fällig am 01.02.2029       | 8.250       | 8.993                    | 0,31                              | 7,827 % fällig am 10.10.2029          | 5.700       | 5.225                    | 0,18                              |
| 4,500 % fällig am 15.02.2028             | 7.000       | 6.869                    | 0,24                              | 9,875 % fällig am 01.02.2032       | 2.550       | 2.755                    | 0,09                              | Barnes Group, Inc.                    |             |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 01.12.2031             | 3.391       | 3.179                    | 0,11                              | Venture Global Plaquemines LNG LLC |             |                          |                                   | 7,077 % fällig am 27.01.2032          | 2.668       | 2.676                    | 0,09                              |
| 6,625 % fällig am 15.03.2032             | 2.025       | 2.072                    | 0,07                              | 7,500 % fällig am 01.05.2033       | 4.350       | 4.661                    | 0,16                              | Caesars Entertainment, Inc.           |             |                          |                                   |
| Stonepeak Nile Parent LLC                |             |                          |                                   | Veritiv Operating Co.              |             |                          |                                   | 6,577 % fällig am 06.02.2031          | 10.803      | 10.810                   | 0,37                              |
| 7,250 % fällig am 15.03.2032             | 1.300       | 1.379                    | 0,05                              | 10,500 % fällig am 30.11.2030      | 1.700       | 1.842                    | 0,06                              | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. |             |                          |                                   |
|                                          |             |                          |                                   |                                    |             |                          |                                   | 1,625 % - 7,577 % fällig am           |             |                          |                                   |
|                                          |             |                          |                                   |                                    |             |                          |                                   | 01.04.2032 µ                          | 93          | 93                       | 0,00                              |

1.567.211 54,13

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | </ |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|----|
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|----|

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Euro-Bobl September Futures                                    | Short | 09.2025     | 305                     | \$ 158                                          | 0,01                    |
| Euro-Bund September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 59                      | (71)                                            | (0,01)                  |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 517                     | 417                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 118                     | 144                                             | 0,01                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 977                     | 1.963                                           | 0,07                    |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 310                     | 738                                             | 0,02                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 74                      | 264                                             | 0,01                    |
|                                                                |       |             |                         | \$ 3.613                                        | 0,12                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                         | \$ 3.613                                        | 0,12                    |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Referenzeinheit     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Newell Brands, Inc. | 1,000 %                        | 20.06.2028       | \$ 950                    | \$ 64                                           | 0,00                    |
| Telecom Italia SpA  | 1,000                          | 20.12.2029       | € 1.725                   | 62                                              | 0,00                    |
|                     |                                |                  |                           | \$ 126                                          | 0,00                    |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 160.875                | \$ 1.893                                        | 0,07                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex       | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,000 %         | 19.03.2030       | \$ 19.775  | \$ (572)                                        | (0,02)                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 18.06.2030       | 50.200     | 196                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 18.06.2055       | 5.150      | 38                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620           | 30.11.2029       | 106.517    | (1.370)                                         | (0,05)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2026       | 31.500     | (160)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2031       | 34.000     | 1.055                                           | 0,04                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex       | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750 %         | 15.05.2032       | \$ 81.399  | \$ (906)                                        | \$ (0,03)               |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2033       | 4.225      | 28                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250           | 17.09.2030       | € 74.010   | 749                                             | 0,03                    |
|                                                |                               |                 |                  |            | \$ (942)                                        | (0,03)                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                               |                 |                  |            | \$ 1.077                                        | 0,04                    |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| GST        | Petroleos Mexicanos | 4,850 %                        | 07.05.2026       | \$ 2.508                  | \$ 0                                         | \$ 30                                           | \$ 30     | 0,00                    |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | \$ 13.223              | € 11.632                 | \$ 431                           | \$ 0                               | \$ 431                                               | 0,02                    |
|            | 07.2025          | 3.767                  | £ 2.745                  | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 189                  | \$ 222                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £ 2.745                | \$ 3.768                 | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | € 4.018                | 4.542                    | 0                                | (175)                              | (175)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | 3.026                  | 3.544                    | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.335               | € 2.892                  | 65                               | 0                                  | 65                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | € 544.454              | \$ 618.583               | 0                                | (20.522)                           | (20.522)                                             | (0,71)                  |
|            | 07.2025          | £ 531                  | 713                      | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 7.528               | € 6.647                  | 275                              | 0                                  | 275                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 95.910                 | £ 70.491                 | 685                              | 0                                  | 685                                                  | 0,02                    |
| CBK        | 08.2025          | £ 70.491               | \$ 95.923                | 0                                | (688)                              | (688)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | € 3.307                | 3.791                    | 0                                | (91)                               | (91)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 9.042               | € 7.874                  | 201                              | 0                                  | 201                                                  | 0,01                    |
| DUB        | 07.2025          | 616.153                | 531.121                  | 7.302                            | 0                                  | 7.302                                                | 0,25                    |
|            | 08.2025          | € 529.956              | \$ 616.153               | 0                                | (7.292)                            | (7.292)                                              | (0,25)                  |
| FAR        | 07.2025          | CHF 62                 | 77                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD 13                 | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 75                  | CHF 62                   | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 77                     | 62                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | SGD 17                 | \$ 13                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD 15.455             | 11.253                   | 0                                | (74)                               | (74)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 7.351                | 8.483                    | 0                                | (146)                              | (146)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | £ 1.899                | 2.573                    | 0                                | (29)                               | (29)                                                 | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | SGD 40                 | 31                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 11.247              | CAD 15.461               | 83                               | 0                                  | 83                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 5.512                  | € 4.768                  | 85                               | 0                                  | 85                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 39                     | SGD 51                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD 15.435             | \$ 11.247                | 0                                | (84)                               | (84)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 51                 | 39                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CHF 97                 | 122                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 4.961                | 6.812                    | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | SGD 152                | 119                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 666                 | € 569                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 6.383                  | £ 4.654                  | 1                                | (6)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2.787                  | 2.053                    | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | 8                      | SGD 10                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 10                 | \$ 8                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | \$ 8.971               | € 7.786                  | 182                              | 0                                  | 182                                                  | 0,01                    |
| SSB        | 07.2025          | £ 70.114               | \$ 94.935                | 0                                | (1.145)                            | (1.145)                                              | (0,04)                  |
| WST        | 07.2025          | € 3.010                | 3.529                    | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 3.537               | € 3.010                  | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 9.364                         | \$ (30.287)                        | \$ (20.923)                                          | (0,72)                  |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                 | 10.769                | \$ 13.483                     | \$ 0                            | \$ (46)                                       | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 13.483                | CHF 10.725                    | 46                              | 46                                            | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | CHF                 | 10                    | \$ 12                         | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 34                    | CHF 27                        | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | CHF                 | 15                    | \$ 18                         | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 11                    | CHF 9                         | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          |                     | 548                   | 446                           | 12                              | 12                                            | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | CHF                 | 10.707                | \$ 13.374                     | 0                               | (77)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 12.854                | CHF 10.585                    | 444                             | 444                                           | 0,02                 |
|            | 08.2025          |                     | 13.374                | 10.662                        | 77                              | 77                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          |                     | 12.870                | 10.576                        | 417                             | 417                                           | 0,01                 |
| MYI        | 07.2025          |                     | 1.429                 | 1.141                         | 5                               | 5                                             | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          |                     | 11.815                | 9.690                         | 358                             | 358                                           | 0,01                 |
| SCX        | 07.2025          |                     | 56                    | 46                            | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 1.361                      | \$ (124)                        | \$ 1.237                                      | 0,04                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                   | 291.924               | \$ 341.807                    | \$ 0                            | \$ (867)                                      | (0,03)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 342.557               | € 291.924                     | 865                             | 865                                           | 0,03                 |
| BOA        | 07.2025          |                     | 364.478               | 320.547                       | 11.796                          | 11.796                                        | 0,41                 |
| BPS        | 07.2025          | €                   | 1.025                 | \$ 1.171                      | 0                               | (33)                                          | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | \$                  | 376.919               | € 331.812                     | 12.578                          | 12.578                                        | 0,43                 |
| CBK        | 07.2025          | €                   | 2.817                 | \$ 3.261                      | 0                               | (45)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 4.704                 | € 4.082                       | 88                              | 88                                            | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | €                   | 321.509               | \$ 372.982                    | 0                               | (4.421)                                       | (0,15)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 372.982               | € 320.804                     | 4.415                           | 4.415                                         | 0,15                 |
| MBC        | 07.2025          | €                   | 18.223                | \$ 21.033                     | 0                               | (357)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 4.682                 | € 4.043                       | 64                              | 64                                            | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | €                   | 318.825               | \$ 373.870                    | 0                               | (382)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 330.782               | € 292.800                     | 12.921                          | 12.921                                        | 0,44                 |
|            | 08.2025          |                     | 374.687               | 318.825                       | 383                             | 383                                           | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 43.110                     | \$ (6.105)                      | \$ 37.005                                     | 1,27                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £                   | 127.749               | \$ 175.297                    | \$ 236                          | \$ 236                                        | 0,01                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 175.321               | £ 127.749                     | 0                               | (235)                                         | (0,01)               |
| BOA        | 07.2025          |                     | 206                   | 152                           | 2                               | 2                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | £                   | 132.650               | \$ 180.486                    | 0                               | (1.291)                                       | (0,04)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 163.969               | £ 121.439                     | 2.444                           | 2.444                                         | 0,09                 |
|            | 08.2025          |                     | 180.326               | 132.515                       | 1.292                           | 1.292                                         | 0,05                 |
| CBK        | 07.2025          | £                   | 155                   | \$ 208                        | 0                               | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 13.920                | £ 10.231                      | 100                             | 100                                           | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          |                     | 174.768               | 129.729                       | 3.006                           | 3.006                                         | 0,10                 |
| MBC        | 07.2025          | £                   | 11.913                | \$ 16.081                     | 0                               | (244)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 15.473                | £ 11.349                      | 99                              | 79                                            | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £                   | 131.448               | \$ 180.241                    | 111                             | 111                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 174.879               | £ 129.156                     | 2.109                           | 2.109                                         | 0,07                 |
|            | 08.2025          |                     | 180.264               | 131.448                       | 0                               | (108)                                         | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          |                     | 2.520                 | 1.860                         | 30                              | 30                                            | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 9.429                      | \$ (1.903)                      | \$ 7.526                                      | 0,26                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD                 | 1.937                 | \$ 1.513                      | \$ 0                            | \$ (8)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 2.460                 | SGD 3.170                     | 30                              | 30                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 1.513                 | 1.932                         | 8                               | 8                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     | 92                    | 118                           | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | SGD                 | 12                    | \$ 9                          | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 295                   | SGD 378                       | 2                               | 2                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          |                     | 1.659                 | 2.137                         | 19                              | 19                                            | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | SGD                 | 6.227                 | \$ 4.882                      | 0                               | (7)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 3.382                 | SGD 4.352                     | 35                              | 35                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 4.882                 | 6.212                         | 8                               | 8                                             | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| GLM                              | 07.2025          | SGD 2.555           | \$ 2.004              | \$ 0                          | \$ (2)                          | \$ (2)                                         | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$ 2.004            | SGD 2.549             | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
| MBC                              | 07.2025          | SGD 4.867           | \$ 3.764              | 0                             | (58)                            | (58)                                           | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 2.579            | SGD 3.309             | 19                            | 0                               | 19                                             | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | 3.731               | 4.814                 | 58                            | 0                               | 58                                             | 0,01                 |
| MYI                              | 07.2025          | SGD 218             | \$ 170                | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 5.448            | SGD 7.004             | 51                            | 0                               | 51                                             | 0,00                 |
| SCX                              | 07.2025          | SGD 821             | \$ 636                | 0                             | (8)                             | (8)                                            | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$ 636              | SGD 819               | 8                             | 0                               | 8                                              | 0,00                 |
| SSB                              | 07.2025          | 963                 | 1.228                 | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
|                                  |                  |                     |                       | \$ 243                        | \$ (84)                         | \$ 159                                         | 0,01                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 25.034                                      | 0,86                 |

| BESCHREIBUNG                               | PARI (000\$) | MARKT-WERT (000\$) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|--------------|--------------------|-----------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |              |                    |                       |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 4.900.000 | \$ 588             | 0,02                  |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |              | \$ 588             | 0,02                  |
| Summe Anlagen                              |              | \$ 3.019.211       | 104,28                |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |              | \$ (123.952)       | (4,28)                |
| Nettovermögen                              |              | \$ 2.895.259       | 100,00                |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- µ Der gesamte Betrag oder ein Teil davon stellt ungedeckte Darlehenszusagen dar. Der Zinssatz für den ungedeckten Anteil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt. Weitere Informationen zu ungedeckten Darlehenszusagen finden Sie in Erläuterung 4, Wertpapiere und andere Anlagen, in den Erläuterungen zum Abschluss.
- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,14 %):

| Emittentenbeschreibung                                    | Kaufdatum  | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------------|------------|----------|-----------|----------------------|
| Miller Homes Group Finco PLC 6,529 % fällig am 15.10.2030 | 02.04.2025 | \$ 1.848 | \$ 2.031  | 0,07                 |
| Spirit Aviation Holdings, Inc. - Exp. 11.03.2035          | 17.03.2025 | 824      | 470       | 0,02                 |
|                                                           |            | \$ 2.672 | \$ 2.501  | 0,09                 |

- (h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert 156.726 USD (31. Dezember 2024: 21.430 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 937 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 60 USD (31. Dezember 2024: 10 USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 29.297 USD (31. Dezember 2024: 12.634 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 4.290 USD (31. Dezember 2024: 14.230 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 81                                                              | \$ 2.776.286                                              | \$ 30.177                                              | \$ 2.806.544 |
| Investmentfonds                     | 182.355                                                            | 0                                                         | 0                                                      | 182.355      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 87                                                                 | 29.637                                                    | 0                                                      | 29.724       |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                  | 588                                                       | 0                                                      | 588          |
| Summen                              | \$ 182.523                                                         | \$ 2.806.511                                              | \$ 30.177                                              | \$ 3.019.211 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 2.639.237                                                    | \$ 29.158                                                    | \$ 2.668.395        |
| Investmentfonds                     | 184.364                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 184.364             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 49                                                                          | (12.915)                                                        | 0                                                            | (12.866)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 612                                                             | 0                                                            | 612                 |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 184.413</b>                                                           | <b>\$ 2.626.934</b>                                             | <b>\$ 29.158</b>                                             | <b>\$ 2.840.505</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                       | 3,250 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (266)     | \$ (267)                                    | (0,01)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (2.174)      | (2.176)                                     | (0,08)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (1.392)      | (1.393)                                     | (0,05)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (2.280)      | (2.282)                                     | (0,08)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (4.201)      | (4.205)                                     | (0,15)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (2.917)      | (2.919)                                     | (0,10)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (1.092)      | (1.093)                                     | (0,04)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (1.893)      | (1.895)                                     | (0,07)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (1.681)      | (1.683)                                     | (0,06)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (28.203)     | (28.230)                                    | (0,97)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (186)        | (186)                                       | (0,01)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (13.873)     | (13.886)                                    | (0,48)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (5.546)      | (5.551)                                     | (0,19)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (14.019)     | (14.032)                                    | (0,48)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (11.110)     | (11.121)                                    | (0,38)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (998)        | (999)                                       | (0,03)                  |
| BPS                                       |            | 30.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (1.432)      | (1.437)                                     | (0,05)                  |
|                                           |            | 30.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (5.483)      | (5.504)                                     | (0,19)                  |
| BRC                                       |            | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (350)      | (411)                                       | (0,01)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (2.056)      | (2.414)                                     | (0,08)                  |
|                                           |            | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (2.679)      | (3.147)                                     | (0,11)                  |
|                                           |            | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (2.374)      | (2.788)                                     | (0,10)                  |
|                                           |            | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (585)        | (687)                                       | (0,02)                  |
|                                           |            | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (7.820)      | (9.187)                                     | (0,32)                  |
|                                           |            | 13.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (1.809)   | (1.819)                                     | (0,06)                  |
|                                           |            | 15.04.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (88)         | (89)                                        | 0,00                    |
| JML                                       |            | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (2.206)    | (2.591)                                     | (0,09)                  |
|                                           |            | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (682)        | (801)                                       | (0,03)                  |
| JPS                                       |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (814)     | (815)                                       | (0,03)                  |
| MYI                                       |            | 09.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | £ (1.659)    | (2.285)                                     | (0,08)                  |
| SOG                                       |            | 14.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (499)     | (500)                                       | (0,02)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                    |              | <b>\$ (126.393)</b>                         | <b>(4,37)</b>           |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 429                              | \$ (290)                              | \$ 139                          | \$ (29)                             | \$ 0                                  | \$ (29)                         |
| BOA        | 11.654                              | (11.120)                              | 534                             | (101)                               | 0                                     | (101)                           |
| BPS        | 24                                  | 0                                     | 24                              | (131)                               | 10                                    | (121)                           |
| BRC        | (5.242)                             | 4.290                                 | (952)                           | (248)                               | 0                                     | (248)                           |
| CBK        | 262                                 | (280)                                 | (18)                            | (215)                               | 0                                     | (215)                           |
| DUB        | 23                                  | 0                                     | 23                              | (7.731)                             | 6.860                                 | (871)                           |
| FAR        | 483                                 | (340)                                 | 143                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| GLM        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (1)                                 | 0                                     | (1)                             |
| GST        | 30                                  | (30)                                  | 0                               | (361)                               | 400                                   | 39                              |
| JPM        | 3.006                               | (3.020)                               | (14)                            | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| MBG        | (187)                               | 0                                     | (187)                           | (8.459)                             | 6.960                                 | (1.499)                         |
| MYI        | 64                                  | (40)                                  | 24                              | 6                                   | 0                                     | 6                               |
| RBC        | 358                                 | (300)                                 | 58                              | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| RYL        | 26                                  | 0                                     | 26                              | 16                                  | 0                                     | 16                              |
| SCX        | 1                                   | 0                                     | 1                               | 1.242                               | (530)                                 | 712                             |
| SOG        | 182                                 | 0                                     | 182                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| SSB        | 969                                 | (1.120)                               | (151)                           | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (1)                                 | 0                                     | (1)                             |
| UAG        | 30                                  | 0                                     | 30                              | (2)                                 | 0                                     | (2)                             |
| WST        | 12.922                              | (12.330)                              | 592                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| <b>Analyse des Gesamtvermögens</b>                                     | <b>30. Jun. 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|------------------------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 32,39                    | 30,00                    |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 55,61                    | 59,84                    |
| Investmentfonds                                                        | 5,72                     | 6,20                     |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,12                     | 0,01                     |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,13                     | 0,14                     |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,99                     | 0,35                     |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,02                     | 0,02                     |
| Sonstige Aktiva                                                        | 4,02                     | 3,44                     |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>            | <b>100,00</b>            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| <b>Anlagen zum Marktwert</b>                                                           | <b>30. Jun. 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|----------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Australien                                                                             | 0,32                     | k. A.                    |
| Österreich                                                                             | 0,20                     | 0,58                     |
| Belgien                                                                                | 0,99                     | 0,48                     |
| Bermuda                                                                                | 1,42                     | 1,01                     |
| Kanada                                                                                 | 4,10                     | 3,53                     |
| Kaimaninseln                                                                           | 0,57                     | 0,68                     |
| Tschechische Republik                                                                  | 0,17                     | k. A.                    |
| Dänemark                                                                               | 0,05                     | 0,04                     |
| Finnland                                                                               | 0,18                     | k. A.                    |
| Frankreich                                                                             | 2,56                     | 2,41                     |
| Deutschland                                                                            | 2,67                     | 1,92                     |
| Irland                                                                                 | 0,11                     | 0,44                     |
| Israel                                                                                 | 0,07                     | k. A.                    |
| Italien                                                                                | 2,74                     | 2,71                     |
| Japan                                                                                  | 0,91                     | 0,86                     |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 1,16                     | 0,69                     |
| Liberia                                                                                | 0,09                     | 0,88                     |
| Luxemburg                                                                              | 2,95                     | 3,31                     |
| Multinational                                                                          | 2,11                     | 1,49                     |
| Niederlande                                                                            | 3,06                     | 2,73                     |
| Norwegen                                                                               | 0,45                     | 0,20                     |
| Panama                                                                                 | 0,64                     | 0,38                     |
| Polen                                                                                  | 0,06                     | k. A.                    |
| Singapur                                                                               | 0,25                     | k. A.                    |
| Slowenien                                                                              | 0,09                     | k. A.                    |
| Spanien                                                                                | 0,51                     | 0,73                     |
| Schweden                                                                               | 0,66                     | 0,68                     |
| Schweiz                                                                                | 0,01                     | 0,01                     |
| Großbritannien                                                                         | 6,02                     | 4,73                     |
| USA                                                                                    | 61,82                    | 62,52                    |
| Investmentfonds                                                                        | 6,30                     | 6,43                     |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                          |                          |
| Futures                                                                                | 0,12                     | (0,01)                   |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                          |                          |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00                     | 0,01                     |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                                  | 0,07                     | (0,01)                   |
| Zinsswaps                                                                              | (0,03)                   | 0,12                     |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                          |                          |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00                     | (0,01)                   |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,72)                   | 0,35                     |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,58                     | (0,90)                   |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,02                     | 0,02                     |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (4,28)                   | 0,99                     |
| <b>Nettovermögen</b>                                                                   | <b>100,00</b>            | <b>100,00</b>            |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>         |                |                          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| FMG Resources Pty. Ltd.                 |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 01.04.2031            | \$ 27          | \$ 25                    | 0,23                              |
| 5,875 % fällig am 15.04.2030            | 50             | 51                       | 0,46                              |
| Summe Australien                        |                | 76                       | 0,69                              |

|                                         |    |    |      |
|-----------------------------------------|----|----|------|
| <b>ÖSTERREICH</b>                       |    |    |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |    |      |
| ams-OSRAM AG                            |    |    |      |
| 12,250 % fällig am 30.03.2029           | 25 | 27 | 0,24 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>BELGIEN</b>                          |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| Manuchar Group SARL                     |       |     |      |
| 7,250 % fällig am 30.06.2027            | € 100 | 120 | 1,09 |

|                                         |       |    |      |
|-----------------------------------------|-------|----|------|
| <b>BERMUDA</b>                          |       |    |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |    |      |
| NCL Corp. Ltd.                          |       |    |      |
| 5,875 % fällig am 15.02.2027            | \$ 75 | 75 | 0,69 |

|                                         |        |     |      |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>KANADA</b>                           |        |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |
| B.C. Unlimited Liability Co.            |        |     |      |
| 3,875 % fällig am 15.01.2028            | 125    | 122 | 1,11 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2030            | 25     | 23  | 0,21 |
| Brookfield Property Finance ULC         |        |     |      |
| 7,125 % fällig am 13.02.2028            | CAD 75 | 58  | 0,53 |
| GFL Environmental, Inc.                 |        |     |      |
| 6,750 % fällig am 15.01.2031            | \$ 75  | 79  | 0,72 |
| goeasy Ltd.                             |        |     |      |
| 9,250 % fällig am 01.12.2028            | 75     | 79  | 0,72 |
| Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.  |        |     |      |
| 6,000 % fällig am 15.09.2028            | 50     | 50  | 0,46 |
| Open Text Corp.                         |        |     |      |
| 3,875 % fällig am 15.02.2028            | 25     | 24  | 0,22 |
|                                         |        | 435 | 3,97 |

|                                      |        |     |      |
|--------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |        |     |      |
| Canada Government International Bond |        |     |      |
| 2,750 % fällig am 01.06.2033         | CAD 50 | 36  | 0,32 |
| Summe Kanada                         |        | 471 | 4,29 |

|                                                                                        |       |    |      |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------|----|------|
| <b>KAIMANINSELN</b>                                                                    |       |    |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                |       |    |      |
| Spirit Loyalty Cayman Ltd. (11,000 % Barmittel oder 4,000 % PIK und 8,000 % Barmittel) |       |    |      |
| 11,000 % fällig am 12.03.2030 (b)                                                      | \$ 47 | 32 | 0,29 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>DÄNEMARK</b>                         |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| TDC Net A/S                             |       |     |      |
| 6,500 % fällig am 01.06.2031            | € 100 | 130 | 1,19 |

|                                         |       |    |      |
|-----------------------------------------|-------|----|------|
| <b>FINNLAND</b>                         |       |    |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |    |      |
| Ahlstrom Holding Oy                     |       |    |      |
| 4,875 % fällig am 04.02.2028            | \$ 25 | 24 | 0,22 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>FRANKREICH</b>                       |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| CAB SELAS                               |       |     |      |
| 3,375 % fällig am 01.02.2028            | € 100 | 112 | 1,02 |
| ELO SACA                                |       |     |      |
| 2,875 % fällig am 29.01.2026            | 100   | 116 | 1,06 |
| Summe Frankreich                        |       | 228 | 2,08 |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>DEUTSCHLAND</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Bayer AG                                |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 25.09.2083            | € 100          | \$ 127                   | 1,15                              |
| Novellis Sheet Ingot GmbH               |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.04.2029            | 50             | 57                       | 0,52                              |
| Summe Deutschland                       |                | 184                      | 1,67                              |

|                                         |    |    |      |
|-----------------------------------------|----|----|------|
| <b>IRLAND</b>                           |    |    |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |    |      |
| Perrigo Finance Unlimited Co.           |    |    |      |
| 5,375 % fällig am 30.09.2032            | 50 | 60 | 0,55 |

|                                         |        |     |      |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>ITALIEN</b>                          |        |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA     |        |     |      |
| 4,750 % fällig am 15.03.2029            | 100    | 123 | 1,12 |
| TeamSystem SpA                          |        |     |      |
| 5,000 % fällig am 01.07.2031 (a)        | 100    | 117 | 1,07 |
| UniCredit SpA                           |        |     |      |
| 7,296 % fällig am 02.04.2034            | \$ 100 | 106 | 0,97 |
| Summe Italien                           |        | 346 | 3,16 |

|                                         |    |     |      |
|-----------------------------------------|----|-----|------|
| <b>JAPAN</b>                            |    |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |    |     |      |
| Rakuten Group, Inc.                     |    |     |      |
| 8,125 % fällig am 15.12.2029 (f)        | 25 | 25  | 0,23 |
| 9,750 % fällig am 15.04.2029            | 25 | 27  | 0,24 |
| 11,250 % fällig am 15.02.2027           | 45 | 49  | 0,45 |
| Summe Japan                             |    | 101 | 0,92 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>JERSEY, KANALINSELN</b>              |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| Aston Martin Capital Holdings Ltd.      |       |     |      |
| 10,375 % fällig am 31.03.2029           | £ 100 | 128 | 1,17 |

|                                         |        |     |      |
|-----------------------------------------|--------|-----|------|
| <b>LIBERIA</b>                          |        |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |     |      |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.            |        |     |      |
| 5,500 % fällig am 31.08.2026            | \$ 100 | 100 | 0,92 |

|                                         |      |     |      |
|-----------------------------------------|------|-----|------|
| <b>LUXEMBURG</b>                        |      |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |      |     |      |
| Camelot Finance S.A.                    |      |     |      |
| 4,500 % fällig am 01.11.2026            | 21   | 21  | 0,19 |
| CPI Property Group S.A.                 |      |     |      |
| 6,000 % fällig am 27.01.2032            | € 50 | 60  | 0,55 |
| Loarre Investments SARL                 |      |     |      |
| 6,500 % fällig am 15.05.2029            | 100  | 121 | 1,10 |
| Summe Luxemburg                         |      | 202 | 1,84 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>MULTINATIONAL</b>                    |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC  |       |     |      |
| 2,000 % fällig am 01.09.2028            | 100   | 111 | 1,01 |
| JetBlue Airways Corp.                   |       |     |      |
| 9,875 % fällig am 20.09.2031            | \$ 50 | 49  | 0,45 |
| Summe multinational                     |       | 160 | 1,46 |

|                                            |       |     |      |
|--------------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>NIEDERLANDE</b>                         |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |       |     |      |
| Axalta Coating Systems Dutch Holding BV    |       |     |      |
| 7,250 % fällig am 15.02.2031               | 50    | 53  | 0,48 |
| Flora Food Management BV                   |       |     |      |
| 6,875 % fällig am 02.07.2029               | € 100 | 119 | 1,08 |
| Sunrise FinCo BV                           |       |     |      |
| 4,875 % fällig am 15.07.2031               | \$ 50 | 47  | 0,43 |
| Telefonica Europe BV                       |       |     |      |
| 5,752 % fällig am 15.01.2032 (f)           | € 100 | 122 | 1,11 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV |       |     |      |
| 5,750 % fällig am 01.12.2030               | \$ 25 | 26  | 0,24 |
| 6,000 % fällig am 01.12.2032               | 25    | 26  | 0,24 |

| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| VZ Secured Financing BV      |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 15.01.2032 | € 50           | \$ 54                    | 0,49                              |
| Summe Niederlande            |                | 447                      | 4,07                              |

|                                         |     |     |      |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>PORTUGAL</b>                         |     |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |
| EDP S.A.                                |     |     |      |
| 1,875 % fällig am 02.08.2081            | 100 | 116 | 1,06 |

|                                          |       |    |      |
|------------------------------------------|-------|----|------|
| <b>SINGAPUR</b>                          |       |    |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |       |    |      |
| Seagate Data Storage Technology Pte Ltd. |       |    |      |
| 5,875 % fällig am 15.07.2030             | \$ 75 | 76 | 0,70 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>SPANIEN</b>                          |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| Grifols S.A.                            |       |     |      |
| 3,875 % fällig am 15.10.2028            | € 100 | 113 | 1,03 |

|                                         |     |     |      |
|-----------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>SCHWEDEN</b>                         |     |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |     |     |      |
| Castellum AB                            |     |     |      |
| 3,125 % fällig am 02.12.2026 (f)        | 100 | 115 | 1,05 |
| Verisure Holding AB                     |     |     |      |
| 5,500 % fällig am 15.05.2030            | 125 | 153 | 1,39 |
| Summe Schweden                          |     | 268 | 2,44 |

|                                         |       |     |      |
|-----------------------------------------|-------|-----|------|
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                  |       |     |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |     |      |
| BCP Modular Services Finance PLC        |       |     |      |
| 4,750 % fällig am 30.11.2028            | 100   | 115 | 1,05 |
| Ocado Group PLC                         |       |     |      |
| 10,500 % fällig am 08.08.2029           | £ 50  | 67  | 0,61 |
| Vmed O2 UK Financing PLC                |       |     |      |
| 4,250 % fällig am 31.01.2031            | \$ 25 | 23  | 0,21 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032 (a)        | € 100 | 119 | 1,09 |
| Vodafone Group PLC                      |       |     |      |
| 5,125 % fällig am 04.06.2081            | \$ 50 | 38  | 0,35 |
| Summe Großbritannien                    |       | 362 | 3,31 |

|                                    |    |   |      |
|------------------------------------|----|---|------|
| <b>USA</b>                         |    |   |      |
| <b>AKTIEN</b>                      |    |   |      |
| <b>STAMMAKTIVEN</b>                |    |   |      |
| <b>INDUSTRIEWERTE</b>              |    |   |      |
| Spirit Aviation Holdings, Inc. (c) | 92 | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| Acadia Healthcare Co., Inc.             |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 01.07.2028            | \$ 25          | 25                       | 0,23                              |
| ADT Security Corp.                      |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 15.07.2032            | 50             | 48                       | 0,44                              |
| Advance Auto Parts, Inc.                |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 15.03.2032            | 25             | 22                       | 0,20                              |
| AES Corp.                               |                |                          |                                   |
| 7,600 % fällig am 15.01.2055            | 50             | 52                       | 0,47                              |
| AMC Networks, Inc.                      |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.02.2029            | 50             | 40                       | 0,36                              |
| Amer Sports Co.                         |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 16.02.2031            | 75             | 78                       | 0,71                              |
| AmWINS Group, Inc.                      |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 15.02.2029            | 50             | 51                       | 0,46                              |
| Avantor Funding, Inc.                   |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.07.2028            | 75             | 74                       | 0,67                              |
| Ball Corp.                              |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 15.08.2030            | 125            | 113                      | 1,03                              |
| Block, Inc.                             |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 01.06.2026            | 50             | 49                       | 0,45                              |
| 3,500 % fällig am 01.06.2031            | 50             | 46                       | 0,42                              |
| Boise Cascade Co.                       |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 01.07.2030            | 50             | 49                       | 0,45                              |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond ESG Fund (Forts.)

|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art  | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Euro-Bobl September Futures                                    | Long | 09.2025     | 2                    | \$ (1)                                   | (0,01)               |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long | 09.2025     | 3                    | 2                                        | 0,02                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long | 09.2025     | 5                    | 5                                        | 0,05                 |
|                                                                |      |             |                      | <b>\$ 6</b>                              | <b>0,06</b>          |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |      |             |                      | <b>\$ 6</b>                              | <b>0,06</b>          |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Referenzeinheit                    | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Faurecia Automotive Holdings, Inc. | 5,000 %                     | 20.12.2029       | € 40                      | \$ 0                                     | 0,00                 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000 %                     | 20.06.2030       | \$ 1.025                  | \$ 25                                    | 0,21                 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz              | Variabler Zinssatzindex       | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|------------------|------------|------------------------------------------|----------------------|
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620 %         | 30.11.2029       | \$ 126     | \$ (2)                                   | (0,01)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2029       | 200        | 4                                        | 0,04                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2031       | 100        | (1)                                      | (0,01)               |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 15.05.2032       | 99         | (1)                                      | (0,01)               |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2033       | 125        | 1                                        | 0,01                 |
|                                                |                               |                 |                  |            | <b>\$ 1</b>                              | <b>0,02</b>          |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                               |                 |                  |            | <b>\$ 26</b>                             | <b>0,23</b>          |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | € 2.005             | \$ 2.280              | \$ 0                          | \$ (73)                       | \$ (73)                                       | (0,67)               |
| BPS        | 07.2025          | \$ 10               | € 9                   | 0                             | 0                             | 0                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 192                 | £ 141                 | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | £ 141               | \$ 192                | 0                             | (1)                           | (1)                                           | (0,01)               |
| CBK        | 07.2025          | € 96                | 110                   | 0                             | (3)                           | (3)                                           | (0,02)               |
| DUB        | 07.2025          | \$ 2.306            | € 1.988               | 28                            | 0                             | 28                                            | 0,25                 |
|            | 08.2025          | € 1.984             | \$ 2.306              | 0                             | (28)                          | (28)                                          | (0,25)               |
| MBC        | 07.2025          | CAD 123             | 90                    | 0                             | (1)                           | (1)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 90               | CAD 123               | 1                             | 0                             | 1                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          | 118                 | € 104                 | 4                             | 0                             | 4                                             | 0,04                 |
|            | 08.2025          | CAD 123             | \$ 90                 | 0                             | (1)                           | (1)                                           | (0,01)               |
| SSB        | 07.2025          | £ 141               | 191                   | 0                             | (2)                           | (2)                                           | (0,02)               |
|            |                  |                     |                       | <b>\$ 34</b>                  | <b>\$ (109)</b>               | <b>\$ (75)</b>                                | <b>(0,68)</b>        |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond ESG Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | \$ 108              | € 95                  | \$ 3                          | \$ 0                            | \$ 3                                          | 0,03                 |
| BRC        | 07.2025          | 104                 | 92                    | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,03                 |
| DUB        | 07.2025          | € 93                | \$ 108                | 0                             | 0                               | 0                                             | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$ 108              | € 93                  | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025          | 94                  | 83                    | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,03                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 10                         | \$ 0                            | \$ 10                                         | 0,09                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BRC        | 07.2025          | £ 76                | \$ 104                | \$ 0                          | \$ (1)                          | \$ (1)                                        | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 93               | £ 69                  | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | 104                 | 76                    | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,01                 |
| JPM        | 07.2025          | 101                 | 75                    | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,02                 |
| MBC        | 07.2025          | 5                   | 3                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £ 75                | \$ 104                | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 102              | £ 75                  | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | 104                 | 75                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 6                          | \$ (1)                          | \$ 5                                          | 0,04                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BRC        | 07.2025          | \$ 0                | SEK 2                 | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                          | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | SEK 965             | \$ 102                | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          | \$ 5                | SEK 47                | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 102                 | 963                   | 0                             | (1)                             | (1)                                           | (0,01)               |
| FAR        | 07.2025          | 100                 | 958                   | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          | 89                  | 852                   | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,01                 |
| UAG        | 07.2025          | 100                 | 961                   | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 4                          | \$ (2)                          | \$ 2                                          | 0,02                 |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (58) (0,53)

Summe Anlagen

\$ 10.177 92,82

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ 787 7,18

Nettovermögen

\$ 10.964 100,00

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,22 %):

| Emittentenbeschreibung                           | Kaufdatum  | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------|------------|--------|-----------|----------------------|
| Spirit Aviation Holdings, Inc. - Exp. 11.03.2035 | 17.03.2025 | \$ 5   | \$ 3      | 0,03                 |

Barmittel in Höhe von 207 USD (31. Dezember 2024: 123 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                               | \$ 10.084                                                 | \$ 119                                                 | \$ 10.203 |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (1)                                                                | (25)                                                      | 0                                                      | (26)      |
| Summen                        | \$ (1)                                                             | \$ 10.059                                                 | \$ 119                                                 | \$ 10.177 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert       |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 9.004                                                        | \$ 52                                                        | \$ 9.056        |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (2)                                                                         | 30                                                              | 0                                                            | 28              |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ (2)</b>                                                               | <b>\$ 9.034</b>                                                 | <b>\$ 52</b>                                                 | <b>\$ 9.084</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| BOA        | \$ (70)                             | \$ 0                                  | \$ (70)                         | \$ 1                                | \$ 0                                  | \$ 1                            |
| BRC        | 5                                   | 0                                     | 5                               | 1                                   | 0                                     | 1                               |
| CBK        | (4)                                 | 0                                     | (4)                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| DUB        | 1                                   | 0                                     | 1                               | (2)                                 | 0                                     | (2)                             |
| FAR        | 1                                   | 0                                     | 1                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| JPM        | 2                                   | 0                                     | 2                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| MBC        | 6                                   | 0                                     | 6                               | 33                                  | 0                                     | 33                              |
| MYI        | 1                                   | 0                                     | 1                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| SCX        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (3)                                 | 0                                     | (3)                             |
| SSB        | (1)                                 | 0                                     | (1)                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| UAG        | 1                                   | 0                                     | 1                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 40,74             | 33,86             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 48,83             | 51,66             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,07              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,26              | 0,11              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,47              | 0,40              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 9,63              | 13,97             |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>     | <b>100,00</b>     |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                               | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                          | 0,69              | k. A.             |
| Österreich                                          | 0,24              | 0,70              |
| Belgien                                             | 1,09              | 0,98              |
| Bermuda                                             | 0,69              | 0,72              |
| Kanada                                              | 4,29              | 5,04              |
| Kaimaninseln                                        | 0,29              | 0,56              |
| Dänemark                                            | 1,19              | 1,10              |
| Finnland                                            | 0,22              | k. A.             |
| Frankreich                                          | 2,08              | 1,88              |
| Deutschland                                         | 1,67              | 2,74              |
| Irland                                              | 0,55              | 0,92              |
| Italien                                             | 3,16              | 3,07              |
| Japan                                               | 0,92              | 0,50              |
| Jersey, Kanalinseln                                 | 1,17              | k. A.             |
| Liberia                                             | 0,92              | 1,91              |
| Luxemburg                                           | 1,84              | 2,75              |
| Multinational                                       | 1,46              | 1,10              |
| Niederlande                                         | 4,07              | 3,03              |
| Portugal                                            | 1,06              | 0,97              |
| Singapur                                            | 0,70              | k. A.             |
| Spanien                                             | 1,03              | k. A.             |
| Schweden                                            | 2,44              | 2,24              |
| Großbritannien                                      | 3,31              | 3,46              |
| USA                                                 | 54,35             | 52,94             |
| Kurzfristige Instrumente                            | 3,63              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate |                   |                   |
| Futures                                             | 0,06              | (0,06)            |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf                                  | 0,21              | (0,03)            |
| Zinsswaps                                                                              | 0,02              | 0,08              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,68)            | 0,40              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,15              | (0,11)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | 7,18              | 13,12             |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000S)                          | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                       | PARI<br>(000S)                | MARKT-<br>WERT<br>(000S)             | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                              |        |       |      |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|-------------------------------|--------------------------------------|-----------------------------------|------------------------------|--------|-------|------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                       |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | BRASILILIEN                        |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| AUSTRALIEN                                     |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL   |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Aurizon Network Pty. Ltd.                      |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | Itau Unibanco Holding S.A.         |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 2,900 % fällig am 02.09.2030                   | AUD            | 6.400                    | \$ 3.757                          | 0,05                             | 5,605 % fällig am 22.01.2032            | AUD                      | 10.900                            | \$ 7.440                           | 0,09                          | 6,000 % fällig am 27.02.2030         | \$ 17.000                         | \$ 17.449                    | 0,21   |       |      |
| 6,100 % fällig am 12.09.2031                   |                | 11.450                   | 7.826                             | 0,09                             | 6,190 % fällig am 24.04.2034            |                          | 4.400                             | 3.061                              | 0,04                          | Vale Overseas Ltd.                   |                                   |                              |        |       |      |
| 6,200 % fällig am 05.12.2033                   |                | 5.200                    | 3.515                             | 0,04                             | WestConnex Finance Co. Pty. Ltd.        |                          |                                   |                                    |                               | 6,400 % fällig am 28.06.2054         | 2.000                             | 1.967                        | 0,02   |       |      |
| 6,560 % fällig am                              |                |                          |                                   |                                  | 6,150 % fällig am 09.10.2030            |                          | 5.370                             | 3.704                              | 0,04                          |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 21.12.2034 (i)                                 |                | 500                      | 343                               | 0,00                             | Westpac Banking Corp.                   | €                        | 4.200                             | 5.022                              | 0,06                          |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Ausgrid Finance Pty. Ltd.                      |                |                          |                                   |                                  | Woodside Finance Ltd.                   |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,408 % fällig am 28.03.2031                   |                |                          |                                   |                                  | 3,700 % fällig am 15.03.2028            | \$                       | 600                               | 586                                | 0,01                          |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd. |                |                          |                                   |                                  | 4,500 % fällig am 04.03.2029            |                          | 16.615                            | 16.414                             | 0,20                          |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,598 % fällig am 01.11.2032                   |                | 1.000                    | 677                               | 0,01                             | 5,100 % fällig am 12.09.2034            |                          | 6.500                             | 6.297                              | 0,08                          |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Bank of Queensland Ltd.                        |                |                          |                                   |                                  | 5,400 % fällig am 19.05.2030            |                          | 6.000                             | 6.088                              | 0,07                          |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 3,300 % fällig am 30.07.2029                   | €              | 3.400                    | 4.095                             | 0,05                             |                                         |                          |                                   | 250.613                            | 3,01                          |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Boral Finance Pty. Ltd.                        |                |                          |                                   |                                  | STAATSEMISSIONEN                        |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 3,750 % fällig am 01.05.2028                   | \$             | 415                      | 399                               | 0,01                             | Australia Government International Bond |                          |                                   |                                    |                               | BRAZIL Government International Bond |                                   |                              |        |       |      |
| Brisbane Airport Corp. Pty. Ltd.               |                |                          |                                   |                                  | 1,250 % fällig am 21.05.2032            | AUD                      | 5.400                             | 2.996                              | 0,04                          | 7,125 % fällig am 13.05.2054         | 8.200                             | 7.873                        | 0,10   |       |      |
| 4,500 % fällig am 30.12.2030                   | AUD            | 4.010                    | 2.591                             | 0,03                             | Summe Australien                        |                          |                                   | 253.609                            | 3,05                          | Summe Brasilien                      |                                   |                              | 27.289 | 0,33  |      |
| 5,900 % fällig am 08.03.2034                   |                | 800                      | 544                               | 0,01                             | ÖSTERREICH                              |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| ConnectEast Finance Pty. Ltd.                  |                |                          |                                   |                                  | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL        |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,600 % fällig am 27.06.2031                   |                | 10.790                   | 7.323                             | 0,09                             | Erste Group Bank AG                     | €                        | 8.100                             | 9.625                              | 0,11                          | KANADA                               |                                   |                              |        |       |      |
| Dexus Finance Pty. Ltd.                        |                |                          |                                   |                                  | 2,875 % fällig am 09.01.2031            | €                        | 8.100                             | 9.625                              | 0,11                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL     |                                   |                              |        |       |      |
| 2,500 % fällig am 17.10.2029                   |                | 2.100                    | 1.256                             | 0,02                             | 5,125 % fällig am 15.10.2025 (f)(h)     | 5.400                    | 6.367                             | 0,08                               | Air Canada Pass-Through Trust |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Dyno Nobel Ltd.                                |                |                          |                                   |                                  | UniCredit Bank Austria AG               |                          |                                   |                                    |                               | 3,300 % fällig am 15.07.2031         |                                   |                              |        |       |      |
| 4,300 % fällig am 18.03.2026                   |                | 600                      | 393                               | 0,00                             | 2,875 % fällig am 10.11.2028            | 3.300                    | 3.928                             | 0,05                               | 3,600 % fällig am 15.09.2028  | 4.635                                | 4.530                             | 0,05                         |        |       |      |
| GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                     |                |                          |                                   |                                  | Summe Österreich                        |                          |                                   | 19.920                             | 0,24                          | 3,750 % fällig am 15.06.2029         | 2.264                             | 2.204                        | 0,03   |       |      |
| 1,900 % fällig am 14.12.2028                   | 23.500         | 14.171                   | 0,17                              | BELGIEN                          |                                         |                          |                                   | 5,250 % fällig am 01.10.2030       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 4,742 % fällig am 03.06.2030                   | 4.500          | 2.981                    | 0,04                              | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL |                                         |                          |                                   | Alimentation Couche-Tard, Inc.     |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.            |                |                          |                                   | Argenta Spaarbank NV             |                                         |                          |                                   | 2,950 % fällig am 25.01.2030       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 4,250 % fällig am 03.05.2030                   | €              | 900                      | 1.103                             | 0,01                             | 2,500 % fällig am 25.10.2027            | 4.700                    | 5.555                             | 0,07                               | Bank of Montreal              |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| GTA Finance Co. Pty. Ltd.                      |                |                          |                                   |                                  | Belfius Bank S.A.                       |                          |                                   |                                    | 4,689 % fällig am 28.06.2028  | 5.000                                | 5.105                             | 0,06                         |        |       |      |
| 2,200 % fällig am 26.08.2027                   | AUD            | 7.200                    | 4.485                             | 0,05                             | 2,875 % fällig am 12.02.2031            | 1.900                    | 2.244                             | 0,03                               | Brookfield Finance, Inc.      |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,400 % fällig am 04.12.2029                   | 15.700         | 10.560                   | 0,13                              | KBC Bank NV                      |                                         |                          |                                   |                                    | 3,500 % fällig am 30.03.2051  | 19.100                               | 12.971                            | 0,16                         |        |       |      |
| Lendlease Finance Ltd.                         |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 28.09.2026     | 6.000                                   | 7.182                    | 0,08                              | 3,900 % fällig am 25.01.2028       | 500                           | 494                                  | 0,01                              |                              |        |       |      |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027                   | 9.900          | 6.270                    | 0,08                              | Sofina S.A.                      |                                         |                          |                                   | 4,850 % fällig am 29.03.2029       | 4.834                         | 4.882                                | 0,06                              |                              |        |       |      |
| 3,700 % fällig am 31.03.2031                   | 2.000          | 1.148                    | 0,01                              | 1,000 % fällig am 23.09.2028     | 9.200                                   | 10.031                   | 0,12                              | Canadian Imperial Bank of Commerce |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Lonsdale Finance Pty. Ltd.                     |                |                          |                                   | UCB S.A.                         |                                         |                          |                                   | 2,625 % fällig am 01.10.2029       | €                             | 5.400                                | 6.363                             | 0,08                         |        |       |      |
| 5,500 % fällig am 19.11.2031                   | 9.880          | 6.656                    | 0,08                              | 4,250 % fällig am 20.03.2030     | 2.600                                   | 3.132                    | 0,04                              | Canadian Natural Resources Ltd.    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Macquarie University                           |                |                          |                                   | Summe Belgien                    |                                         |                          | 28.144                            | 0,34                               | 3,850 % fällig am 01.06.2027  | \$                                   | 210                               | 208                          | 0,00   |       |      |
| 3,500 % fällig am 07.09.2028                   | 250            | 160                      | 0,00                              | BERMUDA                          |                                         |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.12.2029       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| NBN Co. Ltd.                                   |                |                          |                                   | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE |                                         |                          |                                   | 2,450 % fällig am 02.12.2031       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,000 % fällig am 28.08.2031                   | 3.500          | 2.353                    | 0,03                              | MAPS Ltd.                        |                                         |                          |                                   | CI Financial Corp.                 |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Network Finance Co. Pty. Ltd.                  |                |                          |                                   | 4,212 % fällig am 15.05.2043     |                                         |                          |                                   | \$                                 | 1.270                         | 1.268                                | 0,01                              | 4,100 % fällig am 15.06.2051 | 5.037  | 3.584 | 0,04 |
| 6,061 % fällig am 19.06.2030                   | 700            | 485                      | 0,01                              | START Ltd.                       |                                         |                          |                                   | 4,750 % fällig am 03.04.2028       |                               |                                      |                                   | CAD                          | 11.000 | 8.081 | 0,10 |
| NSW Ports Finance Co. Pty. Ltd.                |                |                          |                                   | 4,089 % fällig am 15.03.2044     |                                         |                          |                                   | 6,000 % fällig am 20.09.2027       |                               |                                      |                                   | 1.000                        | 755    | 0,01  |      |
| 5,042 % fällig am 19.09.2031                   | 6.300          | 4.183                    | 0,05                              | Trinitas CLO Ltd.                |                                         |                          |                                   | Coastal Gaslink Pipeline LP        |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,432 % fällig am 19.09.2034                   | 11.600         | 7.560                    | 0,09                              | 5,309 % fällig am 20.07.2035     | 1.700                                   | 1.692                    | 0,02                              | 5,538 % fällig am 30.06.2039       | 1.900                         | 1.517                                | 0,02                              |                              |        |       |      |
| Optus Finance Pty. Ltd.                        |                |                          |                                   | 5,379 % fällig am 20.10.2033     | 3.400                                   | 3.402                    | 0,04                              | 5,607 % fällig am 30.06.2044       | 1.500                         | 1.200                                | 0,01                              |                              |        |       |      |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029                   | €              | 1.700                    | 1.849                             | 0,02                             |                                         |                          | 8.614                             | 0,10                               | 5,857 % fällig am             |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Pacific National Finance Pty. Ltd.             |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL |                                         |                          |                                   | 30.03.2049 (i)                     |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028                   | \$             | 9.000                    | 8.742                             | 0,11                             | Aircastle Ltd.                          |                          |                                   |                                    | 5,857 % fällig am 30.06.2049  | 5.000                                | 4.147                             | 0,05                         |        |       |      |
| Perth Airport Pty. Ltd.                        |                |                          |                                   | Aircastle Ltd.                   |                                         |                          |                                   | Enbridge, Inc.                     |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,600 % fällig am 05.03.2031                   | AUD            | 600                      | 405                               | 0,01                             | 2,850 % fällig am 26.01.2028            | 6.500                    | 6.191                             | 0,08                               | 4,250 % fällig am 01.12.2026  | \$                                   | 7.504                             | 7.492                        | 0,09   |       |      |
| Qantas Airways Ltd.                            |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.06.2026     |                                         |                          |                                   | 5,625 % fällig am                  |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 3,150 % fällig am 27.09.2028                   | 500            | 312                      | 0,00                              | 5,250 % fällig am 15.03.2030     |                                         |                          |                                   | 05.04.2034 (j)                     |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,900 % fällig am 19.09.2034                   | 7.700          | 5.164                    | 0,06                              | 6,500 % fällig am 18.07.2028     |                                         |                          |                                   | Fairfax Financial Holdings Ltd.    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| QBE Insurance Group Ltd.                       |                |                          |                                   | Arch Capital Group Ltd.          |                                         |                          |                                   | 2,750 % fällig am 29.03.2028       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,834 % fällig am                              |                |                          |                                   | 3,635 % fällig am 30.06.2050     |                                         |                          |                                   | 1,646 % fällig am 25.02.2028       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 03.10.2035 (h)                                 | \$             | 6.900                    | 7.046                             | 0,08                             | Bacardi Ltd.                            |                          |                                   |                                    | CAD                           | 7.082                                | 5.001                             | 0,06                         |        |       |      |
| QPH Finance Co. Pty. Ltd.                      |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 15.07.2026     |                                         |                          |                                   | Open Text Corp.                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,302 % fällig am 05.03.2032                   | AUD            | 5.300                    | 3.527                             | 0,04                             | Essent Group Ltd.                       |                          |                                   |                                    | 6,900 % fällig am 01.12.2027  | \$                                   | 1.000                             | 1.036                        | 0,01   |       |      |
| 5,695 % fällig am 05.03.2035                   | 9.890          | 6.614                    | 0,08                              | 6,250 % fällig am 01.07.2029     | 5.125                                   | 5.311                    | 0,06                              | Royal Bank of Canada               |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Santos Finance Ltd.                            |                |                          |                                   | Seadrill Finance Ltd.            |                                         |                          |                                   | 3,500 % fällig am 25.07.2028       | €                             | 1.000                                | 1.212                             | 0,01                         |        |       |      |
| 3,649 % fällig am 29.04.2031                   | \$             | 7.600                    | 7.080                             | 0,09                             | 8,375 % fällig am 01.08.2030            | 300                      | 306                               | 0,00                               | 4,851 % fällig am 14.12.2026  | \$                                   | 8.900                             | 9.003                        | 0,11   |       |      |
| 4,125 % fällig am 14.09.2027                   | 7.800          | 7.691                    | 0,09                              | VOC Escrow Ltd.                  |                                         |                          |                                   | Toronto-Dominion Bank              |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029                   | 23.303         | 23.526                   | 0,28                              | 5,000 % fällig am 15.02.2028     | 1.200                                   | 1.195                    | 0,01                              | 2,492 % fällig am 16.02.2027       | €                             | 3.330                                | 3.914                             | 0,05                         |        |       |      |
| 6,875 % fällig am 19.09.2033                   | 4.800          | 5.244                    | 0,06                              |                                  |                                         |                          | 29.140                            | 0,35                               | 2,776 % fällig am 03.09.2027  | 1.700                                | 2.019                             | 0,02                         |        |       |      |
| SGSP Australia Assets Pty. Ltd.                |                |                          |                                   | Summe Bermuda                    |                                         |                          |                                   | 3,191 % fällig am 16.02.2029       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 3,250 % fällig am 29.07.2026                   | 1.200          | 1.185                    | 0,01                              |                                  |                                         |                          | 37.754                            | 0,45                               | 3,247 % fällig am 16.02.2034  | 3.330                                | 3.951                             | 0,05                         |        |       |      |
| Stockland Trust                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 3,765 % fällig am 08.09.2026       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,420 % fällig am 25.03.2032                   | AUD            | 5.100                    | 3.423                             | 0,04                             |                                         |                          |                                   |                                    | 4,680 % fällig am 08.01.2029  |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.           |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 4,814 % fällig am 16.07.2027       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,500 % fällig am 23.04.2032                   | 1.800          | 1.211                    | 0,01                              |                                  |                                         |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,900 % fällig am 19.04.2034                   | 5.700          | 3.879                    | 0,05                              |                                  |                                         |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.        |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,500 % fällig am 02.09.2032                   | 3.000          | 2.000                    | 0,02                              |                                  |                                         |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
| 5,623 % fällig am 28.08.2034                   | 11.650         | 7.721                    | 0,09                              |                                  |                                         |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                   |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | CPPIB Capital, Inc.                |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 4,300 % fällig am 02.06.2034       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | CAD                                |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 10.600                             |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 8.103                              |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 0,10                               |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | Province of Ontario                |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 2,050 % fällig am 02.06.2030       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 9.927                              |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 6.942                              |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 0,08                               |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 3,800 % fällig am 02.12.2034       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 10.300                             |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 7.545                              |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 0,09                               |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | Province of Quebec                 |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 1,900 % fällig am 01.09.2030       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 4.500                              |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 3.110                              |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 0,04                               |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   |                                    |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 25.700                             |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 0,31                               |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | Summe Kanada                       |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 200.360                            |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |
|                                                |                |                          |                                   |                                  |                                         |                          |                                   | 2,41                               |                               |                                      |                                   |                              |        |       |      |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>KAIMANINSELN</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>              |                |                          |                                   |
| AGL CLO Ltd.                                         |                |                          |                                   |
| 5,399 % fällig am 02.12.2034                         | \$ 3.100       | \$ 3.101                 | 0,04                              |
| Atlantic Avenue Ltd.                                 |                |                          |                                   |
| 5,529 % fällig am 20.01.2035                         | 3.000          | 2.999                    | 0,04                              |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd.                          |                |                          |                                   |
| 5,608 % fällig am 15.01.2031                         | 828            | 829                      | 0,01                              |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                         |                |                          |                                   |
| 5,335 % fällig am 24.07.2034                         | 1.700          | 1.693                    | 0,02                              |
| Betony CLO Ltd.                                      |                |                          |                                   |
| 5,621 % fällig am 30.04.2031                         | 1.463          | 1.465                    | 0,02                              |
| Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd. |                |                          |                                   |
| 4,213 % fällig am 16.12.2041                         | 1.872          | 1.869                    | 0,02                              |
| Canyon Capital CLO Ltd.                              |                |                          |                                   |
| 5,266 % fällig am 15.10.2034                         | 1.000          | 1.001                    | 0,01                              |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.            |                |                          |                                   |
| 5,638 % fällig am 15.05.2031                         | 1.324          | 1.325                    | 0,01                              |
| 5,658 % fällig am 15.07.2031                         | 2.178          | 2.184                    | 0,03                              |
| KDAC Aviation Finance Ltd.                           |                |                          |                                   |
| 4,212 % fällig am 15.12.2042                         | 1.965          | 1.914                    | 0,02                              |
| Romark Ltd.                                          |                |                          |                                   |
| 5,561 % fällig am 20.04.2031                         | 1.357          | 1.359                    | 0,02                              |
| Sapphire Aviation Finance Ltd.                       |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040                         | 222            | 222                      | 0,00                              |
| Sound Point CLO Ltd.                                 |                |                          |                                   |
| 5,518 % fällig am 15.04.2031                         | 1.362          | 1.364                    | 0,02                              |
| 5,651 % fällig am 21.01.2031                         | 800            | 801                      | 0,01                              |
| Steele Creek CLO Ltd.                                |                |                          |                                   |
| 5,528 % fällig am 15.04.2031                         | 265            | 266                      | 0,00                              |
| Trinitas CLO Ltd.                                    |                |                          |                                   |
| 5,342 % fällig am 25.01.2035                         | 2.300          | 2.291                    | 0,03                              |
| 5,631 % fällig am 20.07.2031                         | 1.024          | 1.025                    | 0,01                              |
| Wind River CLO Ltd.                                  |                |                          |                                   |
| 5,581 % fällig am 18.07.2031                         | 36             | 36                       | 0,00                              |
|                                                      |                | 25.744                   | 0,31                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                         |                |                          |                                   |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027                         | 11.775         | 11.198                   | 0,14                              |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026                         | 18.600         | 18.631                   | 0,22                              |
| 5,750 % fällig am 01.03.2029                         | 2.000          | 2.055                    | 0,03                              |
| China Modern Dairy Holdings Ltd.                     |                |                          |                                   |
| 2,125 % fällig am 14.07.2026                         | 9.200          | 8.945                    | 0,11                              |
| Gaci First Investment Co.                            |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 14.02.2030                         | 2.600          | 2.612                    | 0,03                              |
| 4,875 % fällig am 14.02.2035                         | 1.700          | 1.666                    | 0,02                              |
| 5,125 % fällig am 14.02.2053                         | 13.000         | 11.149                   | 0,13                              |
| 5,250 % fällig am 13.10.2032                         | 4.000          | 4.076                    | 0,05                              |
| GGAM Finance Ltd.                                    |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 15.02.2027                         | 2.700          | 2.786                    | 0,03                              |
| SRC Sukuk Ltd.                                       |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 27.02.2035                         | 10.000         | 10.138                   | 0,12                              |
| Suci Second Investment Co.                           |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.10.2028                         | 800            | 833                      | 0,01                              |
| Yorkshire Power Finance Ltd.                         |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 04.08.2028                         | £ 6.800        | 9.934                    | 0,12                              |
|                                                      |                | 84.023                   | 1,01                              |
| Summe Kaimaninseln                                   |                | 109.767                  | 1,32                              |
| <b>CHILE</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| Chile Government International Bond                  |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 14.01.2032                         | € 3.300        | 3.951                    | 0,05                              |
| <b>KOLUMBIEN</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Ecopetrol S.A.                                       |                |                          |                                   |
| 8,875 % fällig am 13.01.2033                         | \$ 7.900       | 8.155                    | 0,10                              |
| <b>BESCHREIBUNG</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| Colombia Government International Bond               |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 14.11.2035                         | \$ 1.200       | \$ 1.208                 | 0,01                              |
| 8,750 % fällig am 14.11.2053                         | 800            | 795                      | 0,01                              |
|                                                      |                | 2.003                    | 0,02                              |
| Summe Kolumbien                                      |                | 10.158                   | 0,12                              |
| <b>TSCHECHISCHE REPUBLIK</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| EP Infrastructure A/S                                |                |                          |                                   |
| 1,816 % fällig am 02.03.2031                         | € 6.900        | 7.261                    | 0,09                              |
| 2,045 % fällig am 09.10.2028                         | 3.300          | 3.721                    | 0,04                              |
| EPH Financing International A/S                      |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 02.07.2032 (b)                     | 6.300          | 7.450                    | 0,09                              |
| Summe Tschechische Republik                          |                | 18.432                   | 0,22                              |
| <b>DÄNEMARK</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| H Lundbeck A/S                                       |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 02.06.2029                         | 8.000          | 9.439                    | 0,11                              |
| Jyske Realkredit A/S                                 |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                         | DKK 8.261      | 1.057                    | 0,01                              |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                 |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                         | 3.797          | 480                      | 0,01                              |
| Nykredit Realkredit A/S                              |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                         | 89.138         | 10.996                   | 0,13                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053                         | 8.868          | 1.076                    | 0,01                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2052                         | 6.500          | 831                      | 0,01                              |
| 3,625 % fällig am 24.07.2030                         | € 2.400        | 2.868                    | 0,04                              |
| Realkredit Danmark A/S                               |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                         | DKK 28.298     | 3.493                    | 0,04                              |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053                         | 3.643          | 427                      | 0,01                              |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                         | 6.514          | 833                      | 0,01                              |
| Summe Dänemark                                       |                | 31.500                   | 0,38                              |
| <b>FINNLAND</b>                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Balder Finland Oyj                                   |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 20.01.2029                         | € 9.904        | 10.747                   | 0,13                              |
| 2,000 % fällig am 18.01.2031                         | 800            | 856                      | 0,01                              |
| OP Mortgage Bank                                     |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.02.2027                         | 6.000          | 7.187                    | 0,08                              |
| SP-Kiinnitysluottopankki Oyj                         |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 02.05.2031                         | 5.500          | 6.617                    | 0,08                              |
| Summe Finnland                                       |                | 25.407                   | 0,30                              |
| <b>FRANKREICH</b>                                    |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Banque Federative du Credit Mutuel S.A.              |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 25.09.2025                         | £ 1.000        | 1.371                    | 0,02                              |
| BNP Paribas S.A.                                     |                |                          |                                   |
| 2,871 % fällig am 19.04.2032 (j)                     | \$ 10.500      | 9.412                    | 0,11                              |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028                         | 600            | 598                      | 0,01                              |
| 5,786 % fällig am 13.01.2033                         | 17.300         | 18.008                   | 0,22                              |
| BPCE S.A.                                            |                |                          |                                   |
| 1,652 % fällig am 06.10.2026                         | 480            | 476                      | 0,01                              |
| 3,875 % fällig am 11.01.2029                         | € 2.200        | 2.665                    | 0,03                              |
| 5,716 % fällig am 18.01.2030                         | \$ 1.800       | 1.854                    | 0,02                              |
| 5,936 % fällig am 30.05.2035                         | 2.250          | 2.307                    | 0,03                              |
| 6,612 % fällig am 19.10.2027                         | 4.500          | 4.608                    | 0,06                              |
| 6,714 % fällig am 19.10.2029                         | 30.000         | 31.781                   | 0,38                              |
| 7,003 % fällig am 19.10.2034                         | 3.000          | 3.297                    | 0,04                              |
| BPCE SFH S.A.                                        |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 15.01.2031                         | € 4.500        | 5.347                    | 0,06                              |
| 3,000 % fällig am 24.03.2032                         | 2.400          | 2.833                    | 0,03                              |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A.            |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 12.01.2029                         | 1.500          | 1.781                    | 0,02                              |
| 3,000 % fällig am 12.01.2034                         | 5.900          | 6.855                    | 0,08                              |
| CCF Holding S.A.S.                                   |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 27.05.2035                         | 1.700          | 2.002                    | 0,02                              |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.                   |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 12.01.2034                         | 6.900          | 7.963                    | 0,10                              |
| <b>BESCHREIBUNG</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>Credit Agricole S.A.</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,862 % fällig am 09.01.2036                         | \$ 9.600       | \$ 9.956                 | 0,12                              |
| 7,250 % fällig am 23.09.2028 (f)(h)                  | € 5.000        | 6.335                    | 0,08                              |
| Electricite de France S.A.                           |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 07.05.2032                         | 3.000          | 3.487                    | 0,04                              |
| 4,000 % fällig am 07.05.2037                         | 3.000          | 3.509                    | 0,04                              |
| 4,625 % fällig am 25.01.2043                         | 5.400          | 6.296                    | 0,08                              |
| 4,625 % fällig am 07.05.2045                         | 7.100          | 8.166                    | 0,10                              |
| 5,625 % fällig am 25.01.2053                         | £ 5.300        | 6.179                    | 0,07                              |
| 6,900 % fällig am 23.05.2053                         | \$ 8.400       | 8.974                    | 0,11                              |
| 9,125 % fällig am 15.03.2033 (f)                     | 1.700          | 1.922                    | 0,02                              |
| ELO SACA                                             |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 08.12.2028                         | € 4.000        | 4.266                    | 0,05                              |
| New Immo Holding S.A.                                |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026                         | 8.500          | 9.844                    | 0,12                              |
| Peugeot Invest S.A.                                  |                |                          |                                   |
| 1,875 % fällig am 30.10.2026                         | 18.300         | 21.167                   | 0,25                              |
| Societe Generale SFH S.A.                            |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 31.07.2026                         | 9.000          | 10.740                   | 0,13                              |
| TDF Infrastructure SASU                              |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 01.12.2029                         | 500            | 552                      | 0,01                              |
| Thales S.A.                                          |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 14.06.2029                         | 8.100          | 9.838                    | 0,12                              |
| 4,250 % fällig am 18.10.2031                         | 6.500          | 8.118                    | 0,10                              |
| Ubisoft Entertainment S.A.                           |                |                          |                                   |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027                         | 18.400         | 19.493                   | 0,23                              |
|                                                      |                | 242.000                  | 2,91                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale           |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 25.11.2031                         | 4.300          | 5.098                    | 0,06                              |
| Summe Frankreich                                     |                | 247.098                  | 2,97                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Amprion GmbH                                         |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 05.12.2029                         | 1.700          | 2.000                    | 0,02                              |
| Cheplapharm Arzneimittel GmbH                        |                |                          |                                   |
| 7,125 % fällig am 15.06.2031 (b)                     | 6.450          | 7.631                    | 0,09                              |
| Commerzbank AG                                       |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 25.02.2028                         | 7.000          | 8.276                    | 0,10                              |
| 6,125 % fällig am 09.10.2025 (f)(h)                  | 7.600          | 8.999                    | 0,11                              |
| 6,625 % fällig am 09.10.2032 (f)(h)                  | 600            | 718                      | 0,01                              |
| Deutsche Bank AG                                     |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030                         | 8.200          | 9.034                    | 0,11                              |
| 5,000 % fällig am 05.09.2030                         | 9.800          | 12.279                   | 0,15                              |
| 6,125 % fällig am 12.12.2030                         | £ 4.500        | 6.428                    | 0,08                              |
| DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 21.08.2030                         | € 5.500        | 6.565                    | 0,08                              |
| Fresenius Medical Care AG                            |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 08.12.2028                         | 500            | 593                      | 0,01                              |
| Schaeffler AG                                        |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 01.04.2028                         | 1.000          | 1.183                    | 0,01                              |
| Volkswagen Bank GmbH                                 |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 03.05.2031                         | 5.300          | 6.541                    | 0,08                              |
| Volkswagen Financial Services AG                     |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 19.05.2027                         | 10.200         | 12.108                   | 0,14                              |
| Volkswagen Leasing GmbH                              |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 19.06.2026                         | 200            | 233                      | 0,00                              |
| Summe Deutschland                                    |                | 82.588                   | 0,99                              |
| <b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   |
| Amdocs Ltd.                                          |                |                          |                                   |
| 2,538 % fällig am 15.06.2030                         | \$ 5.875       | 5.325                    | 0,06                              |
| Globalworth Real Estate Investments Ltd.             |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 31.03.2030                         | € 7.495        | 8.959                    | 0,11                              |
| Sirius Real Estate Ltd.                              |                |                          |                                   |
| 1,125 % fällig am 22.06.2026                         | 6.300          | 7.261                    | 0,09                              |
| 1,750 % fällig am 24.11.2028                         | 11.000         | 12.244                   | 0,15                              |
| 4,000 % fällig am 22.01.2032                         | 5.900          | 6.870                    | 0,08                              |
| Summe Guernsey, Kanalinseln                          |                | 40.659                   | 0,49                              |

| BESCHREIBUNG                          | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>UNGARN</b>                         |             |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>               |             |                          |                                   |
| Hungary Government International Bond |             |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 16.06.2034          | 5.600       | \$ 6.635                 | 0,08                              |
| Magyar Export-Import Bank             |             |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 27.11.2031          | 2.800       | 3.343                    | 0,04                              |
| MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt       |             |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 29.06.2028          | \$ 4.000    | 4.148                    | 0,05                              |
| Summe Ungarn                          |             | 14.126                   | 0,17                              |

|                                         |        |        |      |
|-----------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>INDIEN</b>                           |        |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |        |        |      |
| Adani Transmission Step-One Ltd.        |        |        |      |
| 4,250 % fällig am 21.05.2036            | 14.387 | 12.259 | 0,14 |
| IRB Infrastructure Developers Ltd.      |        |        |      |
| 7,110 % fällig am 11.03.2032            | 11.450 | 11.492 | 0,14 |
| Summe Indien                            |        | 23.751 | 0,28 |

|                                                           |       |       |      |
|-----------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>INDONESIEN</b>                                         |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                   |       |       |      |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara |       |       |      |
| 4,000 % fällig am 30.06.2050                              | 7.800 | 5.499 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 15.05.2027                              | 1.400 | 1.387 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 17.07.2049                              | 700   | 570   | 0,01 |
| 6,150 % fällig am 21.05.2048                              | 2.300 | 2.242 | 0,03 |
|                                                           |       | 9.698 | 0,12 |

|                                    |       |        |      |
|------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>            |       |        |      |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia |       |        |      |
| 2,800 % fällig am 23.06.2030       | 6.600 | 6.123  | 0,07 |
| 4,450 % fällig am 20.02.2029       | 600   | 605    | 0,01 |
|                                    |       | 6.728  | 0,08 |
| Summe Indonesien                   |       | 16.426 | 0,20 |

|                                         |         |        |      |
|-----------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>IRLAND</b>                           |         |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |        |      |
| AerCap Ireland Capital DAC              |         |        |      |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026            | 21.120  | 20.583 | 0,24 |
| 3,000 % fällig am 29.10.2028            | 500     | 476    | 0,01 |
| CRH SMW Finance DAC                     |         |        |      |
| 5,125 % fällig am 09.01.2030            | 3.100   | 3.180  | 0,04 |
| Zurich Finance Ireland DAC              |         |        |      |
| 5,125 % fällig am 23.11.2052            | £ 3.600 | 4.844  | 0,06 |
|                                         |         | 29.083 | 0,35 |

|                                           |         |        |      |
|-------------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |         |        |      |
| Republic of Panama                        |         |        |      |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027              | € 9.500 | 11.232 | 0,13 |
| Summe Irland                              |         | 40.315 | 0,48 |

|                                         |          |        |      |
|-----------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>INSEL MAN</b>                        |          |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |        |      |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC          |          |        |      |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028            | \$ 5.300 | 5.062  | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 01.10.2030            | 7.800    | 7.282  | 0,09 |
| Summe Insel Man                         |          | 12.344 | 0,15 |

|                                      |           |        |      |
|--------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>ISRAEL</b>                        |           |        |      |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>              |           |        |      |
| Israel Government International Bond |           |        |      |
| 5,000 % fällig am 30.10.2026         | € 8.500   | 10.260 | 0,12 |
| 5,375 % fällig am 12.03.2029         | \$ 21.700 | 22.161 | 0,27 |
| 5,500 % fällig am 12.03.2034         | 1.800     | 1.825  | 0,02 |
| Summe Israel                         |           | 34.246 | 0,41 |

|                                         |         |       |      |
|-----------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>ITALIEN</b>                          |         |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |       |      |
| AMCO - Asset Management Co. SpA         |         |       |      |
| 4,625 % fällig am 06.02.2027            | € 4.609 | 5.605 | 0,07 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA     |         |       |      |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026            | 3.749   | 4.384 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 05.09.2027            | 6.600   | 8.096 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG                                       | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Banco BPM SpA</b>                               |             |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 28.05.2031                       | € 6.500     | \$ 7.783                 | 0,09                              |
| <b>BPER Banca SpA</b>                              |             |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 22.01.2031                       | 1.100       | 1.317                    | 0,01                              |
| <b>Eni SpA</b>                                     |             |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 15.05.2034                       | \$ 9.700    | 9.779                    | 0,12                              |
| <b>Intesa Sanpaolo SpA</b>                         |             |                          |                                   |
| 4,950 % fällig am 01.06.2042                       | 4.100       | 3.318                    | 0,04                              |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026                       | 14.506      | 14.540                   | 0,17                              |
| 6,625 % fällig am 20.06.2033                       | 400         | 435                      | 0,01                              |
| 7,200 % fällig am 28.11.2033                       | 2.700       | 3.033                    | 0,04                              |
| 7,700 % fällig am 17.09.2025 (f)(h)                | 2.200       | 2.210                    | 0,03                              |
| 7,778 % fällig am 20.06.2054                       | 6.300       | 7.074                    | 0,08                              |
| 7,800 % fällig am 28.11.2053                       | 10.500      | 12.289                   | 0,15                              |
| 8,248 % fällig am 21.11.2033                       | 5.500       | 6.387                    | 0,08                              |
| 9,125 % fällig am 07.09.2029 (f)(h)                | € 4.700     | 6.404                    | 0,08                              |
| <b>Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA</b> |             |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 30.11.2028                       | 2.000       | 2.402                    | 0,03                              |
| <b>Nexi SpA</b>                                    |             |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 21.05.2031                       | 5.200       | 6.158                    | 0,07                              |
| <b>Snam SpA</b>                                    |             |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 28.05.2030                       | \$ 2.800    | 2.825                    | 0,03                              |
| <b>UniCredit SpA</b>                               |             |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h)                | € 3.000     | 3.660                    | 0,04                              |
|                                                    |             | 107.699                  | 1,29                              |

|                               |          |         |      |
|-------------------------------|----------|---------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>       |          |         |      |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA |          |         |      |
| 5,875 % fällig am 30.04.2029  | \$ 5.400 | 5.653   | 0,07 |
| Summe Italien                 |          | 113.352 | 1,36 |

|                                         |          |         |      |
|-----------------------------------------|----------|---------|------|
| <b>JAPAN</b>                            |          |         |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |         |      |
| Meiji Yasuda Life Insurance Co.         |          |         |      |
| 6,100 % fällig am 11.06.2055            | 7.400    | 7.404   | 0,09 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.    |          |         |      |
| 1,538 % fällig am 20.07.2027            | 5.300    | 5.144   | 0,06 |
| 2,048 % fällig am 17.07.2030            | 15.400   | 13.682  | 0,16 |
| 3,195 % fällig am 18.07.2029            | 3.600    | 3.436   | 0,04 |
| 5,422 % fällig am 22.02.2029            | 2.700    | 2.771   | 0,03 |
| Mizuho Financial Group, Inc.            |          |         |      |
| 1,979 % fällig am 08.09.2031            | 2.400    | 2.101   | 0,03 |
| 2,201 % fällig am 10.07.2031            | 6.100    | 5.434   | 0,07 |
| 5,594 % fällig am 10.07.2035            | 1.100    | 1.133   | 0,01 |
| Nippon Life Insurance Co.               |          |         |      |
| 6,250 % fällig am 13.09.2053            | 4.300    | 4.427   | 0,05 |
| Nissan Motor Co. Ltd.                   |          |         |      |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027            | 6.457    | 6.203   | 0,08 |
| Nomura Holdings, Inc.                   |          |         |      |
| 1,851 % fällig am 16.07.2025            | 11.950   | 11.935  | 0,14 |
| 2,710 % fällig am 22.01.2029            | 7.300    | 6.845   | 0,08 |
| 5,591 % fällig am 02.07.2027            | 4.000    | 4.029   | 0,05 |
| 5,842 % fällig am 18.01.2028            | 4.000    | 4.126   | 0,05 |
| 7,000 % fällig am 15.07.2030 (b)(f)(h)  | 5.200    | 5.273   | 0,06 |
| Norinchukin Bank                        |          |         |      |
| 5,094 % fällig am 16.10.2029            | 2.000    | 2.030   | 0,03 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp.           |          |         |      |
| 0,010 % fällig am 10.09.2025            | € 1.000  | 1.169   | 0,01 |
| 2,737 % fällig am 18.02.2030            | 6.200    | 7.281   | 0,09 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.   |          |         |      |
| 2,130 % fällig am 08.07.2030            | \$ 3.500 | 3.129   | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2030            | 2.018    | 1.875   | 0,02 |
| 3,040 % fällig am 16.07.2029            | 1.000    | 948     | 0,01 |
| 5,520 % fällig am 13.01.2028            | 2.000    | 2.060   | 0,03 |
| 5,632 % fällig am 15.01.2035 (j)        | 3.400    | 3.520   | 0,04 |
| 5,710 % fällig am 13.01.2030            | 3.000    | 3.149   | 0,04 |
|                                         |          | 109.104 | 1,31 |

|                                     |             |         |      |
|-------------------------------------|-------------|---------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>             |             |         |      |
| Japan Government International Bond |             |         |      |
| 2,000 % fällig am 20.12.2044        | ¥ 3.840.000 | 25.173  | 0,30 |
| 2,200 % fällig am 20.03.2064        | 1.601.000   | 8.913   | 0,11 |
| 2,400 % fällig am 20.03.2045        | 2.968.800   | 20.692  | 0,25 |
| 2,400 % fällig am 20.03.2055        | 270.000     | 1.717   | 0,02 |
|                                     |             | 56.495  | 0,68 |
| Summe Japan                         |             | 165.599 | 1,99 |

| BESCHREIBUNG                            | PARI (000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>JERSEY, KANALINSELN</b>              |             |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |             |                          |                                   |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.            |             |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 22.04.2035 (b)        | \$ 4.300    | \$ 4.300                 | 0,05                              |
| 0,000 % fällig am 15.07.2035 (b)        | 2.700       | 2.702                    | 0,03                              |
| 5,269 % fällig am 23.04.2035            | 5.000       | 4.985                    | 0,06                              |
|                                         |             | 11.987                   | 0,14                              |

|                                         |         |        |      |
|-----------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |         |        |      |
| Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd.       |         |        |      |
| 2,625 % fällig am 31.03.2036            | 4.000   | 3.406  | 0,04 |
| Gatwick Funding Ltd.                    |         |        |      |
| 2,625 % fällig am 07.10.2048            | £ 1.400 | 1.127  | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 28.09.2041            | 1.600   | 1.613  | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 16.10.2035            | € 5.100 | 5.960  | 0,07 |
| 3,875 % fällig am 24.06.2035            | 7.500   | 8.742  | 0,11 |
| Heathrow Funding Ltd.                   |         |        |      |
| 1,875 % fällig am 12.07.2032            | 3.800   | 4.020  | 0,05 |
| 2,750 % fällig am 13.10.2031            | £ 1.200 | 1.518  | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 11.07.2035            | € 3.400 | 4.221  | 0,05 |
| Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.  |         |        |      |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025            | 695     | 810    | 0,01 |
|                                         |         | 31.417 | 0,38 |
| Summe Jersey, Kanalinseln               |         | 43.404 | 0,52 |

|                                         |          |       |      |
|-----------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>KASACHSTAN</b>                       |          |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |       |      |
| KazMunayGas National Co. JSC            |          |       |      |
| 3,500 % fällig am 14.04.2033            | \$ 4.000 | 3.475 | 0,04 |

|                                         |       |        |      |
|-----------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>LIBERIA</b>                          |       |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |       |        |      |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.            |       |        |      |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028            | 7.400 | 7.211  | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 31.08.2026            | 3.000 | 3.013  | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 01.04.2028            | 7.600 | 7.699  | 0,09 |
| Summe Liberia                           |       | 17.923 | 0,22 |

|                                                                                |           |        |      |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>LUXEMBURG</b>                                                               |           |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                        |           |        |      |
| Becton Dickinson Euro Finance SARL                                             |           |        |      |
| 0,334 % fällig am 13.08.2028                                                   | € 1.847   | 2.025  | 0,02 |
| CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-SIF-Pan European Core Fund |           |        |      |
| 4,750 % fällig am 27.03.2034                                                   | 3.800     | 4.659  | 0,06 |
| Greensaf Pipelines Bidco SARL                                                  |           |        |      |
| 5,853 % fällig am 23.02.2036                                                   | \$ 8.700  | 8.807  | 0,11 |
| Logicor Financing SARL                                                         |           |        |      |
| 1,625 % fällig am 15.07.2027                                                   | € 17.701  | 20.278 | 0,24 |
| P3 Group SARL                                                                  |           |        |      |
| 1,625 % fällig am 26.01.2029                                                   | 3.700     | 4.098  | 0,05 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.                                         |           |        |      |
| 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^                                                 | \$ 61.150 | 3.669  | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 23.05.2023 ^ (h)                                             | 12.200    | 732    | 0,01 |
| Stoneweg Ereit Lux Finco SARL                                                  |           |        |      |
| 4,250 % fällig am 30.01.2031                                                   | € 200     | 237    | 0,00 |
| TMS Issuer SARL                                                                |           |        |      |
| 5,780 % fällig am 23.08.2032                                                   | \$ 7.000  | 7.235  | 0,09 |
| Summe Luxemburg                                                                |           | 51.740 | 0,62 |

|                                         |         |   |      |
|-----------------------------------------|---------|---|------|
| <b>AKTIEN</b>                           |         |   |      |
| <b>MEXIKO</b>                           |         |   |      |
| <b>STAMMAKTIE</b>                       |         |   |      |
| Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (c) | 427.064 | 0 | 0,00 |

|                                         |          |        |      |
|-----------------------------------------|----------|--------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |          |        |      |
| Banco Mercantil del Norte S.A.          |          |        |      |
| 6,625 % fällig am 24.01.2032 (f)(h)     | \$ 9.400 | 8.728  | 0,10 |
| BBVA Bancomer S.A.                      |          |        |      |
| 5,875 % fällig am 13.09.2034 (h)        | 8.000    | 7.867  | 0,09 |
| 7,625 % fällig am 11.02.2035 (h)        | 13.200   | 13.587 | 0,16 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Petroleos Mexicanos</b>                    |                |                          |                                   | <b>Wintershall Dea Finance BV</b>                   |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027                  | € 4.100        | \$ 4.593                 | 0,06                              | 1,823 % fällig am 25.09.2031                        | € 5.000        | \$ 5.170                 | 0,06                              |
| <b>Trust Fibra Uno</b>                        |                |                          |                                   | 3,830 % fällig am 03.10.2029                        | 2.500          | 2.969                    | 0,04                              |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030                  | \$ 1.500       | 1.426                    | 0,02                              | 4,357 % fällig am 03.10.2032                        | 3.997          | 4.706                    | 0,06                              |
| 7,375 % fällig am 13.02.2034                  | 7.200          | 7.337                    | 0,09                              |                                                     |                | 185.375                  | 2,23                              |
|                                               |                | 43.538                   | 0,52                              |                                                     |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>Mexico Government International Bond</b>   |                |                          |                                   | <b>EMF-NL Prime BV</b>                              |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am                             |                |                          |                                   | 3,063 % fällig am 17.04.2041                        | 111            | 130                      | 0,00                              |
| 27.11.2031 (e)                                | MXN 295.064    | 13.842                   | 0,17                              | <b>Green Lion BV</b>                                |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 03.12.2026 (e)              | 171.972        | 8.916                    | 0,11                              | 2,603 % fällig am 23.10.2060                        | 3.600          | 4.217                    | 0,05                              |
| 4,000 % fällig am 30.11.2028 (e)              | 291.537        | 15.130                   | 0,18                              |                                                     |                | 4.347                    | 0,05                              |
| 6,350 % fällig am 09.02.2035                  | \$ 10.000      | 10.256                   | 0,12                              |                                                     |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 13.05.2037                  | 3.000          | 3.136                    | 0,04                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
|                                               |                | 51.280                   | 0,62                              | <b>BNG Bank NV</b>                                  |                |                          |                                   |
| Summe Mexiko                                  |                | 94.818                   | 1,14                              | 2,375 % fällig am 16.03.2026                        | \$ 9.200       | 9.088                    | 0,11                              |
|                                               |                |                          |                                   | Summe Niederlande                                   |                | 198.810                  | 2,39                              |
| <b>MULTINATIONAL</b>                          |                |                          |                                   | <b>NORWEGEN</b>                                     |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                                   |
| <b>Delta Air Lines, Inc.</b>                  |                |                          |                                   | <b>Moere Boligkreditt A/S</b>                       |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 20.10.2028                  | 3.125          | 3.134                    | 0,04                              | 2,625 % fällig am 25.09.2029                        | € 5.000        | 5.883                    | 0,07                              |
| <b>JetBlue Airways Corp.</b>                  |                |                          |                                   | <b>Sparebanken Vest Boligkreditt A/S</b>            |                |                          |                                   |
| 9,875 % fällig am 20.09.2031                  | 6.400          | 6.231                    | 0,07                              | 3,375 % fällig am 15.11.2028                        | 2.000          | 2.424                    | 0,03                              |
| Summe multinational                           |                | 9.365                    | 0,11                              | <b>SR-Boligkreditt A/S</b>                          |                |                          |                                   |
|                                               |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 19.02.2032                        | 5.700          | 6.811                    | 0,08                              |
| <b>NIEDERLANDE</b>                            |                |                          |                                   | <b>Var Energi ASA</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 04.05.2029                        | 6.100          | 7.688                    | 0,09                              |
| <b>ABN AMRO Bank NV</b>                       |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 15.11.2032                        | \$ 9.600       | 10.891                   | 0,13                              |
| 4,375 % fällig am                             |                |                          |                                   | Summe Norwegen                                      |                | 33.697                   | 0,40                              |
| 22.09.2025 (f)(h)                             | € 6.000        | 7.062                    | 0,08                              |                                                     |                |                          |                                   |
| <b>Achmea Bank NV</b>                         |                |                          |                                   | <b>PANAMA</b>                                       |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 19.10.2026                  | 5.500          | 6.593                    | 0,08                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                                   |
| <b>American Medical Systems Europe BV</b>     |                |                          |                                   | <b>Carnival Corp.</b>                               |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 08.03.2034                  | 13.800         | 16.012                   | 0,19                              | 4,000 % fällig am 01.08.2028                        | 11.855         | 11.611                   | 0,14                              |
| <b>ASR Nederland NV</b>                       |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.03.2030 (j)                    | 2.700          | 2.747                    | 0,03                              |
| 7,000 % fällig am 07.12.2043                  | 2.600          | 3.569                    | 0,04                              |                                                     |                | 14.358                   | 0,17                              |
| <b>Cooperatieve Rabobank UA</b>               |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 29.06.2027 (f)(h)           | 19.000         | 22.270                   | 0,27                              | <b>Panama Government International Bond</b>         |                |                          |                                   |
| <b>Digital Dutch Finco BV</b>                 |                |                          |                                   | 6,400 % fällig am 14.02.2035                        | 5.000          | 4.880                    | 0,06                              |
| 1,500 % fällig am 15.03.2030                  | 100            | 109                      | 0,00                              | 7,500 % fällig am 01.03.2031                        | 5.000          | 5.333                    | 0,06                              |
| 3,875 % fällig am 15.07.2034                  | 4.800          | 5.568                    | 0,07                              |                                                     |                | 10.213                   | 0,12                              |
| <b>EnBW International Finance BV</b>          |                |                          |                                   | Summe Panama                                        |                | 24.571                   | 0,29                              |
| 5,302 % fällig am 30.10.2029                  | AUD 6.500      | 4.416                    | 0,05                              |                                                     |                |                          |                                   |
| <b>Enel Finance International NV</b>          |                |                          |                                   | <b>PERU</b>                                         |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 06.04.2028                  | \$ 1.050       | 1.024                    | 0,01                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                                   |
| <b>IMCD NV</b>                                |                |                          |                                   | <b>Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.</b> |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 30.04.2030                  | € 3.200        | 3.799                    | 0,04                              | 10,100 % fällig am                                  |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 18.09.2028                  | 4.600          | 5.697                    | 0,07                              | 15.12.2043                                          | PEN 4.000      | 1.198                    | 0,01                              |
| <b>Imperial Brands Finance Netherlands BV</b> |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 15.02.2031                  | 10.200         | 12.968                   | 0,16                              | <b>Peru Government International Bond</b>           |                |                          |                                   |
| <b>ING Groep NV</b>                           |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 12.08.2032                        | 55.724         | 16.244                   | 0,19                              |
| 5,525 % fällig am 25.03.2036                  | \$ 1.000       | 1.018                    | 0,01                              | 6,950 % fällig am 12.08.2031                        | 23.501         | 7.201                    | 0,09                              |
| <b>JAB Holdings BV</b>                        |                |                          |                                   | 7,300 % fällig am 12.08.2033                        | 164.200        | 50.493                   | 0,61                              |
| 2,200 % fällig am 23.11.2030                  | 7.420          | 6.403                    | 0,08                              |                                                     |                | 73.938                   | 0,89                              |
| 3,750 % fällig am 28.05.2051                  | 9.400          | 6.213                    | 0,07                              | Summe Peru                                          |                | 75.136                   | 0,90                              |
| 5,000 % fällig am 12.06.2033                  | € 1.700        | 2.129                    | 0,03                              |                                                     |                |                          |                                   |
| <b>JDE Peet's NV</b>                          |                |                          |                                   | <b>POLEN</b>                                        |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 23.01.2030 (j)              | 6.800          | 8.313                    | 0,10                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 23.01.2034                  | 16.200         | 19.916                   | 0,24                              | <b>Synthos S.A.</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Lseg Netherlands BV</b>                    |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 07.06.2028 (j)                    | € 3.500        | 3.883                    | 0,05                              |
| 4,231 % fällig am 29.09.2030                  | 5.400          | 6.694                    | 0,08                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>REWE International Finance BV</b>          |                |                          |                                   | <b>Poland Government International Bond</b>         |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 03.07.2032 (b)              | 1.900          | 2.220                    | 0,03                              | 3,875 % fällig am 14.02.2033                        | 7.300          | 8.988                    | 0,11                              |
| <b>Sagax Euro MTN NL BV</b>                   |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 14.02.2043                        | 2.300          | 2.709                    | 0,03                              |
| 1,625 % fällig am 24.02.2026                  | 3.900          | 4.547                    | 0,05                              | 5,125 % fällig am 18.09.2034                        | \$ 4.000       | 4.025                    | 0,05                              |
| <b>Sandoz Finance BV</b>                      |                |                          |                                   |                                                     |                | 15.722                   | 0,19                              |
| 3,250 % fällig am 12.09.2029                  | 3.500          | 4.168                    | 0,05                              | Summe Polen                                         |                | 19.605                   | 0,24                              |
| 3,970 % fällig am 17.04.2027                  | 1.900          | 2.284                    | 0,03                              |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,220 % fällig am 17.04.2030                  | 8.600          | 10.631                   | 0,13                              |                                                     |                |                          |                                   |
| <b>Universal Music Group NV</b>               |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 30.06.2032                  | 3.500          | 4.215                    | 0,05                              |                                                     |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 13.06.2031                  | 2.700          | 3.308                    | 0,04                              |                                                     |                |                          |                                   |
| <b>Volkswagen Financial Services NV</b>       |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 07.12.2026                  | £ 1.000        | 1.384                    | 0,02                              |                                                     |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>PORTUGAL</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| <b>Banco BPI S.A.</b>                   |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 22.03.2030            | € 1.900        | \$ 2.278                 | 0,03                              |
| <b>Banco Santander Totta S.A.</b>       |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 15.02.2031            | 1.100          | 1.327                    | 0,01                              |
| 3,750 % fällig am 11.09.2026            | 13.200         | 15.813                   | 0,19                              |
| Summe Portugal                          |                | 19.418                   | 0,23                              |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>KATAR</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   |
| <b>QatarEnergy</b>                         |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 12.07.2031               | \$ 4.000       | 3.509                    | 0,04                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   |
| <b>Qatar Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 4,400 % fällig am 16.04.2050               | 11.100         | 9.399                    | 0,11                              |
| Summe Katar                                |                | 12.908                   | 0,15                              |

| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>RUMÄNIEN</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Romania Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 1,375 % fällig am 02.12.2029                 | € 2.984        | 3.068                    | 0,04                              |
| 1,750 % fällig am 13.07.2030                 | 7.650          | 7.723                    | 0,09                              |
| 2,125 % fällig am 07.03.2028                 | 7.200          | 8.151                    | 0,10                              |
| 2,625 % fällig am 02.12.2040                 | 22.600         | 16.538                   | 0,20                              |
| 2,875 % fällig am 13.04.2042                 | 8.200          | 6.005                    | 0,07                              |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030                 | 3.900          | 4.680                    | 0,05                              |
| 5,250 % fällig am 30.05.2032                 | 7.400          | 8.560                    | 0,10                              |
| 5,375 % fällig am 22.03.2031                 | 2.670          | 3.148                    | 0,04                              |
| 5,625 % fällig am 22.02.2036                 | 1.300          | 1.454                    | 0,02                              |
| 5,625 % fällig am 30.05.2037                 | 2.300          | 2.545                    | 0,03                              |
| Summe Rumänien                               |                | 61.872                   | 0,74                              |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>RUSSLAND</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| <b>MMK International Capital DAC</b>    |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 13.06.2024^                             | \$ 4.900       | 294                      | 0,00                              |
| <b>SAUDI-ARABIE</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   |
| <b>Saudi Arabian Oil Co.</b>            |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 17.07.2034            | 1.300          | 1.315                    | 0,02                              |
| 5,750 % fällig am 17.07.2054            | 800            | 752                      | 0,01                              |
| 5,875 % fällig am 17.07.2064            | 1.000          | 915                      | 0,01                              |
|                                         |                | 2.982                    | 0,04                              |

| BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Saudi Arabia Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 02.02.2033                      | 18.705         | 15.714                   | 0,19                              |
| 4,750 % fällig am 18.01.2028                      | 52.000         | 52.439                   | 0,63                              |
| 4,875 % fällig am 18.07.2033                      | 7.300          | 7.336                    | 0,09                              |
| 5,000 % fällig am 18.01.2053                      | 6.000          | 5.122                    | 0,06                              |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031                      | 6.000          | 6.227                    | 0,07                              |
|                                                   |                | 86.838                   | 1,04                              |
| Summe Saudi-Arabien                               |                | 89.820                   | 1,08                              |

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SINGAPUR</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   |
| <b>Cathaylife Singapore Pte Ltd.</b>      |                |                          |                                   |
| 5,950 % fällig am 05.07.2034              | 5.100          | 5.249                    | 0,06                              |
| <b>DBS Bank Ltd.</b>                      |                |                          |                                   |
| 3,209 % fällig am 19.08.2026              | € 2.500        | 2.974                    | 0,04                              |
| <b>Maybank Singapore Ltd.</b>             |                |                          |                                   |
| 3,439 % fällig am 07.06.2027              | 4.000          | 4.810                    | 0,06                              |
| <b>Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.</b> |                |                          |                                   |
| 1,832 % fällig am                         |                |                          |                                   |
| 10.09.2030 (h)                            | \$ 13.300      | 13.233                   | 0,16                              |
| Summe Singapur                            |                | 26.266                   | 0,32                              |

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SLOWAKEI</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Slovakia Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 1,875 % fällig am 09.03.2037                  | € 500          | 491                      | 0,01                              |

|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

|                                                      |    |        |             | MARKT- NETTO- % DES |                                       |    |        |             |                    |                                    |    | MARKT- NETTO- % DES |             |                    |  |
|------------------------------------------------------|----|--------|-------------|---------------------|---------------------------------------|----|--------|-------------|--------------------|------------------------------------|----|---------------------|-------------|--------------------|--|
| BESCHREIBUNG                                         |    | PARI   | MARKT- WERT | NETTO- VERMÖ- GENS  | BESCHREIBUNG                          |    | PARI   | MARKT- WERT | NETTO- VERMÖ- GENS | BESCHREIBUNG                       |    | PARI                | MARKT- WERT | NETTO- VERMÖ- GENS |  |
|                                                      |    | (000S) | (000S)      |                     |                                       |    | (000S) | (000S)      |                    |                                    |    | (000S)              | (000S)      |                    |  |
| 5,500 % fällig am 28.04.2035                         | £  | 3.800  | \$ 4.993    | 0,06                | AES Corp.                             |    |        |             |                    | AT&T, Inc.                         |    |                     |             |                    |  |
| 6,375 % fällig am 18.11.2034                         |    | 5.450  | 7.720       | 0,09                | 1,375 % fällig am 15.01.2026          | \$ | 400    | \$ 392      | 0,00               | 3,550 % fällig am 15.09.2055 (j)   | \$ | 2.171               | \$ 1.466    | 0,02               |  |
|                                                      |    |        | 488.417     | 5,86                | 2,450 % fällig am 15.01.2031          |    | 6.500  | 5.686       | 0,07               | 3,650 % fällig am 15.09.2059       |    | 11.243              | 7.549       | 0,09               |  |
| KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG                   |    |        |             |                     | 3,950 % fällig am 15.07.2030          |    | 1.589  | 1.512       | 0,02               | Athene Global Funding              |    |                     |             |                    |  |
| Project Alfa                                         |    |        |             |                     | 5,450 % fällig am 01.06.2028          |    | 4.468  | 4.567       | 0,05               | 3,410 % fällig am 25.02.2030       | €  | 2.000               | 2.360       | 0,03               |  |
| 4,256 % fällig am 27.02.2026 (i)                     | €  | 1.890  | 2.218       | 0,03                | 6,950 % fällig am 15.07.2055          |    | 4.100  | 4.010       | 0,05               | 5,516 % fällig am 25.03.2027       | \$ | 16.000              | 16.273      | 0,20               |  |
| NON-AGENCY-MBS                                       |    |        |             |                     | 7,600 % fällig am 15.01.2055          |    | 4.525  | 4.670       | 0,06               | 5,526 % fällig am 11.07.2031       |    | 3.000               | 3.067       | 0,04               |  |
| Canary Wharf Finance PLC                             |    |        |             |                     | Alaska Airlines Pass-Through Trust    |    |        |             |                    | 5,583 % fällig am 09.01.2029       |    | 6.750               | 6.941       | 0,08               |  |
| 5,952 % fällig am 22.10.2037                         | £  | 29     | 41          | 0,00                | 4,800 % fällig am 15.02.2029          |    | 6.246  | 6.256       | 0,08               | Aviation Capital Group LLC         |    |                     |             |                    |  |
| Newgate Funding PLC                                  |    |        |             |                     | Alexandria Real Estate Equities, Inc. |    |        |             |                    | 3,500 % fällig am 01.11.2027       |    | 8.030               | 7.828       | 0,09               |  |
| 4,517 % fällig am 01.12.2050                         |    | 77     | 104         | 0,00                | 5,500 % fällig am 01.10.2035          |    | 2.300  | 2.327       | 0,03               | 5,375 % fällig am 15.07.2029       |    | 17.400              | 17.729      | 0,21               |  |
| RMAC PLC                                             |    |        |             |                     | Ally Financial, Inc.                  |    |        |             |                    | Bank of America Corp.              |    |                     |             |                    |  |
| 5,437 % fällig am 15.02.2047                         |    | 12.421 | 17.083      | 0,21                | 6,992 % fällig am 13.06.2029          |    | 6.000  | 6.318       | 0,08               | 1,898 % fällig am 23.07.2031       |    | 4.200               | 3.691       | 0,04               |  |
|                                                      |    |        | 17.228      | 0,21                | 8,000 % fällig am 01.11.2031          |    | 6.700  | 7.632       | 0,09               | 2,551 % fällig am 04.02.2028       |    | 20.100              | 19.541      | 0,23               |  |
| STAATSEMISSIONEN                                     |    |        |             |                     | American Airlines Pass-Through Trust  |    |        |             |                    | 2,592 % fällig am 29.04.2031       |    | 12.500              | 11.431      | 0,14               |  |
| United Kingdom Gilt                                  |    |        |             |                     | 3,000 % fällig am 15.04.2030          |    | 1.793  | 1.699       | 0,02               | 2,651 % fällig am 11.03.2032       |    | 10.000              | 8.979       | 0,11               |  |
| 4,375 % fällig am 31.07.2054                         |    | 44.848 | 53.271      | 0,64                | 3,150 % fällig am 15.08.2033          |    | 6.037  | 5.558       | 0,07               | 2,687 % fällig am 22.04.2032       |    | 1.710               | 1.535       | 0,02               |  |
| Summe Großbritannien                                 |    |        | 561.134     | 6,74                | 3,200 % fällig am 15.12.2029          |    | 8.121  | 7.795       | 0,09               | 3,261 % fällig am 28.01.2031       | €  | 5.600               | 6.624       | 0,08               |  |
| USA                                                  |    |        |             |                     | 3,250 % fällig am 15.04.2030          |    | 1.345  | 1.263       | 0,02               | 3,824 % fällig am 20.01.2028       | \$ | 5.300               | 5.255       | 0,06               |  |
| FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                     |    |        |             |                     | 3,350 % fällig am 15.04.2031          |    | 6.460  | 6.157       | 0,07               | 4,271 % fällig am 23.07.2029       |    | 2.300               | 2.293       | 0,03               |  |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust          |    |        |             |                     | 3,375 % fällig am 01.11.2028          |    | 6.963  | 6.792       | 0,08               | 5,015 % fällig am 22.07.2033       |    | 1.000               | 1.012       | 0,01               |  |
| 5,334 % fällig am 25.12.2034                         | \$ | 851    | 770         | 0,01                | 3,500 % fällig am 15.08.2033          |    | 10.020 | 9.073       | 0,11               | 5,288 % fällig am 25.04.2034       |    | 14.600              | 14.898      | 0,18               |  |
| 5,379 % fällig am 25.05.2035                         |    | 1.900  | 1.747       | 0,02                | 3,575 % fällig am 15.07.2029          |    | 1.727  | 1.675       | 0,02               | 5,511 % fällig am 24.01.2036       |    | 3.000               | 3.086       | 0,04               |  |
| Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage         |    |        |             |                     | 3,600 % fällig am 22.03.2029          |    | 803    | 782         | 0,01               | 5,819 % fällig am 15.09.2029       |    | 7.200               | 7.502       | 0,09               |  |
| Pass-Through Certificates                            |    |        |             |                     | 3,600 % fällig am 15.04.2031          |    | 3.851  | 3.560       | 0,04               | 5,872 % fällig am 15.09.2034       |    | 1.250               | 1.320       | 0,02               |  |
| 4,774 % fällig am 25.01.2037                         |    | 3.277  | 2.457       | 0,03                | 3,650 % fällig am 15.08.2030          |    | 1.180  | 1.142       | 0,01               | 5,933 % fällig am 15.09.2027       |    | 2.700               | 2.748       | 0,03               |  |
| BDS LLC                                              |    |        |             |                     | 4,100 % fällig am 15.07.2029          |    | 884    | 856         | 0,01               | Bank of America N.A.               |    |                     |             |                    |  |
| 5,599 % fällig am 21.10.2042                         |    | 3.100  | 3.089       | 0,04                | American Assets Trust LP              |    |        |             |                    | 5,526 % fällig am 18.08.2026       |    | 22.300              | 22.622      | 0,27               |  |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |    |        |             |                     | 6,150 % fällig am 01.10.2034          |    | 2.000  | 2.000       | 0,02               | 5,650 % fällig am 18.08.2025       |    | 2.225               | 2.227       | 0,03               |  |
| 3,968 % fällig am 25.08.2032                         |    | 75     | 72          | 0,00                | American Electric Power Co., Inc.     |    |        |             |                    | 6,000 % fällig am 15.10.2036       |    | 7.150               | 7.562       | 0,09               |  |
| Fremont Home Loan Trust                              |    |        |             |                     | 5,200 % fällig am 15.01.2029          |    | 5.948  | 6.102       | 0,07               | Bayer U.S. Finance LLC             |    |                     |             |                    |  |
| 4,754 % fällig am 25.08.2036                         |    | 6.634  | 2.070       | 0,03                | American Homes 4 Rent LP              |    |        |             |                    | 4,250 % fällig am 15.12.2025       |    | 400                 | 399         | 0,00               |  |
| GSAMP Trust                                          |    |        |             |                     | 4,250 % fällig am 15.02.2028          |    | 500    | 497         | 0,01               | 4,375 % fällig am 15.12.2028       |    | 26.422              | 26.182      | 0,31               |  |
| 4,774 % fällig am 25.01.2037                         |    | 815    | 799         | 0,01                | American Tower Corp.                  |    |        |             |                    | 6,250 % fällig am 21.01.2029       |    | 800                 | 840         | 0,01               |  |
| Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust         |    |        |             |                     | 1,450 % fällig am 15.09.2026          |    | 2.700  | 2.609       | 0,03               | 6,375 % fällig am 21.11.2030       |    | 18.200              | 19.347      | 0,23               |  |
| 5,624 % fällig am 25.04.2037                         |    | 4.218  | 2.856       | 0,03                | 1,875 % fällig am 15.10.2030          |    | 4.800  | 4.174       | 0,05               | 6,500 % fällig am 21.11.2033       |    | 5.200               | 5.578       | 0,07               |  |
| JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                  |    |        |             |                     | 2,100 % fällig am 15.06.2030          |    | 1.000  | 889         | 0,01               | Becton Dickinson & Co.             |    |                     |             |                    |  |
| 4,644 % fällig am 25.10.2036                         |    | 371    | 369         | 0,01                | 2,300 % fällig am 15.09.2031          |    | 2.700  | 2.344       | 0,03               | 3,828 % fällig am 07.06.2032       | €  | 1.200               | 1.441       | 0,02               |  |
| Labrador Aviation Finance Ltd.                       |    |        |             |                     | 3,800 % fällig am 15.08.2029          |    | 6.634  | 6.452       | 0,08               | 4,874 % fällig am 08.02.2029       | \$ | 2.900               | 2.942       | 0,04               |  |
| 4,300 % fällig am 15.01.2042                         |    | 8.195  | 7.970       | 0,10                | 5,250 % fällig am 15.07.2028          |    | 3.000  | 3.077       | 0,04               | 5,081 % fällig am 07.06.2029       |    | 7.800               | 7.972       | 0,10               |  |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                       |    |        |             |                     | 5,650 % fällig am 15.03.2033          |    | 6.500  | 6.779       | 0,08               | Berry Global, Inc.                 |    |                     |             |                    |  |
| 4,754 % fällig am 25.12.2036                         |    | 3.753  | 2.565       | 0,03                | 5,800 % fällig am 15.11.2028          |    | 2.400  | 2.505       | 0,03               | 1,500 % fällig am 15.01.2027       | €  | 5.300               | 6.126       | 0,07               |  |
| 5,484 % fällig am 25.06.2035                         |    | 3.458  | 3.393       | 0,04                | American Transmission Systems, Inc.   |    |        |             |                    | 4,875 % fällig am 15.07.2026       | \$ | 1.336               | 1.335       | 0,02               |  |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust                  |    |        |             |                     | 5,000 % fällig am 01.09.2044          |    | 1.052  | 965         | 0,01               | BGC Group, Inc.                    |    |                     |             |                    |  |
| 5,154 % fällig am 25.12.2034                         |    | 1.463  | 1.352       | 0,02                | Amgen, Inc.                           |    |        |             |                    | 6,150 % fällig am 02.04.2030       |    | 3.200               | 3.246       | 0,04               |  |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust               |    |        |             |                     | 5,150 % fällig am 02.03.2028          |    | 3.600  | 3.679       | 0,04               | 6,600 % fällig am 10.06.2029       |    | 3.700               | 3.836       | 0,05               |  |
| 5,484 % fällig am 25.04.2035                         |    | 1.226  | 1.148       | 0,01                | 5,250 % fällig am 02.03.2030          |    | 7.571  | 7.803       | 0,09               | 8,000 % fällig am 25.05.2028       |    | 5.500               | 5.885       | 0,07               |  |
| New Century Home Equity Loan Trust                   |    |        |             |                     | 5,250 % fällig am 02.03.2033          |    | 1.000  | 1.024       | 0,01               | Black Hills Corp.                  |    |                     |             |                    |  |
| 5,364 % fällig am 25.11.2034                         |    | 182    | 185         | 0,00                | 5,600 % fällig am 02.03.2043          |    | 13.984 | 13.881      | 0,17               | 6,000 % fällig am 15.01.2035       |    | 1.450               | 1.505       | 0,02               |  |
| Option One Mortgage Loan Trust                       |    |        |             |                     | 5,650 % fällig am 02.03.2053 (j)      |    | 1.400  | 1.368       | 0,02               | Blackstone Secured Lending Fund    |    |                     |             |                    |  |
| 4,714 % fällig am 25.01.2037                         |    | 4.054  | 2.379       | 0,03                | 5,750 % fällig am 02.03.2063 (j)      |    | 10.000 | 9.729       | 0,12               | 5,875 % fällig am 15.11.2027       |    | 8.100               | 8.273       | 0,10               |  |
| Residential Asset Mortgage Products Trust            |    |        |             |                     | Antares Holdings LP                   |    |        |             |                    | Blue Owl Finance LLC               |    |                     |             |                    |  |
| 4,894 % fällig am 25.12.2035                         |    | 347    | 289         | 0,00                | 2,750 % fällig am 15.01.2027          |    | 5.800  | 5.569       | 0,07               | 3,125 % fällig am 10.06.2031       |    | 5.700               | 5.064       | 0,06               |  |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust       |    |        |             |                     | 3,950 % fällig am 15.07.2026          |    | 3.500  | 3.444       | 0,04               | 6,250 % fällig am 18.04.2034 (j)   |    | 3.100               | 3.191       | 0,04               |  |
| 5,014 % fällig am 25.12.2035                         |    | 304    | 298         | 0,00                | 6,500 % fällig am 08.02.2029          |    | 15.100 | 15.304      | 0,18               | BMW U.S. Capital LLC               |    |                     |             |                    |  |
| 5,109 % fällig am 25.01.2035                         |    | 79     | 73          | 0,00                | 7,950 % fällig am 11.08.2028          |    | 2.000  | 2.113       | 0,03               | 5,185 % fällig am 19.03.2027       |    | 5.800               | 5.806       | 0,07               |  |
| SLM Private Credit Student Loan Trust                |    |        |             |                     | Apollo Debt Solutions BDC             |    |        |             |                    | Boeing Co.                         |    |                     |             |                    |  |
| 4,820 % fällig am 16.12.2041                         |    | 803    | 784         | 0,01                | 6,550 % fällig am 15.03.2032          |    | 60     | 61          | 0,00               | 2,196 % fällig am 04.02.2026       |    | 26.900              | 26.484      | 0,32               |  |
| Soundview Home Loan Trust                            |    |        |             |                     | 6,700 % fällig am 29.07.2031          |    | 9.700  | 10.083      | 0,12               | 3,250 % fällig am 01.02.2028       |    | 100                 | 97          | 0,00               |  |
| 4,894 % fällig am 25.06.2036                         |    | 2.663  | 2.577       | 0,03                | 6,900 % fällig am 13.04.2029          |    | 1.972  | 2.059       | 0,02               | 5,150 % fällig am 01.05.2030       |    | 6.098               | 6.211       | 0,07               |  |
| Structured Asset Investment Loan Trust               |    |        |             |                     | AppLovin Corp.                        |    |        |             |                    | 5,805 % fällig am 01.05.2050       |    | 6.700               | 6.431       | 0,08               |  |
| 5,054 % fällig am 25.01.2036                         |    | 2.945  | 2.774       | 0,03                | 5,125 % fällig am 01.12.2029          |    | 900    | 912         | 0,01               | 5,930 % fällig am 01.05.2060       |    | 5.000               | 4.757       | 0,06               |  |
|                                                      |    |        | 40.016      | 0,48                | Ares Capital Corp.                    |    |        |             |                    | 6,858 % fällig am 01.05.2054       |    | 24.100              | 26.406      | 0,32               |  |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |    |        |             |                     | 2,875 % fällig am 15.06.2027          |    | 4.500  | 4.351       | 0,05               | 7,008 % fällig am 01.05.2064       |    | 2.400               | 2.639       | 0,03               |  |
| AbbVie, Inc.                                         |    |        |             |                     | Ares Finance Co. LLC                  |    |        |             |                    | Booz Allen Hamilton, Inc.          |    |                     |             |                    |  |
| 4,950 % fällig am 15.03.2031                         |    | 1.500  | 1.540       | 0,02                | 3,250 % fällig am 15.06.2030          |    | 6.444  | 5.999       | 0,07               | 5,950 % fällig am 04.08.2033       |    | 2.300               | 2.364       | 0,03               |  |
| 5,050 % fällig am 15.03.2034                         |    | 10.000 | 10.185      | 0,12                | Ares Management Corp.                 |    |        |             |                    | Boston Scientific Corp.            |    |                     |             |                    |  |
| Adventist Health System                              |    |        |             |                     | 6,375 % fällig am 10.11.2028          |    | 11.000 | 11.664      | 0,14               | 2,650 % fällig am 01.06.2030       |    | 4.749               | 4.398       | 0,05               |  |
| 5,430 % fällig am 01.03.2032                         |    | 2.000  | 2.013       | 0,02                | Ares Strategic Income Fund            |    |        |             |                    | British Airways Pass-Through Trust |    |                     |             |                    |  |
|                                                      |    |        |             |                     | 5,600 % fällig am 15.02.2030          |    | 600    | 598         | 0,01               | 3,300 % fällig am 15.06.2034       |    | 10.133              | 9.436       | 0,11               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | 6,200 % fällig am 21.03.2032          |    | 4.600  | 4.616       | 0,06               | 3,350 % fällig am 15.12.2030       |    | 526                 | 504         | 0,01               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | Ashtead Capital, Inc.                 |    |        |             |                    | 3,800 % fällig am 20.03.2033       |    | 52                  | 50          | 0,00               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | 1,500 % fällig am 12.08.2026          |    | 6.200  | 6.000       | 0,07               | 4,125 % fällig am 20.03.2033       |    | 52                  | 50          | 0,00               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | 4,000 % fällig am 01.05.2028          |    | 7.041  | 6.937       | 0,08               | 4,250 % fällig am 15.05.2034       |    | 578                 | 556         | 0,01               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | 5,800 % fällig am 15.04.2034          |    | 1.000  | 1.024       | 0,01               | Broadcom, Inc.                     |    |                     |             |                    |  |
|                                                      |    |        |             |                     | Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.  |    |        |             |                    | 2,450 % fällig am 15.02.2031       |    | 9.400               | 8.408       | 0,10               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | 6,125 % fällig am 15.09.2028          |    | 3.900  | 4.102       | 0,05               | 3,187 % fällig am 15.11.2036       |    | 27.777              | 23.038      | 0,28               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | Astrazeneca Finance LLC               |    |        |             |                    | 3,469 % fällig am 15.04.2034       |    | 13.000              | 11.618      | 0,14               |  |
|                                                      |    |        |             |                     | 4,900 % fällig am 26.02.2031          |    | 13.500 | 13.877      | 0,17               | 4,926 % fällig am 15.05.2037       |    | 9.000               | 8.739       | 0,11               |  |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|
| Brookfield Capital Finance LLC          |                |                          |                                        | Dell International LLC                  |                |                          |                                        | GA Global Funding Trust                     |                |                          |                                        |
| 6,087 % fällig am 14.06.2033            | \$ 7.700       | \$ 8.150                 | 0,10                                   | 4,900 % fällig am 01.10.2026            | \$ 1.110       | \$ 1.115                 | 0,01                                   | 5,500 % fällig am 08.01.2029                | \$ 3.300       | \$ 3.384                 | 0,04                                   |
| Burlington Northern Santa Fe LLC        |                |                          |                                        | Delta Air Lines, Inc.                   |                |                          |                                        | 5,900 % fällig am 13.01.2035                | 2.000          | 2.030                    | 0,02                                   |
| 5,200 % fällig am 15.04.2054            | 1.528          | 1.448                    | 0,02                                   | 3,750 % fällig am 28.10.2029            | 15.000         | 14.344                   | 0,17                                   | Gartner, Inc.                               |                |                          |                                        |
| Cameron LNG LLC                         |                |                          |                                        | Doctors Co. An Interinsurance Exchange  |                |                          |                                        | 3,750 % fällig am 01.10.2030                | 534            | 500                      | 0,01                                   |
| 2,902 % fällig am 15.07.2031            | 1.900          | 1.727                    | 0,02                                   | 4,500 % fällig am 18.01.2032            | 900            | 802                      | 0,01                                   | Glencore Funding LLC                        |                |                          |                                        |
| 3,402 % fällig am 15.01.2038            | 4.172          | 3.565                    | 0,04                                   | DT Midstream, Inc.                      |                |                          |                                        | 5,338 % fällig am 04.04.2027                | 2.000          | 2.028                    | 0,02                                   |
| 3,701 % fällig am 15.01.2039            | 8.725          | 7.466                    | 0,09                                   | 5,800 % fällig am 15.12.2034            | 2.350          | 2.395                    | 0,03                                   | Global Atlantic Fin Co.                     |                |                          |                                        |
| Cantor Fitzgerald LP                    |                |                          |                                        | Duke Energy Corp.                       |                |                          |                                        | 7,950 % fällig am 15.10.2054                | 6.900          | 7.201                    | 0,09                                   |
| 7,200 % fällig am 12.12.2028            | 13.900         | 14.761                   | 0,18                                   | 3,750 % fällig am 01.04.2031            | € 5.700        | 6.798                    | 0,08                                   | Global Payments, Inc.                       |                |                          |                                        |
| CDW LLC                                 |                |                          |                                        | 3,850 % fällig am 15.06.2034            | 12.300         | 14.354                   | 0,17                                   | 4,875 % fällig am 17.03.2031                | € 3.800        | 4.691                    | 0,06                                   |
| 3,569 % fällig am 01.12.2031            | 6.400          | 5.895                    | 0,07                                   | Duke Energy Progress LLC                |                |                          |                                        | GLP Capital LP                              |                |                          |                                        |
| 5,550 % fällig am 22.08.2034            | 1.600          | 1.598                    | 0,02                                   | 5,250 % fällig am 15.03.2033            | \$ 2.783       | 2.875                    | 0,03                                   | 4,000 % fällig am 15.01.2030                | \$ 1.500       | 1.443                    | 0,02                                   |
| Centene Corp.                           |                |                          |                                        | Dyno Nobel, Inc.                        |                |                          |                                        | 4,000 % fällig am 15.01.2031                | 5.250          | 4.954                    | 0,06                                   |
| 2,450 % fällig am 15.07.2028            | 16.384         | 15.226                   | 0,18                                   | 3,950 % fällig am 03.08.2027            | 1.500          | 1.472                    | 0,02                                   | 5,300 % fällig am 15.01.2029                | 15.224         | 15.403                   | 0,19                                   |
| 3,000 % fällig am 15.10.2030            | 21.000         | 18.777                   | 0,23                                   | Edison International                    |                |                          |                                        | 5,375 % fällig am 15.04.2026                | 5.600          | 5.605                    | 0,07                                   |
| CenterPoint Energy Houston Electric LLC |                |                          |                                        | 4,125 % fällig am 15.03.2028            | 2.300          | 2.221                    | 0,03                                   | 5,750 % fällig am 01.06.2028                | 12.929         | 13.257                   | 0,16                                   |
| 5,050 % fällig am 01.03.2035            | 7.000          | 6.997                    | 0,08                                   | 5,450 % fällig am 15.06.2029            | 4.200          | 4.156                    | 0,05                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                   |                |                          |                                        |
| Charles Schwab Corp.                    |                |                          |                                        | 6,250 % fällig am 15.03.2030            | 1.500          | 1.524                    | 0,02                                   | 2,383 % fällig am 21.07.2032                | 4.100          | 3.582                    | 0,04                                   |
| 6,196 % fällig am 17.11.2029            | 13.300         | 14.116                   | 0,17                                   | Energy Transfer LP                      |                |                          |                                        | 4,223 % fällig am 01.05.2029                | 19.400         | 19.293                   | 0,23                                   |
| Charter Communications Operating LLC    |                |                          |                                        | 3,750 % fällig am 15.05.2030            | 5.000          | 4.799                    | 0,06                                   | 4,482 % fällig am 23.08.2028                | 13.300         | 13.320                   | 0,16                                   |
| 2,300 % fällig am 01.02.2032            | 4.000          | 3.377                    | 0,04                                   | 4,400 % fällig am 15.03.2027            | 4.245          | 4.247                    | 0,05                                   | 5,016 % fällig am 23.10.2035                | 4.400          | 4.349                    | 0,05                                   |
| 3,500 % fällig am 01.06.2041            | 9.200          | 6.679                    | 0,08                                   | 5,150 % fällig am 01.02.2043            | 2.294          | 2.010                    | 0,02                                   | 6,484 % fällig am 24.10.2029                | 28.000         | 29.706                   | 0,36                                   |
| 3,700 % fällig am 01.04.2051            | 6.800          | 4.533                    | 0,05                                   | 5,150 % fällig am 15.03.2045            | 7.503          | 6.619                    | 0,08                                   | 7,250 % fällig am 10.04.2028                | £ 1.317        | 1.933                    | 0,02                                   |
| 3,900 % fällig am 01.06.2052            | 1.700          | 1.168                    | 0,01                                   | 5,300 % fällig am 01.04.2044            | 4.130          | 3.703                    | 0,04                                   | Goodman U.S. Finance Four LLC               |                |                          |                                        |
| 4,400 % fällig am 01.12.2061            | 750            | 526                      | 0,01                                   | 5,350 % fällig am 15.05.2045            | 4.681          | 4.220                    | 0,05                                   | 4,500 % fällig am 15.10.2037                | \$ 3.182       | 2.909                    | 0,03                                   |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049            | 9.300          | 7.739                    | 0,09                                   | 5,950 % fällig am 15.05.2054            | 4.000          | 3.809                    | 0,05                                   | Goodman U.S. Finance Three LLC              |                |                          |                                        |
| Cheniere Corpus Christi Holdings LLC    |                |                          |                                        | 6,050 % fällig am 01.12.2026            | 4.200          | 4.290                    | 0,05                                   | 3,700 % fällig am 15.03.2028                | 15.779         | 15.472                   | 0,19                                   |
| 3,700 % fällig am 15.11.2029            | 3.132          | 3.022                    | 0,04                                   | Enterprise Products Operating LLC       |                |                          |                                        | Gulfstream Natural Gas System LLC           |                |                          |                                        |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027            | 10.632         | 10.736                   | 0,13                                   | 5,200 % fällig am 15.01.2036            | 12.600         | 12.692                   | 0,15                                   | 4,600 % fällig am 15.09.2025                | 4.560          | 4.556                    | 0,05                                   |
| Cheniere Energy Partners LP             |                |                          |                                        | 7,573 % fällig am 16.08.2077            | 5.838          | 5.813                    | 0,07                                   | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                |                          |                                        |
| 3,250 % fällig am                       |                |                          |                                        | EPR Properties                          |                |                          |                                        | 6,375 % fällig am 01.07.2034                | 6.400          | 6.404                    | 0,08                                   |
| 31.01.2032 (j)                          | 8.600          | 7.714                    | 0,09                                   | 3,600 % fällig am 15.11.2031            | 2.500          | 2.272                    | 0,03                                   | Haleon U.S. Capital LLC                     |                |                          |                                        |
| 4,000 % fällig am 01.03.2031            | 8.400          | 7.997                    | 0,10                                   | 4,500 % fällig am 15.03.2027            | 6.264          | 6.235                    | 0,07                                   | 3,625 % fällig am 24.03.2032                | 500            | 468                      | 0,01                                   |
| 5,550 % fällig am                       |                |                          |                                        | 4,750 % fällig am 15.12.2026            | 4.425          | 4.420                    | 0,05                                   | Hanover Insurance Group, Inc.               |                |                          |                                        |
| 30.10.2035 (b)                          | 3.000          | 3.025                    | 0,04                                   | 4,950 % fällig am 15.04.2028            | 1.986          | 1.983                    | 0,02                                   | 4,500 % fällig am 15.04.2026                | 740            | 738                      | 0,01                                   |
| 5,750 % fällig am 15.08.2034            | 1.600          | 1.644                    | 0,02                                   | EQT Corp.                               |                |                          |                                        | Hardwood Funding LLC                        |                |                          |                                        |
| 5,950 % fällig am                       |                |                          |                                        | 4,750 % fällig am 15.01.2031            | 5.300          | 5.220                    | 0,06                                   | 4,840 % fällig am                           |                |                          |                                        |
| 30.06.2033 (j)                          | 7.500          | 7.832                    | 0,09                                   | 6,375 % fällig am 01.04.2029            | 2.200          | 2.270                    | 0,03                                   | 07.06.2028 (i)                              | 2.700          | 2.716                    | 0,03                                   |
| Citadel Finance LLC                     |                |                          |                                        | Equinix Europe Financing Corp. LLC      |                |                          |                                        | 4,980 % fällig am                           |                |                          |                                        |
| 5,900 % fällig am 10.02.2030            | 13.600         | 13.735                   | 0,17                                   | 3,250 % fällig am 15.03.2031            | € 2.800        | 3.257                    | 0,04                                   | 07.06.2030 (i)                              | 2.100          | 2.121                    | 0,03                                   |
| Citibank N.A.                           |                |                          |                                        | 3,650 % fällig am 03.09.2033            | 9.400          | 10.949                   | 0,13                                   | 5,160 % fällig am                           |                |                          |                                        |
| 5,864 % fällig am 29.09.2025            | 6.500          | 6.513                    | 0,08                                   | Equitable Financial Life Global Funding |                |                          |                                        | 07.06.2032 (i)                              | 2.700          | 2.732                    | 0,03                                   |
| Citigroup, Inc.                         |                |                          |                                        | 1,300 % fällig am 12.07.2026            | \$ 1.000       | 970                      | 0,01                                   | HAT Holdings LLC                            |                |                          |                                        |
| 2,572 % fällig am 03.06.2031            | 14.539         | 13.189                   | 0,16                                   | Equitable Holdings, Inc.                |                |                          |                                        | 3,375 % fällig am 15.06.2026                | 11.812         | 11.569                   | 0,14                                   |
| 3,785 % fällig am                       |                |                          |                                        | 6,700 % fällig am 28.03.2055            | 7.800          | 8.006                    | 0,10                                   | 8,000 % fällig am 15.06.2027                | 3.950          | 4.120                    | 0,05                                   |
| 17.03.2033 (j)                          | 4.000          | 3.740                    | 0,04                                   | Essex Portfolio LP                      |                |                          |                                        | HCA, Inc.                                   |                |                          |                                        |
| 5,449 % fällig am 11.06.2035            | 2.900          | 2.963                    | 0,04                                   | 5,375 % fällig am 01.04.2035            | 2.150          | 2.183                    | 0,03                                   | 3,500 % fällig am 01.09.2030                | 4.975          | 4.706                    | 0,06                                   |
| 6,270 % fällig am 17.11.2033            | 4.700          | 5.063                    | 0,06                                   | Expand Energy Corp.                     |                |                          |                                        | 4,125 % fällig am 15.06.2029                | 3.100          | 3.047                    | 0,04                                   |
| CNA Financial Corp.                     |                |                          |                                        | 5,375 % fällig am 15.03.2030            | 700            | 702                      | 0,01                                   | 4,500 % fällig am 15.02.2027                | 3.800          | 3.802                    | 0,05                                   |
| 5,500 % fällig am 15.06.2033            | 1.000          | 1.027                    | 0,01                                   | 5,700 % fällig am 15.01.2035            | 4.000          | 4.061                    | 0,05                                   | 5,450 % fällig am 15.09.2034                | 5.000          | 5.045                    | 0,06                                   |
| Constellation Brands, Inc.              |                |                          |                                        | F&G Global Funding                      |                |                          |                                        | 5,500 % fällig am 01.06.2033                | 22.127         | 22.663                   | 0,27                                   |
| 2,250 % fällig am 01.08.2031            | 7.000          | 6.067                    | 0,07                                   | 2,000 % fällig am 20.09.2028            | 1.100          | 1.011                    | 0,01                                   | Healthpeak OP LLC                           |                |                          |                                        |
| Constellation Energy Generation LLC     |                |                          |                                        | 5,875 % fällig am 10.06.2027            | 3.900          | 3.988                    | 0,05                                   | 5,375 % fällig am 15.02.2035                | 400            | 404                      | 0,00                                   |
| 5,750 % fällig am 01.10.2041            | 2.500          | 2.503                    | 0,03                                   | 5,875 % fällig am 16.01.2030            | 2.200          | 2.264                    | 0,03                                   | Highwoods Realty LP                         |                |                          |                                        |
| Constellation Pharmaceuticals, Inc.     |                |                          |                                        | Fells Point Funding Trust               |                |                          |                                        | 2,600 % fällig am 01.02.2031                | 4.200          | 3.635                    | 0,04                                   |
| 5,550 % fällig am                       |                |                          |                                        | 3,046 % fällig am 31.01.2027            | 6.150          | 6.019                    | 0,07                                   | 4,200 % fällig am 15.04.2029                | 2.500          | 2.432                    | 0,03                                   |
| 01.07.2033 (i)                          | 3.434          | 3.487                    | 0,04                                   | FirstEnergy Pennsylvania Electric Co.   |                |                          |                                        | Host Hotels & Resorts LP                    |                |                          |                                        |
| Consumers Securitization Funding LLC    |                |                          |                                        | 3,600 % fällig am 01.06.2029            | 4.270          | 4.125                    | 0,05                                   | 3,375 % fällig am 15.12.2029                | 4.700          | 4.438                    | 0,05                                   |
| 5,550 % fällig am 01.03.2028            | 603            | 607                      | 0,01                                   | Fiserv, Inc.                            |                |                          |                                        | 3,500 % fällig am 15.09.2030                | 2.600          | 2.415                    | 0,03                                   |
| Corebridge Global Funding               |                |                          |                                        | 4,500 % fällig am 24.05.2031            | € 2.500        | 3.105                    | 0,04                                   | 5,500 % fällig am 15.04.2035                | 4.500          | 4.457                    | 0,05                                   |
| 4,900 % fällig am 07.01.2028            | 6.200          | 6.296                    | 0,08                                   | Flex Intermediate Holdco LLC            |                |                          |                                        | 5,700 % fällig am 01.07.2034                | 2.501          | 2.518                    | 0,03                                   |
| CoStar Group, Inc.                      |                |                          |                                        | 3,363 % fällig am 30.06.2031            | \$ 31.161      | 27.712                   | 0,33                                   | HPS Corporate Lending Fund                  |                |                          |                                        |
| 2,800 % fällig am 15.07.2030            | 5.100          | 4.616                    | 0,06                                   | Ford Foundation                         |                |                          |                                        | 5,950 % fällig am 14.04.2032                | 3.000          | 2.986                    | 0,04                                   |
| CQP Holdco LP                           |                |                          |                                        | 2,815 % fällig am 01.06.2070            | 700            | 391                      | 0,00                                   | Hudson Pacific Properties LP                |                |                          |                                        |
| 5,500 % fällig am 15.06.2031            | 250            | 247                      | 0,00                                   | Ford Motor Credit Co. LLC               |                |                          |                                        | 3,250 % fällig am 15.01.2030                | 2.325          | 1.903                    | 0,02                                   |
| 7,500 % fällig am 15.12.2033            | 250            | 272                      | 0,00                                   | 2,330 % fällig am 25.11.2025            | € 3.050        | 3.577                    | 0,04                                   | 3,950 % fällig am 01.11.2027                | 2.600          | 2.495                    | 0,03                                   |
| Crown Castle Towers LLC                 |                |                          |                                        | 4,125 % fällig am 17.08.2027            | \$ 4.400       | 4.302                    | 0,05                                   | 4,650 % fällig am                           |                |                          |                                        |
| 4,241 % fällig am 15.07.2048            | 5.800          | 5.701                    | 0,07                                   | 4,271 % fällig am 09.01.2027            | 7.600          | 7.493                    | 0,09                                   | 01.04.2029 (j)                              | 2.700          | 2.428                    | 0,03                                   |
| Crown Castle, Inc.                      |                |                          |                                        | 4,950 % fällig am 28.05.2027            | 500            | 497                      | 0,01                                   | Hyatt Hotels Corp.                          |                |                          |                                        |
| 3,100 % fällig am 15.11.2029            | 8.805          | 8.265                    | 0,10                                   | 5,125 % fällig am 05.11.2026            | 1.500          | 1.497                    | 0,02                                   | 5,250 % fällig am 30.06.2029                | 2.200          | 2.239                    | 0,03                                   |
| CVS Pass-Through Trust                  |                |                          |                                        | 5,850 % fällig am 17.05.2027            | 2.000          | 2.016                    | 0,02                                   | 5,375 % fällig am 15.12.2031                | 1.300          | 1.319                    | 0,02                                   |
| 4,704 % fällig am 10.01.2036            | 182            | 175                      | 0,00                                   | 5,918 % fällig am 20.03.2028            | 1.800          | 1.819                    | 0,02                                   | Hyundai Capital America                     |                |                          |                                        |
| 5,926 % fällig am 10.01.2034            | 1.648          | 1.665                    | 0,02                                   | Freedom Mortgage Corp.                  |                |                          |                                        | 1,500 % fällig am 15.06.2026                | 2.747          | 2.668                    | 0,03                                   |
| 6,036 % fällig am 10.12.2028            | 727            | 737                      | 0,01                                   | 12,000 % fällig am 01.10.2028           | 5.800          | 6.241                    | 0,08                                   | 4,850 % fällig am 25.03.2027                | 3.000          | 3.014                    | 0,04                                   |
| 7,507 % fällig am 10.01.2032            | 879            | 921                      | 0,01                                   | FS KKR Capital Corp.                    |                |                          |                                        | 5,100 % fällig am 24.06.2030                | 7.400          | 7.484                    | 0,09                                   |
| 8,353 % fällig am 10.07.2031            | 186            | 201                      | 0,00                                   | 2,625 % fällig am 15.01.2027            | 2.211          | 2.121                    | 0,03                                   | 5,509 % fällig am 04.08.2025                | 10.000         | 10.005                   | 0,12                                   |
| DAE Funding LLC                         |                |                          |                                        | 6,125 % fällig am 15.01.2030            | 6.400          | 6.359                    | 0,08                                   | Infor LLC                                   |                |                          |                                        |
| 3,375 % fällig am 20.03.2028            | 24.600         | 23.689                   | 0,28                                   |                                         |                |                          |                                        | 1,750 % fällig am 15.07.2025                | 4.575          | 4.569                    | 0,05                                   |
| Daimler Truck Finance North America LLC |                |                          |                                        |                                         |                |                          |                                        | Integrus Baptist Medical Center, Inc.       |                |                          |                                        |
| 5,250 % fällig am 13.01.2030            | 1.300          | 1.331                    | 0,02                                   |                                         |                |                          |                                        | 3,875 % fällig am 15.08.2050                | 8.200          | 5.847                    | 0,07                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|
| Intercontinental Exchange, Inc.<br>3,000 % fällig am 15.09.2060             | \$ 6.350       | \$ 3.849                 | 0,05                                   | MidAmerican Energy Co.<br>3,950 % fällig am 01.08.2047                   | \$ 4.903       | \$ 3.882                 | 0,05                                   | Pacific Life Global Funding<br>4,955 % fällig am 27.01.2028               | \$ 17.500      | \$ 17.489                | 0,21                                   |
| Invitation Homes Operating Partnership LP<br>2,700 % fällig am 15.01.2034   |                | 3.615                    |                                        | 5,750 % fällig am 01.11.2035                                             | 2.200          | 2.330                    | 0,03                                   | PacifiCorp<br>5,350 % fällig am 01.12.2053                                | 4.155          | 3.739                    | 0,04                                   |
| 2,700 % fällig am 15.01.2034                                                |                | 2.989                    | 0,04                                   | Mileage Plus Holdings LLC<br>6,500 % fällig am 20.06.2027                | 1.960          | 1.964                    | 0,02                                   | 7,375 % fällig am 15.09.2055                                              | 1.700          | 1.772                    | 0,02                                   |
| 4,150 % fällig am 15.04.2032                                                | 1.500          | 1.421                    | 0,02                                   | Monongahela Power Co.<br>3,550 % fällig am 15.05.2027                    | 1.400          | 1.380                    | 0,02                                   | PennyMac Financial Services, Inc.<br>7,875 % fällig am 15.12.2029         | 100            | 106                      | 0,00                                   |
| 5,500 % fällig am 15.08.2033                                                | 1.500          | 1.524                    | 0,02                                   | Morgan Stanley<br>0,000 % fällig am<br>02.04.2032 (i)                    | 46.900         | 32.556                   | 0,39                                   | Philip Morris International, Inc.<br>2,750 % fällig am 06.06.2029         | € 5.200        | 6.064                    | 0,07                                   |
| IPALCO Enterprises, Inc.<br>4,250 % fällig am 01.05.2030                    | 300            | 288                      | 0,00                                   | 3,790 % fällig am 21.03.2030                                             | € 8.000        | 9.674                    | 0,12                                   | 3,250 % fällig am 06.06.2032                                              | 3.700          | 4.277                    | 0,05                                   |
| JetBlue Pass-Through Trust<br>4,000 % fällig am 15.05.2034                  | 776            | 728                      | 0,01                                   | 3,955 % fällig am 21.03.2035                                             | 8.100          | 9.730                    | 0,12                                   | 5,625 % fällig am 17.11.2029                                              | \$ 3.700       | 3.886                    | 0,05                                   |
| JPMorgan Chase & Co.<br>2,069 % fällig am 01.06.2029                        | 4.100          | 3.846                    | 0,05                                   | 5,123 % fällig am 01.02.2029                                             | \$ 1.100       | 1.119                    | 0,01                                   | Piedmont Natural Gas Co., Inc.<br>5,400 % fällig am 15.06.2033            | 1.200          | 1.237                    | 0,01                                   |
| 2,545 % fällig am 08.11.2032                                                | 10.000         | 8.806                    | 0,11                                   | 5,173 % fällig am 16.01.2030                                             | 200            | 204                      | 0,00                                   | Piedmont Operating Partnership LP<br>3,150 % fällig am 15.08.2030         | 3.956          | 3.551                    | 0,04                                   |
| 2,580 % fällig am 22.04.2032                                                | 16.700         | 14.919                   | 0,18                                   | 5,250 % fällig am 21.04.2034                                             | 2.315          | 2.356                    | 0,03                                   | Pinnacle West Capital Corp.<br>5,214 % fällig am 10.06.2026               | 3.315          | 3.321                    | 0,04                                   |
| 2,739 % fällig am 15.10.2030                                                | 34.300         | 31.990                   | 0,38                                   | 5,424 % fällig am 21.07.2034                                             | 8.800          | 9.018                    | 0,11                                   | Pioneer Natural Resources Co.<br>7,200 % fällig am 15.01.2028             | 2.394          | 2.567                    | 0,03                                   |
| 3,540 % fällig am 01.05.2028                                                | 3.100          | 3.055                    | 0,04                                   | 6,296 % fällig am 18.10.2028                                             | 394            | 411                      | 0,00                                   | Plains All American Pipeline LP<br>6,700 % fällig am 15.05.2036           | 300            | 322                      | 0,00                                   |
| 3,702 % fällig am 06.05.2030                                                | 4.600          | 4.478                    | 0,05                                   | 6,407 % fällig am 01.11.2029                                             | 12.200         | 12.925                   | 0,16                                   | Prologis LP<br>4,200 % fällig am 15.02.2033                               | CAD 6.600      | 4.871                    | 0,06                                   |
| 3,782 % fällig am 01.02.2028                                                | 3.569          | 3.539                    | 0,04                                   | MPLX LP<br>5,400 % fällig am 01.04.2035                                  | 4.100          | 4.072                    | 0,05                                   | Protective Life Corp.<br>3,400 % fällig am 15.01.2030                     | \$ 18.576      | 17.713                   | 0,21                                   |
| 4,005 % fällig am 23.04.2029                                                | 6.100          | 6.047                    | 0,07                                   | MSCI, Inc.<br>3,625 % fällig am 01.09.2030                               | 2.400          | 2.253                    | 0,03                                   | Protective Life Global Funding<br>5,432 % fällig am 14.01.2032            | 5.000          | 5.167                    | 0,06                                   |
| 4,565 % fällig am 14.06.2030                                                | 8.536          | 8.575                    | 0,10                                   | 3,623 % fällig am 01.11.2031                                             | 9.900          | 9.129                    | 0,11                                   | Radian Group, Inc.<br>6,200 % fällig am 15.05.2029                        | 3.700          | 3.846                    | 0,05                                   |
| 4,603 % fällig am 22.10.2030                                                | 15.300         | 15.355                   | 0,18                                   | 3,875 % fällig am 15.02.2031                                             | 100            | 94                       | 0,00                                   | Realty Income Corp.<br>3,200 % fällig am 15.01.2027                       | 1.800          | 1.770                    | 0,02                                   |
| 5,140 % fällig am 24.01.2031                                                | 100            | 103                      | 0,00                                   | National Grid North America, Inc.<br>3,631 % fällig am 03.09.2031        | € 7.000        | 8.370                    | 0,10                                   | 3,875 % fällig am 20.06.2035                                              | € 4.600        | 5.351                    | 0,06                                   |
| 5,350 % fällig am 01.06.2034                                                | 14.700         | 15.129                   | 0,18                                   | 3,724 % fällig am 25.11.2034                                             | 700            | 818                      | 0,01                                   | 4,875 % fällig am 06.07.2030                                              | 500            | 630                      | 0,01                                   |
| 5,534 % fällig am 29.11.2045                                                | 3.500          | 3.510                    | 0,04                                   | 4,061 % fällig am 03.09.2036                                             | 6.650          | 7.882                    | 0,09                                   | Reliance Standard Life Global Funding<br>2,750 % fällig am 21.01.2027     | \$ 4.100       | 3.963                    | 0,05                                   |
| 6,070 % fällig am 22.10.2027                                                | 9.150          | 9.351                    | 0,11                                   | Nationwide Financial Services, Inc.<br>3,900 % fällig am 30.11.2049      | \$ 8.700       | 6.505                    | 0,08                                   | RG&A Global Funding<br>5,250 % fällig am 09.01.2030                       | 2.800          | 2.875                    | 0,03                                   |
| 6,087 % fällig am 23.10.2029                                                | 10.000         | 10.512                   | 0,13                                   | Neuberger Berman Group LLC<br>4,500 % fällig am 15.03.2027               | 12.077         | 12.068                   | 0,14                                   | 5,500 % fällig am 11.01.2031                                              | 5.000          | 5.161                    | 0,06                                   |
| Kilroy Realty LP<br>2,500 % fällig am 15.11.2032                            | 1.100          | 886                      | 0,01                                   | Newfold Digital Holdings Group, Inc.<br>11,750 % fällig am<br>15.10.2028 | 1.500          | 1.133                    | 0,01                                   | 6,000 % fällig am 21.11.2028                                              | 9.000          | 9.446                    | 0,11                                   |
| 2,650 % fällig am 15.11.2033                                                | 5.464          | 4.295                    | 0,05                                   | Newmark Group, Inc.<br>7,500 % fällig am 12.01.2029                      | 2.500          | 2.647                    | 0,03                                   | Rio Oil Finance Trust<br>9,750 % fällig am 06.01.2027                     | 78             | 81                       | 0,00                                   |
| 4,250 % fällig am 15.08.2029                                                | 1.000          | 967                      | 0,01                                   | Niagara Mohawk Power Corp.<br>5,290 % fällig am 17.01.2034               | 2.100          | 2.095                    | 0,03                                   | Sabine Pass Liquefaction LLC<br>4,200 % fällig am 15.03.2028              | 5.700          | 5.671                    | 0,07                                   |
| Kinder Morgan, Inc.<br>2,250 % fällig am 16.03.2027                         | € 4.140        | 4.841                    | 0,06                                   | Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>1,850 % fällig am 16.09.2026          | 10.700         | 10.212                   | 0,12                                   | 5,000 % fällig am 15.03.2027                                              | 7.300          | 7.346                    | 0,09                                   |
| 7,420 % fällig am 15.02.2037                                                | \$ 3.388       | 3.737                    | 0,04                                   | NVR, Inc.<br>3,000 % fällig am 15.05.2030                                | 3.622          | 3.375                    | 0,04                                   | Sammons Financial Group, Inc.<br>4,450 % fällig am 12.05.2027             | 700            | 699                      | 0,01                                   |
| 8,050 % fällig am 15.10.2030                                                | 36             | 41                       | 0,00                                   | Occidental Petroleum Corp.<br>5,000 % fällig am 01.08.2027               | 1.500          | 1.514                    | 0,02                                   | 6,875 % fällig am 15.04.2034                                              | 5.100          | 5.473                    | 0,07                                   |
| KKR Financial Holdings LLC<br>5,400 % fällig am 23.05.2033                  | 10.400         | 10.020                   | 0,12                                   | 6,200 % fällig am 15.03.2040                                             | 4.922          | 4.821                    | 0,06                                   | San Diego Gas & Electric Co.<br>1,700 % fällig am 01.10.2030              | 1.500          | 1.306                    | 0,02                                   |
| KKR Group Finance Co. LLC<br>3,500 % fällig am 25.08.2050                   | 1.144          | 784                      | 0,01                                   | 8,875 % fällig am 15.07.2030                                             | 5.650          | 6.460                    | 0,08                                   | 2,500 % fällig am 15.05.2026                                              | 9.320          | 9.169                    | 0,11                                   |
| 3,625 % fällig am 25.02.2050                                                | 1.146          | 808                      | 0,01                                   | Omega Healthcare Investors, Inc.<br>5,250 % fällig am 15.01.2026         | 1.500          | 1.501                    | 0,02                                   | 3,750 % fällig am 01.06.2047                                              | 100            | 74                       | 0,00                                   |
| Kraft Heinz Foods Co.<br>4,375 % fällig am 01.06.2046                       | 22.070         | 17.868                   | 0,21                                   | Oncor Electric Delivery Co. LLC<br>3,625 % fällig am 15.06.2034          | € 8.400        | 9.851                    | 0,12                                   | Santander Holdings USA, Inc.<br>5,353 % fällig am 06.09.2030              | 3.750          | 3.818                    | 0,05                                   |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>5,500 % fällig am<br>01.08.2030 (b) | 800            | 806                      | 0,01                                   | OneMain Finance Corp.<br>7,875 % fällig am 15.03.2030                    | \$ 4.900       | 5.210                    | 0,06                                   | SBA Tower Trust<br>1,884 % fällig am 15.07.2050                           | 25.172         | 24.763                   | 0,30                                   |
| Las Vegas Sands Corp.<br>3,500 % fällig am 18.08.2026                       | 5.556          | 5.484                    | 0,07                                   | ONEOK, Inc.<br>5,050 % fällig am<br>01.11.2034 (j)                       | 4.900          | 4.771                    | 0,06                                   | SCE Recovery Funding LLC<br>5,112 % fällig am 14.12.2049                  | 3.100          | 2.899                    | 0,03                                   |
| 3,900 % fällig am 08.08.2029                                                | 6.950          | 6.622                    | 0,08                                   | 5,700 % fällig am 01.11.2054                                             | 35.000         | 32.336                   | 0,39                                   | Sempra<br>4,125 % fällig am 01.04.2052                                    | 4.100          | 3.953                    | 0,05                                   |
| 5,900 % fällig am 01.06.2027                                                | 43.100         | 44.056                   | 0,53                                   | 6,625 % fällig am 01.09.2053                                             | 12.400         | 12.898                   | 0,15                                   | Sixth Street Lending Partners<br>5,750 % fällig am 15.01.2030             | 2.600          | 2.608                    | 0,03                                   |
| 6,000 % fällig am 15.08.2029                                                | 2.000          | 2.056                    | 0,02                                   | Oracle Corp.<br>5,500 % fällig am<br>03.08.2035 (j)                      | 3.700          | 3.784                    | 0,05                                   | 6,500 % fällig am 11.03.2029                                              | 4.300          | 4.440                    | 0,05                                   |
| Lazard Group LLC<br>4,375 % fällig am 11.03.2029                            | 4.868          | 4.812                    | 0,06                                   | 6,150 % fällig am 09.11.2029                                             | 7.500          | 8.005                    | 0,10                                   | SLM Corp.<br>3,125 % fällig am 02.11.2026                                 | 900            | 883                      | 0,01                                   |
| 6,000 % fällig am 15.03.2031                                                | 800            | 840                      | 0,01                                   | 6,250 % fällig am 09.11.2032                                             | 16.000         | 17.320                   | 0,21                                   | South Bow USA Infrastructure Holdings LLC<br>5,026 % fällig am 01.10.2029 | 5.200          | 5.218                    | 0,06                                   |
| Lehman Brothers Holdings, Inc.<br>0,000 % fällig am<br>23.12.2010^          | 900            | 1                        | 0,00                                   | Pacific Gas & Electric Co.<br>2,950 % fällig am 01.03.2026               | 2.800          | 2.764                    | 0,03                                   | Southern California Edison Co.<br>2,250 % fällig am 01.06.2030            | 1.110          | 975                      | 0,01                                   |
| 5,259 % fällig am<br>12.06.2013^                                            | € 2.807        | 13                       | 0,00                                   | 3,000 % fällig am 15.06.2028                                             | 8.330          | 7.913                    | 0,10                                   | 2,500 % fällig am 01.06.2031                                              | 5.831          | 5.067                    | 0,06                                   |
| 6,875 % fällig am<br>02.05.2018^                                            | \$ 3.000       | 2                        | 0,00                                   | 3,300 % fällig am 15.03.2027                                             | 11.935         | 11.664                   | 0,14                                   | 2,750 % fällig am 01.02.2032                                              | 1.900          | 1.639                    | 0,02                                   |
| Live Nation Entertainment, Inc.<br>3,750 % fällig am 15.01.2028             | 2.000          | 1.940                    | 0,02                                   | 3,300 % fällig am 01.12.2027                                             | 13.369         | 12.939                   | 0,16                                   | 2,950 % fällig am 01.02.2051                                              | 6.400          | 3.753                    | 0,05                                   |
| 6,500 % fällig am 15.05.2027                                                | 5.700          | 5.788                    | 0,07                                   | 3,450 % fällig am 01.07.2025                                             | 1.877          | 1.877                    | 0,02                                   | 3,450 % fällig am 01.02.2052                                              | 5.800          | 3.649                    | 0,04                                   |
| Marriott International, Inc.<br>3,500 % fällig am 15.10.2032                | 5.981          | 5.440                    | 0,07                                   | 3,750 % fällig am 15.08.2042                                             | 3.300          | 2.356                    | 0,03                                   | 3,650 % fällig am 01.06.2051                                              | 3.598          | 2.382                    | 0,03                                   |
| Mars, Inc.<br>4,450 % fällig am 01.03.2027                                  | 6.200          | 6.224                    | 0,07                                   | 4,000 % fällig am 01.12.2046                                             | 100            | 72                       | 0,00                                   | 3,900 % fällig am 01.12.2041                                              | 450            | 340                      | 0,00                                   |
| 4,600 % fällig am 01.03.2028                                                | 10.000         | 10.083                   | 0,12                                   | 4,200 % fällig am 01.06.2041                                             | 2.173          | 1.673                    | 0,02                                   | 4,000 % fällig am 01.04.2047                                              | 9.644          | 6.935                    | 0,08                                   |
| 4,800 % fällig am 01.03.2030                                                | 500            | 507                      | 0,01                                   | 4,300 % fällig am 15.03.2045                                             | 500            | 378                      | 0,00                                   | 5,200 % fällig am 01.06.2034                                              | 3.500          | 3.397                    | 0,04                                   |
| Marsh & McLennan Cos., Inc.<br>5,000 % fällig am 15.03.2035                 | 14.900         | 14.904                   | 0,18                                   | 4,450 % fällig am 15.04.2042                                             | 8.543          | 6.795                    | 0,08                                   | 5,250 % fällig am 15.03.2030                                              | 7.800          | 7.884                    | 0,09                                   |
| Marvell Technology, Inc.<br>2,450 % fällig am 15.04.2028                    | 14.850         | 14.115                   | 0,17                                   | 4,500 % fällig am 15.12.2041                                             | 3.400          | 2.675                    | 0,03                                   |                                                                           |                |                          |                                        |
| Mattel, Inc.<br>3,750 % fällig am 01.04.2029                                | 324            | 311                      | 0,00                                   | 4,750 % fällig am 15.02.2044                                             | 1.889          | 1.539                    | 0,02                                   |                                                                           |                |                          |                                        |
| Mercury General Corp.<br>4,400 % fällig am 15.03.2027                       | 1.603          | 1.591                    | 0,02                                   | 4,950 % fällig am 01.07.2050                                             | 1.900          | 1.533                    | 0,02                                   |                                                                           |                |                          |                                        |
| MetLife Capital Trust<br>8,252 % fällig am 15.12.2067                       | 2.995          | 3.291                    | 0,04                                   | 5,000 % fällig am 04.06.2028                                             | 1.000          | 1.003                    | 0,01                                   |                                                                           |                |                          |                                        |
| MetLife, Inc.<br>5,875 % fällig am<br>15.03.2028 (f)                        | 7.079          | 7.217                    | 0,09                                   | 6,000 % fällig am 15.08.2035                                             | 5.100          | 5.159                    | 0,06                                   |                                                                           |                |                          |                                        |
| Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC<br>4,100 % fällig am 15.05.2028    | 7.140          | 7.095                    | 0,09                                   | 6,700 % fällig am 01.04.2053                                             | 3.000          | 3.012                    | 0,04                                   |                                                                           |                |                          |                                        |
|                                                                             |                |                          |                                        | 6,950 % fällig am 15.03.2034                                             | 5.200          | 5.601                    | 0,07                                   |                                                                           |                |                          |                                        |

| BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,450 % fällig am 01.03.2035           | \$ 16.100      | \$ 15.814                | 0,19                              | 5,125 % fällig am 15.05.2032            | \$ 4.000       | \$ 3.988                 | 0,05                              | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, Series 2010 |                |                          |                                   |
| 5,850 % fällig am 01.11.2027           | 4.700          | 4.818                    | 0,06                              | 5,625 % fällig am 01.04.2035            | 2.000          | 2.019                    | 0,02                              | 5,267 % fällig am 01.05.2027                                                               | \$ 2.200       | \$ 2.246                 | 0,02                              |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029           | 5.100          | 5.357                    | 0,06                              | 5,750 % fällig am 01.02.2027            | 3.100          | 3.144                    | 0,04                              | State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020            |                |                          |                                   |
| Southern California Gas Co.            |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 01.04.2054 (j)        | 6.600          | 6.496                    | 0,08                              | 1,258 % fällig am 01.07.2025                                                               | 24.984         | 24.984                   | 0,30                              |
| 2,600 % fällig am 15.06.2026           | 700            | 688                      | 0,01                              | Visa, Inc.                              |                |                          |                                   | 1,705 % fällig am 01.07.2027                                                               | 6.785          | 6.466                    | 0,08                              |
| 5,200 % fällig am 01.06.2033           | 3.600          | 3.651                    | 0,04                              | 2,250 % fällig am 15.05.2028            | € 3.800        | 4.431                    | 0,05                              |                                                                                            |                |                          |                                   |
| Southern Co.                           |                |                          |                                   | VMware LLC                              |                |                          |                                   |                                                                                            |                |                          |                                   |
| 4,850 % fällig am 15.03.2035           | 1.200          | 1.174                    | 0,01                              | 3,900 % fällig am 21.08.2027            | \$ 6.900       | 6.842                    | 0,08                              |                                                                                            |                |                          |                                   |
| Southern Co. Gas Capital Corp.         |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 15.05.2030            | 19.078         | 19.161                   | 0,23                              |                                                                                            |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 15.01.2031           | 11.390         | 9.796                    | 0,12                              | Volkswagen Group of America Finance LLC |                |                          |                                   |                                                                                            |                |                          |                                   |
| 4,400 % fällig am 30.05.2047           | 600            | 490                      | 0,01                              | 4,950 % fällig am 25.03.2027            | 6.700          | 6.723                    | 0,08                              | NON-AGENCY-MBS                                                                             |                |                          |                                   |
| Spirit AeroSystems, Inc.               |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 27.03.2028            | 2.000          | 2.012                    | 0,02                              | American Home Mortgage Assets Trust                                                        |                |                          |                                   |
| 3,850 % fällig am 15.06.2026           | 1.200          | 1.176                    | 0,01                              | Voya Financial, Inc.                    |                |                          |                                   | 5,339 % fällig am 25.10.2046                                                               | 5.814          | 3.785                    | 0,05                              |
| 9,375 % fällig am 30.11.2029           | 5.700          | 6.055                    | 0,07                              | 5,000 % fällig am 20.09.2034            | 1.000          | 978                      | 0,01                              | Banc of America Funding Trust                                                              |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 15.11.2030           | 16.490         | 18.207                   | 0,22                              | Warnermedia Holdings, Inc.              |                |                          |                                   | 7,621 % fällig am 20.09.2034                                                               | 0              | 0                        | 0,00                              |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust     |                |                          |                                   | 3,755 % fällig am 15.03.2027            | 1.500          | 1.463                    | 0,02                              | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust                                                |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.08.2031           | 1.249          | 1.108                    | 0,01                              | 4,279 % fällig am 15.03.2032            | 1.232          | 1.038                    | 0,01                              | 5,056 % fällig am 25.01.2035                                                               | 283            | 277                      | 0,00                              |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029           | 2.321          | 2.133                    | 0,03                              | 5,141 % fällig am 15.03.2052            | 3.890          | 2.436                    | 0,03                              | 5,396 % fällig am 25.08.2035                                                               | 21             | 19                       | 0,00                              |
| Store Capital LLC                      |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.                       |                |                          |                                   | 5,785 % fällig am 25.02.2034                                                               | 3              | 3                        | 0,01                              |
| 2,750 % fällig am 18.11.2030           | 2.000          | 1.766                    | 0,02                              | 2,393 % fällig am 02.06.2028            | 11.500         | 11.084                   | 0,13                              | 6,971 % fällig am 25.11.2034                                                               | 87             | 83                       | 0,00                              |
| 4,500 % fällig am 15.03.2028           | 800            | 792                      | 0,01                              | 3,196 % fällig am 17.06.2027            | 1.800          | 1.779                    | 0,02                              | Bear Stearns ALT-A Trust                                                                   |                |                          |                                   |
| Store Capital LLC                      |                |                          |                                   | 3,584 % fällig am 22.05.2028            | 7.000          | 6.895                    | 0,08                              | 4,333 % fällig am 25.11.2036                                                               | 341            | 156                      | 0,00                              |
| 5,400 % fällig am 30.04.2030           | 2.300          | 2.331                    | 0,03                              | 4,897 % fällig am 25.07.2033            | 8.099          | 8.103                    | 0,10                              | 4,754 % fällig am 25.06.2046                                                               | 1.734          | 1.566                    | 0,02                              |
| Stryker Corp.                          |                |                          |                                   | 5,389 % fällig am 24.04.2034            | 1.600          | 1.638                    | 0,02                              | Chase Mortgage Finance Trust                                                               |                |                          |                                   |
| 1,950 % fällig am 15.06.2030           | 16.961         | 15.136                   | 0,18                              | 5,557 % fällig am 25.07.2034            | 72.500         | 74.849                   | 0,91                              | 7,291 % fällig am 25.02.2037                                                               | 1              | 1                        | 0,00                              |
| 3,625 % fällig am 11.09.2036           | € 2.100        | 2.456                    | 0,03                              | 5,574 % fällig am 25.07.2029            | 3.300          | 3.408                    | 0,04                              | Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates                                       |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 11.09.2029           | \$ 8.700       | 8.688                    | 0,10                              | 5,707 % fällig am 22.04.2028            | 7.600          | 7.768                    | 0,09                              | 4,664 % fällig am 25.10.2035                                                               | 48             | 46                       | 0,00                              |
| 4,625 % fällig am 11.09.2034           | 550            | 542                      | 0,01                              | 6,303 % fällig am 23.10.2029            | 13.000         | 13.742                   | 0,17                              | 4,714 % fällig am 25.01.2035                                                               | 34             | 33                       | 0,04                              |
| 4,850 % fällig am 10.02.2030           | 5.700          | 5.817                    | 0,07                              | Welltower OP LLC                        |                |                          |                                   | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                                        |                |                          |                                   |
| Sun Communities Operating LP           |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.07.2030            | 14.500         | 14.575                   | 0,18                              | 6,180 % fällig am 25.09.2035                                                               | 6              | 6                        | 0,00                              |
| 4,200 % fällig am 15.04.2032           | 3.400          | 3.223                    | 0,04                              | West Virginia United Health System      |                |                          |                                   | Countrywide Alternative Loan Trust                                                         |                |                          |                                   |
| Systems Energy Resources, Inc.         |                |                          |                                   | 3,129 % fällig am 01.06.2050            | 1.500          | 946                      | 0,01                              | 4,852 % fällig am 20.07.2046                                                               | 3.323          | 2.794                    | 0,03                              |
| 2,140 % fällig am 09.12.2025           | 16.809         | 16.621                   | 0,20                              | Western Midstream Operating LP          |                |                          |                                   | 4,994 % fällig am 25.02.2037                                                               | 29             | 25                       | 0,00                              |
| 5,300 % fällig am 15.12.2034           | 9.100          | 8.998                    | 0,11                              | 5,450 % fällig am 15.11.2034            | 3.000          | 2.943                    | 0,04                              | 5,054 % fällig am 25.08.2035                                                               | 386            | 355                      | 0,01                              |
| T-Mobile USA, Inc.                     |                |                          |                                   | Weyerhaeuser Co.                        |                |                          |                                   | 5,134 % fällig am 25.12.2035                                                               | 1.051          | 914                      | 0,01                              |
| 2,050 % fällig am 15.02.2028           | 14.740         | 13.935                   | 0,17                              | 4,750 % fällig am 15.05.2026            | 8.100          | 8.118                    | 0,10                              | 5,749 % fällig am 25.08.2035                                                               | 1.279          | 1.101                    | 0,01                              |
| 2,250 % fällig am 15.11.2031           | 13.600         | 11.797                   | 0,14                              | 6,875 % fällig am 15.12.2033            | 649            | 718                      | 0,01                              | 5,750 % fällig am 25.04.2047                                                               | 533            | 276                      | 0,00                              |
| 2,550 % fällig am 15.02.2031           | 6.963          | 6.237                    | 0,07                              | 7,350 % fällig am 01.07.2026            | 12.350         | 12.630                   | 0,15                              | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                                          |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.04.2030           | 9.400          | 9.132                    | 0,11                              | 7,375 % fällig am 15.03.2032            | 2.889          | 3.264                    | 0,04                              | 4,894 % fällig am 25.05.2035                                                               | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 4,700 % fällig am 15.01.2035           | 13.500         | 13.085                   | 0,16                              | Williams Cos., Inc.                     |                |                          |                                   | 4,925 % fällig am 25.01.2036                                                               | 127            | 121                      | 0,00                              |
| 4,800 % fällig am 15.07.2028           | 7.600          | 7.704                    | 0,09                              | 5,600 % fällig am 15.03.2035            | 10.000         | 10.285                   | 0,12                              | 5,138 % fällig am 25.11.2034                                                               | 13             | 12                       | 0,00                              |
| Tapestry, Inc.                         |                |                          |                                   | WMG Acquisition Corp.                   |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.10.2034                                                               | 304            | 309                      | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 11.03.2035           | 3.200          | 3.214                    | 0,04                              | 3,750 % fällig am 01.12.2029            | 2.452          | 2.300                    | 0,03                              | 5,500 % fällig am 25.07.2035                                                               | 33             | 14                       | 0,00                              |
| Targa Resources Partners LP            |                |                          |                                   | Wynn Las Vegas LLC                      |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.12.2035                                                               | 177            | 133                      | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am 15.01.2032           | 2.000          | 1.865                    | 0,02                              | 5,250 % fällig am 15.05.2027            | 300            | 300                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.11.2037                                                               | 20             | 9                        | 0,00                              |
| TD SYNEX Corp.                         |                |                          |                                   | Wynn Resorts Finance LLC                |                |                          |                                   | 6,662 % fällig am 20.02.2036                                                               | 13             | 11                       | 0,00                              |
| 2,375 % fällig am 09.08.2028           | 6.836          | 6.405                    | 0,08                              | 6,250 % fällig am 15.03.2033            | 3.900          | 3.927                    | 0,05                              | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                                       |                |                          |                                   |
| Times Square Hotel Trust               |                |                          |                                   | Xcel Energy, Inc.                       |                |                          |                                   | 5,695 % fällig am 25.06.2033                                                               | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026           | 1.666          | 1.671                    | 0,02                              | 4,600 % fällig am 01.06.2032            | 4.220          | 4.130                    | 0,05                              | Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates                       |                |                          |                                   |
| Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC |                |                          |                                   | Yellowstone Energy LP                   |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.12.2033                                                               | 2              | 2                        | 0,00                              |
| 3,250 % fällig am 15.05.2030           | 1.500          | 1.415                    | 0,02                              | 5,750 % fällig am 31.12.2026            | 1.938          | 1.912                    | 0,02                              | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                                                |                |                          |                                   |
| United Airlines Pass-Through Trust     |                |                          |                                   | Zimmer Biomet Holdings, Inc.            |                |                          |                                   | 3,943 % fällig am 27.05.2037                                                               | 3.122          | 2.106                    | 0,03                              |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033           | 5.817          | 5.212                    | 0,06                              | 1,164 % fällig am 15.11.2027            | € 1.720        | 1.953                    | 0,02                              | 4,000 % fällig am 26.06.2037                                                               | 2.710          | 2.633                    | 0,03                              |
| 2,875 % fällig am 07.04.2030           | 437            | 413                      | 0,00                              | 3,518 % fällig am 15.12.2032            | 3.350          | 3.917                    | 0,05                              | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                                              |                |                          |                                   |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029           | 565            | 548                      | 0,01                              | Zoetis, Inc.                            |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 25.07.2047                                                               | 366            | 341                      | 0,01                              |
| 3,450 % fällig am 07.01.2030           | 1.447          | 1.384                    | 0,02                              | 2,000 % fällig am 15.05.2030            | \$ 800         | 719                      | 0,01                              | GS Mortgage Securities Corp. Trust                                                         |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.09.2031           | 13.395         | 12.644                   | 0,15                              |                                         |                |                          |                                   | 5,559 % fällig am 15.07.2035                                                               | 3.262          | 2.188                    | 0,03                              |
| 3,700 % fällig am 01.09.2031           | 4.456          | 4.162                    | 0,05                              |                                         |                |                          |                                   | GSC Capital Corp. Mortgage Trust                                                           |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 11.10.2027           | 1.430          | 1.418                    | 0,02                              |                                         |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.05.2036                                                               | 288            | 276                      | 0,00                              |
| 4,150 % fällig am 25.02.2033           | 8.621          | 8.276                    | 0,10                              |                                         |                |                          |                                   | GSMPS Mortgage Loan Trust                                                                  |                |                          |                                   |
| 4,300 % fällig am 15.02.2027           | 1.388          | 1.386                    | 0,02                              |                                         |                |                          |                                   | 4,784 % fällig am 25.01.2036                                                               | 1.553          | 1.256                    | 0,02                              |
| 4,550 % fällig am 25.02.2033           | 856            | 805                      | 0,01                              |                                         |                |                          |                                   | GSR Mortgage Loan Trust                                                                    |                |                          |                                   |
| 5,800 % fällig am 15.07.2037           | 6.210          | 6.356                    | 0,08                              |                                         |                |                          |                                   | 5,880 % fällig am 25.04.2032                                                               | 87             | 84                       | 0,00                              |
| 5,875 % fällig am 15.04.2029           | 3.372          | 3.444                    | 0,04                              |                                         |                |                          |                                   | 6,562 % fällig am 25.09.2035                                                               | 0              | 0                        | 0,00                              |
| UnitedHealth Group, Inc.               |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   | HarborView Mortgage Loan Trust                                                             |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.08.2059           | 200            | 141                      | 0,00                              |                                         |                |                          |                                   | 4,622 % fällig am 19.08.2037                                                               | 3.523          | 3.105                    | 0,04                              |
| 4,950 % fällig am 15.01.2032           | 8.200          | 8.308                    | 0,10                              |                                         |                |                          |                                   | 4,842 % fällig am 19.12.2036                                                               | 2.883          | 2.263                    | 0,03                              |
| 6,050 % fällig am 15.02.2063           | 9.579          | 9.728                    | 0,12                              |                                         |                |                          |                                   | 5,112 % fällig am 20.06.2035                                                               | 1.190          | 1.134                    | 0,01                              |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC      |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   | 5,997 % fällig am 19.04.2034                                                               | 5              | 4                        | 0,00                              |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033           | 7.800          | 6.827                    | 0,08                              |                                         |                |                          |                                   | HomeBanc Mortgage Trust                                                                    |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 15.08.2031           | 400            | 371                      | 0,00                              |                                         |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.03.2035                                                               | 195            | 158                      | 0,00                              |
| 6,250 % fällig am 15.01.2030           | 29.200         | 30.138                   | 0,36                              |                                         |                |                          |                                   | Impac CMB Trust                                                                            |                |                          |                                   |
| Venture Global LNG, Inc.               |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   | 5,134 % fällig am 25.03.2035                                                               | 72             | 69                       | 0,00                              |
| 8,375 % fällig am 01.06.2031           | 4.100          | 4.261                    | 0,05                              |                                         |                |                          |                                   | IndyMac Mortgage Loan Trust                                                                |                |                          |                                   |
| VICI Properties LP                     |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   | 3,838 % fällig am 25.03.2036                                                               | 612            | 422                      | 0,01                              |
| 3,875 % fällig am 15.02.2029           | 9.075          | 8.784                    | 0,11                              |                                         |                |                          |                                   | JPMorgan Alternative Loan Trust                                                            |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028           | 6.483          | 6.457                    | 0,08                              |                                         |                |                          |                                   | 5,843 % fällig am 26.05.2037                                                               | 177            | 139                      | 0,00                              |
| 4,625 % fällig am 01.12.2029           | 2.825          | 2.777                    | 0,03                              |                                         |                |                          |                                   |                                                                                            |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 15.11.2031           | 1.900          | 1.904                    | 0,02                              |                                         |                |                          |                                   |                                                                                            |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust  |                |                          |                                   | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust        |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.04.2054 -        |                |                          |                                   |
| 4,248 % fällig am 05.07.2033                         | \$ 4.200       | \$ 3.990                 | 0,05                              | 3,874 % fällig am 15.06.2036                 | \$ 2.240       | \$ 2.043                 | 0,03                              | 01.05.2054                            | \$ 6.830       | \$ 6.836                 | 0,08                              |
| JPMorgan Mortgage Trust                              |                |                          |                                   | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.11.2053          | 2.895          | 3.004                    | 0,04                              |
| 6,226 % fällig am 25.07.2035                         | 13             | 12                       | 0,00                              | 6,558 % fällig am 25.08.2036                 | 218            | 202                      | 0,00                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |                |                          |                                   |
| Lehman Mortgage Trust                                |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.07.2055          | 25.900         | 22.415                   | 0,27                              |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037                         | 1.356          | 893                      | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.07.2055 -        |                |                          |                                   |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | 01.08.2055                            | 241.455        | 224.500                  | 2,70                              |
| 6,043 % fällig am 21.11.2034                         | 4              | 4                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.08.2055          | 190.400        | 182.058                  | 2,19                              |
| MASTR Alternative Loan Trust                         |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.07.2055          | 12.985         | 12.727                   | 0,15                              |
| 5,500 % fällig am 25.02.2034                         | 8              | 8                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust               |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,094 % fällig am 25.06.2028                         | 0              | 0                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,205 % fällig am 25.05.2036                         | 229            | 214                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,381 % fällig am 25.01.2029                         | 42             | 41                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,519 % fällig am 25.02.2035                         | 14             | 12                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036                         | 29             | 10                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 25.05.2033                         | 2              | 2                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| MortgageIT Trust                                     |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,174 % fällig am 25.12.2034                         | 57             | 57                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates      |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,884 % fällig am 25.02.2035                         | 181            | 148                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Residential Accredit Loans, Inc. Trust               |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.04.2046                         | 5.463          | 1.389                    | 0,02                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,899 % fällig am 25.08.2035                         | 155            | 123                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037                         | 2.155          | 1.759                    | 0,02                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Residential Asset Securitization Trust               |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037                         | 2.123          | 565                      | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Sequoia Mortgage Trust                               |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,832 % fällig am 20.05.2035                         | 83             | 76                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,076 % fällig am 20.05.2034                         | 299            | 282                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust       |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,520 % fällig am 25.04.2035                         | 152            | 138                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust          |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.07.2046                         | 150            | 104                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.04.2036                         | 64             | 58                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.05.2036                         | 8              | 6                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,932 % fällig am 19.07.2035                         | 1              | 1                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.02.2036                         | 13             | 11                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,859 % fällig am 25.03.2046                         | 83             | 76                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage           |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Pass-Through Certificates                            |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 6,554 % fällig am 25.06.2033                         | 1              | 1                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 6,778 % fällig am 25.07.2033                         | 92             | 90                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Thornburg Mortgage Securities Trust                  |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,400 % fällig am 25.09.2037                         | 84             | 84                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Towd Point Mortgage Trust                            |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 25.06.2057                         | 2.185          | 2.131                    | 0,03                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 25.07.2056                         | 563            | 556                      | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust        |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 2,566 % fällig am 25.11.2041                         | 140            | 130                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,804 % fällig am 25.05.2034                         | 1.216          | 1.134                    | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.12.2045                         | 3              | 3                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,054 % fällig am 25.01.2045                         | 9              | 9                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,064 % fällig am 25.03.2035                         | 39             | 40                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,399 % fällig am 25.08.2046                         | 5              | 4                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Trust                                                |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.06.2037                         | 2.652          | 2.445                    | 0,03                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 5,239 % fällig am 25.11.2046                         | 1.778          | 1.492                    | 0,02                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through          |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Certificates Trust                                   |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,699 % fällig am 25.06.2033                         | 57             | 49                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Wells Fargo Alternative Loan Trust                   |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.03.2037                         | 907            | 731                      | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| 6,520 % fällig am 25.07.2037                         | 118            | 110                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                            | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|----------------------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BUS                     | 2,700 %    | 24.06.2025            | 08.07.2025            | CAD 210.000   | Province of Ontario 4,150 % fällig am 02.06.2034                           | \$ (157.840)               | \$ 153.903                     | \$ 154.120                                                     | 1,84                    |
| CEW                     | 2,710      | 24.06.2025            | 08.07.2025            | 100.000       | Province of Alberta 3,050 % fällig am 01.12.2048                           | (25.183)                   | 73.287                         | 73.391                                                         | 0,88                    |
|                         |            |                       |                       |               | Province of British Columbia 4,250 % fällig<br>am 18.12.2053               | (49.665)                   |                                |                                                                |                         |
|                         | 2,720      | 27.06.2025            | 07.07.2025            | 120.000       | Province of Alberta 3,100 % fällig am 01.06.2050                           | (58.436)                   | 87.944                         | 88.034                                                         | 1,06                    |
|                         |            |                       |                       |               | Province of Quebec 3,500 % fällig am<br>01.12.2045 - 01.12.2048            | (32.478)                   |                                |                                                                |                         |
|                         | 2,720      | 30.06.2025            | 09.07.2025            | 100.000       | Province of Ontario 2,900 % - 3,750 % fällig am<br>02.06.2049 - 02.12.2053 | (75.464)                   | 73.287                         | 73.354                                                         | 0,88                    |
|                         | 2,730      | 24.06.2025            | 08.07.2025            | 100.000       | Province of Alberta 3,050 % fällig am 01.12.2048                           | (1.272)                    | 73.287                         | 73.392                                                         | 0,88                    |
|                         |            |                       |                       |               | Province of Newfoundland and Labrador 3,300 %<br>fällig am 17.10.2046      | (51.141)                   |                                |                                                                |                         |
| FICC                    | 4,400      | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 19.600     | Province of Ontario 1,900 % fällig am 02.12.2051                           | (22.396)                   |                                |                                                                |                         |
|                         |            |                       |                       |               | U.S. Treasury Notes 3,750 % fällig am 30.06.2027                           | (19.994)                   | 19.600                         | 19.600                                                         | 0,24                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                                            | \$ (493.869)               | \$ 481.308                     | \$ 481.891                                                     | 5,78                    |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2027     | 1.489                | \$ 3.509                                 | 0,04                 |
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2028     | 879                  | 1.816                                    | 0,02                 |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2027     | 2.268                | 5.108                                    | 0,06                 |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Long  | 06.2027     | 2.908                | 6.772                                    | 0,08                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2026     | 1.722                | 4.059                                    | 0,05                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2027     | 1.610                | 3.187                                    | 0,04                 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures     | Long  | 09.2025     | 122                  | 93                                       | 0,00                 |
| Euro-Bobl September Futures                          | Long  | 09.2025     | 838                  | (527)                                    | (0,01)               |
| Euro-BTP September Futures                           | Long  | 09.2025     | 463                  | 249                                      | 0,00                 |
| Euro-Bund September Futures                          | Long  | 09.2025     | 3.309                | (3.985)                                  | (0,05)               |
| Euro-Schatz September Futures                        | Long  | 09.2025     | 2.246                | (497)                                    | (0,01)               |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 6.952                | 5.815                                    | 0,07                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 3.570                | 3.415                                    | 0,04                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Short | 09.2025     | 186                  | (334)                                    | 0,00                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Long  | 09.2025     | 2.512                | 4.763                                    | 0,06                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 2.522                | 10.358                                   | 0,13                 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025     | 224                  | 649                                      | 0,01                 |
|                                                      |       |             |                      | \$ 44.450                                | 0,53                 |

## OPTIONSKAUF

## FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                              | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------------|----------------|---------------|----------------------|----------|-----------|----------------------|
| Call - CME 3-Month SOFR Active Contract June 2026 Futures | \$ 97,500      | 12.06.2026    | 2.178                | \$ 1.705 | \$ 926    | 0,01                 |
| Call - CME 3-Month SOFR Active Contract June 2026 Futures | 98,000         | 12.06.2026    | 2.271                | 1.106    | 553       | 0,01                 |
|                                                           |                |               |                      | \$ 2.811 | \$ 1.479  | 0,02                 |

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                               | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld    | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|------------|-----------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 126                  | \$ (42)    | \$ (4)    | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,000       | 25.07.2025    | 244                  | (104)      | (8)       | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,500       | 25.07.2025    | 128                  | (42)       | (8)       | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 110,250       | 25.07.2025    | 118                  | (29)       | (15)      | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,000       | 25.07.2025    | 126                  | (43)       | (94)      | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,500       | 25.07.2025    | 372                  | (143)      | (198)     | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,750       | 25.07.2025    | 118                  | (37)       | (52)      | 0,00                 |
| Call - CME 3-Month SOFR Active Contract June 2026 Futures  | 98,500        | 12.06.2026    | 2.178                | (596)      | (300)     | (0,01)               |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                  | € 117,250     | 25.07.2025    | 43                   | (9)        | (9)       | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                 | 118,500       | 25.07.2025    | 43                   | (8)        | (5)       | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                  | 129,000       | 25.07.2025    | 29                   | (13)       | (11)      | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                 | 132,500       | 25.07.2025    | 29                   | (15)       | (5)       | 0,00                 |
|                                                            |               |               |                      | \$ (1.081) | \$ (709)  | (0,01)               |
|                                                            |               |               |                      | \$ 45.220  | 0,54      |                      |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit    | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Ford Motor Co.     | (5,000) %                   | 20.06.2030       | \$ 12.300                 | \$ (334)                                 | 0,00                 |
| General Motors Co. | (5,000)                     | 20.06.2030       | 21.100                    | (395)                                    | (0,01)               |
|                    |                             |                  |                           | \$ (729)                                 | (0,01)               |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Referenzeinheit                    | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| AES Corp.                          | 5,000 %                     | 20.12.2025       | \$ 7.900                  | \$ (1.372)                               | (0,01)               |
| AES Corp.                          | 5,000                       | 20.06.2026       | 2.400                     | (380)                                    | 0,00                 |
| Airbus Group Finance BV            | 1,000                       | 20.06.2029       | € 14.700                  | 166                                      | 0,00                 |
| American International Group, Inc. | 1,000                       | 20.12.2027       | \$ 8.000                  | 182                                      | 0,00                 |
| AT&T, Inc.                         | 1,000                       | 20.12.2025       | 2.000                     | (18)                                     | 0,00                 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Referenzeinheit                       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| AT&T, Inc.                            | 1,000 %                        | 20.06.2026       | 54.000                    | \$ (501)                                        | (0,01)                  |
| AT&T, Inc.                            | 1,000                          | 20.12.2026       | 1.300                     | (8)                                             | 0,00                    |
| AT&T, Inc.                            | 1,000                          | 20.06.2028       | 29.600                    | 634                                             | 0,01                    |
| Bank of America Corp.                 | 1,000                          | 20.12.2026       | 8.700                     | (30)                                            | 0,00                    |
| Barclays Bank PLC                     | 1,000                          | 20.12.2025       | € 4.700                   | (6)                                             | 0,00                    |
| BNP Paribas S.A.                      | 1,000                          | 20.12.2025       | 13.900                    | (21)                                            | 0,00                    |
| Boeing Co.                            | 1,000                          | 20.12.2025       | \$ 900                    | 7                                               | 0,00                    |
| Boeing Co.                            | 1,000                          | 20.06.2026       | 800                       | 10                                              | 0,00                    |
| BP Capital Markets PLC                | 1,000                          | 20.12.2025       | € 6.800                   | (84)                                            | 0,00                    |
| Elis S.A.                             | 5,000                          | 20.12.2029       | 2.000                     | 23                                              | 0,00                    |
| General Electric Co.                  | 1,000                          | 20.06.2026       | \$ 18.750                 | (66)                                            | 0,00                    |
| General Electric Co.                  | 1,000                          | 20.12.2026       | 2.000                     | 3                                               | 0,00                    |
| General Motors Co.                    | 5,000                          | 20.12.2026       | 2.050                     | (271)                                           | 0,00                    |
| General Motors Co.                    | 5,000                          | 20.06.2028       | 2.435                     | 2                                               | 0,00                    |
| Glencore Finance Europe Ltd.          | 5,000                          | 20.06.2028       | € 2.700                   | (16)                                            | 0,00                    |
| Glencore Finance Europe Ltd.          | 5,000                          | 20.12.2029       | 2.700                     | (14)                                            | 0,00                    |
| Glencore Finance Europe Ltd.          | 5,000                          | 20.06.2031       | 9.500                     | 126                                             | 0,00                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.             | 1,000                          | 20.06.2026       | \$ 10.200                 | 6                                               | 0,00                    |
| Hess Corp.                            | 1,000                          | 20.06.2026       | 7.000                     | 115                                             | 0,00                    |
| Lennar Corp.                          | 5,000                          | 20.12.2026       | 3.200                     | (443)                                           | (0,01)                  |
| MetLife, Inc.                         | 1,000                          | 20.06.2028       | 600                       | 22                                              | 0,00                    |
| MGM Resorts International             | 5,000                          | 20.12.2029       | 2.000                     | (12)                                            | 0,00                    |
| Mundys SpA                            | 1,000                          | 20.12.2025       | € 1.800                   | 90                                              | 0,00                    |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000                          | 20.06.2026       | \$ 11.300                 | (172)                                           | 0,00                    |
| T-Mobile USA, Inc.                    | 5,000                          | 20.06.2028       | 7.800                     | (289)                                           | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.          | 1,000                          | 20.06.2026       | 1.900                     | (30)                                            | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.          | 1,000                          | 20.12.2027       | 500                       | 17                                              | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.          | 1,000                          | 20.06.2028       | 9.400                     | 184                                             | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.          | 1,000                          | 20.12.2028       | 2.300                     | 47                                              | 0,00                    |
|                                       |                                |                  |                           | \$ (2.099)                                      | (0,02)                  |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.HY-44 5-Year Index | (5,000) %                      | 20.06.2030       | \$ 70.500                 | \$ (3.813)                                      | (0,05)                  |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 2.826.500              | \$ 12.041                                       | 0,15                    |
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index   | 5,000                          | 20.06.2030       | € 8.610                   | 170                                             | 0,00                    |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 80.000                    | 232                                             | 0,00                    |
|                                    |                                |                  |                           | \$ 12.443                                       | 0,15                    |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex             | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 226.960   | \$ 4.426                                        | 0,05                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2030       | \$ 106.200  | (655)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,281           | 15.02.2040       | 110.000     | 7.948                                           | 0,10                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 20.06.2054       | 72.765      | 2.982                                           | 0,04                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,514           | 04.09.2034       | 13.100      | 301                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,620           | 30.11.2029       | 222.481     | (2.065)                                         | (0,02)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,642           | 15.02.2055       | 4.790       | 237                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2029       | 60.600      | 539                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 15.05.2032       | 155.211     | (2.206)                                         | (0,03)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,842           | 04.03.2030       | 11.500      | (171)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,848           | 15.02.2055       | 1.900       | 24                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,900           | 15.02.2035       | 13.200      | (193)                                           | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,901           | 15.02.2035       | 204.540     | (3.607)                                         | (0,04)                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,915           | 15.02.2055       | 13.000      | 12                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,943           | 15.02.2055       | 12.000      | (46)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,945           | 15.02.2055       | 12.500      | (53)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 12,030          | 04.01.2027       | BRL 549.100 | (2.413)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,402          | 02.01.2029       | 439.400     | 669                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927          | 04.01.2027       | 644.100     | (334)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,500           | 17.06.2030       | CAD 244.800 | 11.222                                          | 0,14                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2034       | 10.200      | (82)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 18.12.2025       | 173.000     | 1.115                                           | 0,01                    |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 01.06.2032       | 57.900      | (2.218)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250           | 19.03.2030       | AUD 156.200 | 1.806                                           | 0,02                    |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,000           | 17.03.2053       | € 28.430    | 15.361                                          | 0,18                    |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 0,175 %         | 17.03.2033       | \$ 63.090  | \$ (12.335)                                     | (0,15)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 0,650           | 12.04.2027       | 88.900     | (2.313)                                         | (0,03)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 0,700           | 11.04.2027       | 5.400      | (139)                                           | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 1,000           | 13.05.2027       | 62.700     | (1.219)                                         | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 1,000           | 18.05.2027       | 28.000     | (549)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250           | 17.09.2030       | 238.950    | 2.426                                           | 0,03                    |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250           | 17.09.2055       | 9.600      | 393                                             | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,500           | 20.03.2054       | 17.300     | 2.625                                           | 0,03                    |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIE         | 7,582           | 02.04.2030       | MXN 66.000 | (13)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIE         | 7,768           | 12.06.2030       | 45.700     | (8)                                             | 0,00                    |
|                                                |                        |                 |                  |            | \$ 21.467                                       | 0,26                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                 |                  |            | \$ 27.269                                       | 0,33                    |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Kauf                    | 98,000 %      | 17.09.2025    | 370.300                   | \$ 4.240 | \$ 494    | 0,01                    |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|-------------------------|
| BPS        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 2,500 %       | 29.04.2026    | 343.500                   | \$ 1.618 | \$ 1.028  | 0,01                    |
| FAR        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 2,000         | 29.04.2026    | 401.000                   | 1.103    | 613       | 0,01                    |
|            |                                      |                        |                                             |               |               |                           | \$ 2.721 | \$ 1.641  | 0,02                    |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %       | 16.07.2025    | 13.600                    | \$ (19) | \$ (1)    | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 27.000                    | (31)    | (2)       | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000         | 16.07.2025    | 12.900                    | (13)    | (1)       | 0,00                    |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850         | 16.07.2025    | 14.100                    | (17)    | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 12.500                    | (15)    | (1)       | 0,00                    |
|            |                                  |                         |               |               |                           | \$ (95) | \$ (6)    | 0,00                    |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|--------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                               | 3,555 %       | 24.07.2025    | 5.900                     | \$ (19) | \$ (21)   | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                               | 3,637         | 18.07.2025    | 6.500                     | (20)    | (33)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                               | 3,700         | 21.07.2025    | 5.900                     | (19)    | (46)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                               | 3,770         | 09.07.2025    | 6.100                     | (19)    | (56)      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                              | 3,905         | 24.07.2025    | 5.900                     | (19)    | (11)      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                              | 4,037         | 18.07.2025    | 6.500                     | (20)    | (3)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                              | 4,050         | 21.07.2025    | 5.900                     | (19)    | (3)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                              | 4,120         | 09.07.2025    | 6.100                     | (19)    | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                               | 1,500         | 29.04.2026    | 343.500                   | (515)   | (266)     | (0,01)                  |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                               | 3,564         | 24.07.2025    | 5.900                     | (20)    | (23)      | 0,00                    |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                               | 3,605         | 23.07.2025    | 6.300                     | (23)    | (30)      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                              | 3,914         | 24.07.2025    | 5.900                     | (18)    | (10)      | 0,00                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatz/Indizes | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|----------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|------------|------------|----------------------|
| FAR        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 3,955 %       | 23.07.2025    | 6.300                     | \$ (21)    | \$ (8)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR        | Erhalt                            | 2,380         | 03.07.2025    | 2.700                     | (7)        | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR        | Erhalt                            | 2,460         | 16.07.2025    | 3.700                     | (11)       | (4)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR        | Zahlung                           | 2,640         | 03.07.2025    | 2.700                     | (7)        | (3)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR        | Zahlung                           | 2,720         | 16.07.2025    | 3.700                     | (11)       | (6)        | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,750         | 03.07.2025    | 7.700                     | (29)       | (52)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,790         | 09.07.2025    | 7.500                     | (24)       | (78)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,100         | 03.07.2025    | 7.700                     | (29)       | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,140         | 09.07.2025    | 7.500                     | (25)       | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,525         | 28.07.2025    | 5.800                     | (19)       | (19)       | 0,00                 |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,583         | 23.07.2025    | 3.100                     | (11)       | (13)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,653         | 14.07.2025    | 7.900                     | (24)       | (34)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,680         | 07.07.2025    | 3.200                     | (11)       | (12)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,695         | 17.07.2025    | 6.200                     | (18)       | (43)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,775         | 07.07.2025    | 6.500                     | (20)       | (58)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 3,875         | 28.07.2025    | 5.800                     | (19)       | (15)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 3,933         | 23.07.2025    | 3.100                     | (11)       | (4)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,030         | 07.07.2025    | 3.200                     | (11)       | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,053         | 14.07.2025    | 7.900                     | (24)       | (1)        | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,095         | 17.07.2025    | 6.200                     | (18)       | (1)        | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,125         | 07.07.2025    | 6.500                     | (20)       | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,772         | 10.07.2025    | 6.300                     | (21)       | (60)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,122         | 10.07.2025    | 6.300                     | (21)       | 0          | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,664         | 14.07.2025    | 8.600                     | (26)       | (41)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,669         | 07.07.2025    | 6.100                     | (23)       | (20)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,697         | 16.07.2025    | 5.900                     | (17)       | (40)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,715         | 02.07.2025    | 6.800                     | (24)       | (28)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                            | 3,725         | 03.07.2025    | 6.100                     | (23)       | (33)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,019         | 07.07.2025    | 6.100                     | (23)       | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,064         | 14.07.2025    | 8.600                     | (26)       | (1)        | 0,00                 |
| MYC        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,065         | 02.07.2025    | 6.800                     | (24)       | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,075         | 03.07.2025    | 6.100                     | (23)       | 0          | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                           | 4,097         | 16.07.2025    | 5.900                     | (17)       | (1)        | 0,00                 |
|            |                                       |                            |                                   |               |               |                           | \$ (1.368) | \$ (1.077) | (0,01)               |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | \$ 92,469     | 07.07.2025    | 3.700                     | \$ (20) | \$ 0      | 0,00                 |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469        | 07.07.2025    | 3.700                     | (18)    | (1)       | 0,00                 |
|            |                                                                               |               |               |                           | \$ (38) | \$ (1)    | 0,00                 |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond       | 1,000 %                     | 20.06.2026       | \$ 1.100                  | \$ (38)                                | \$ 44                                     | \$ 6      | 0,00                 |
| BRC        | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.      | 1,000                       | 20.12.2025       | 7.800                     | 169                                    | (136)                                     | 33        | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 1,000                       | 20.12.2029       | 8.000                     | (1.108)                                | 179                                       | (929)     | (0,01)               |
|            | Equinix, Inc.                              | 5,000                       | 20.06.2027       | 4.500                     | 629                                    | (256)                                     | 373       | 0,00                 |
| GST        | Petroleos Mexicanos                        | 1,000                       | 20.12.2029       | 500                       | (73)                                   | 15                                        | (58)      | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 4,850                       | 07.05.2026       | 4.992                     | 0                                      | 60                                        | 60        | 0,00                 |
|            | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000                       | 20.12.2026       | 1.400                     | 33                                     | (19)                                      | 14        | 0,00                 |
| MYC        | SoftBank Group Corp.                       | 1,000                       | 20.06.2026       | 3.200                     | (27)                                   | 13                                        | (14)      | 0,00                 |
|            | Brazil Government International Bond       | 1,000                       | 20.06.2027       | 15.800                    | (978)                                  | 1.085                                     | 107       | 0,00                 |
|            |                                            |                             |                  |                           | \$ (1.393)                             | \$ 985                                    | \$ (408)  | (0,01)               |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen               | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BRC        | iTraxx Japan 43 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.06.2030       | ¥ 1.844.200               | \$ 275                                 | \$ (30)                                   | \$ 245    | 0,00                 |
| JPM        | iTraxx Japan 43 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2030       | 9.259.500                 | 1.391                                  | (163)                                     | 1.228     | 0,02                 |
|            |                              |                             |                  |                           | \$ 1.666                               | \$ (193)                                  | \$ 1.473  | 0,02                 |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende |            | Zu erhaltende |            | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |        |
|------------|------------------|-------------|------------|---------------|------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|--------|
|            |                  | Währung     |            | Währung       |            |                               |                                 |                                                |                      |        |
| AZD        | 07.2025          | CAD         | 2.138      | \$            | 1.568      | \$                            | 0                               | \$                                             | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | CNH         | 21.208     |               | 2.937      |                               | 0                               |                                                | (27)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | €           | 5.191      |               | 6.078      |                               | 0                               |                                                | (15)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$          | 688        | CNH           | 4.948      |                               | 3                               |                                                | 3                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 423        | €             | 372        |                               | 14                              |                                                | 14                   | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 5.107      | £             | 3.722      |                               | 0                               |                                                | (7)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 442        | NZD           | 734        |                               | 4                               |                                                | 4                    | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH         | 60.049     | \$            | 8.409      |                               | 0                               |                                                | (6)                  | 0,00   |
|            | 08.2025          | £           | 3.722      |               | 5.107      |                               | 7                               |                                                | 7                    | 0,00   |
|            | 08.2025          | NZD         | 734        |               | 442        |                               | 0                               |                                                | (4)                  | 0,00   |
|            | 08.2025          | \$          | 1.568      | CAD           | 2.135      |                               | 0                               |                                                | 0                    | 0,00   |
|            | 08.2025          |             | 1.384      | CNH           | 9.981      |                               | 15                              |                                                | 15                   | 0,00   |
|            | 08.2025          |             | 6.091      | €             | 5.191      |                               | 15                              |                                                | 15                   | 0,00   |
|            | 07.2025          | AUD         | 4.496      | \$            | 2.915      |                               | 0                               |                                                | (32)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | IDR         | 69.874.002 |               | 4.283      |                               | 0                               |                                                | (20)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | SGD         | 8          |               | 7          |                               | 0                               |                                                | 0                    | 0,00   |
| BOA        | 07.2025          | \$          | 1.474      | KRW           | 2.008.876  |                               | 12                              |                                                | 12                   | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH         | 7.260      | \$            | 1.015      |                               | 0                               |                                                | (3)                  | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD         | 497        |               | 15         |                               | 0                               |                                                | (2)                  | 0,00   |
|            | 08.2025          | \$          | 4.608      | CNH           | 32.950     |                               | 9                               |                                                | 9                    | 0,00   |
|            | 08.2025          |             | 7          | SGD           | 8          |                               | 0                               |                                                | 0                    | 0,00   |
|            | 08.2025          |             | 1.656      | TWD           | 48.552     |                               | 32                              |                                                | 32                   | 0,00   |
|            | 07.2025          | CAD         | 530.516    | \$            | 386.566    |                               | 117                             | (2.465)                                        | (2.348)              | (0,03) |
|            | 07.2025          | THB         | 492        |               | 15         |                               | 0                               |                                                | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | TRY         | 79.594     |               | 1.949      |                               | 0                               |                                                | (15)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD         | 96.677     |               | 2.975      |                               | 0                               |                                                | (353)                | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$          | 57         | BRL           | 323        |                               | 3                               |                                                | 3                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 7.480      | CAD           | 10.208     |                               | 1                               |                                                | 1                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 179        | €             | 155        |                               | 4                               |                                                | 4                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 1.244      | IDR           | 20.308.047 |                               | 6                               |                                                | 6                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 780        | THB           | 25.810     |                               | 15                              |                                                | 15                   | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH         | 53.170     | \$            | 7.444      |                               | 0                               |                                                | (7)                  | 0,00   |
| 08.2025    | INR              | 5.746       |            | 66            |            | 0                             |                                 | (1)                                            | 0,00                 |        |
| 08.2025    | TRY              | 163.897     |            | 3.950         |            | 0                             |                                 | (45)                                           | 0,00                 |        |
| 08.2025    | TWD              | 77.108      |            | 2.364         |            | 0                             |                                 | (316)                                          | 0,00                 |        |
| 08.2025    | \$               | 4.657       | CNH        | 33.219        |            | 0                             |                                 | (2)                                            | 0,00                 |        |
| 08.2025    |                  | 99          | TWD        | 3.237         |            | 14                            |                                 | 14                                             | 0,00                 |        |
| 05.2026    |                  | 1.620       | KWD        | 494           |            | 0                             |                                 | (6)                                            | 0,00                 |        |
| 06.2026    |                  | 1.071       |            | 327           |            | 0                             |                                 | (2)                                            | 0,00                 |        |
| 06.2027    |                  | 504         |            | 153           |            | 0                             |                                 | (4)                                            | 0,00                 |        |
| 05.2029    | KWD              | 2.365       | \$         | 8.131         |            | 355                           |                                 | 355                                            | 0,00                 |        |
| 07.2029    |                  | 466         |            | 1.602         |            | 70                            |                                 | 70                                             | 0,00                 |        |
| BRC        | 07.2025          | €           | 1.051.901  |               | 1.194.709  |                               | 0                               | (40.064)                                       | (40.064)             | (0,48) |
|            | 07.2025          | ILS         | 98         |               | 29         |                               | 0                               |                                                | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | KRW         | 124.720    |               | 91         |                               | 0                               |                                                | (1)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          | NOK         | 198        |               | 19         |                               | 0                               |                                                | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | PLN         | 2.615      |               | 698        |                               | 0                               |                                                | (25)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | TRY         | 123.056    |               | 3.043      |                               | 0                               |                                                | (33)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$          | 367.639    | £             | 270.214    | 2.647                         | 0                               | 2.647                                          | 0,03                 |        |
|            | 07.2025          |             | 58         | ILS           | 204        | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 244        | ¥             | 35.114     | 0                             |                                 | (1)                                            | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 37         | KRW           | 51.474     | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 3.830      | TRY           | 156.971    | 71                            | 0                               | 71                                             | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | ZAR         | 949.112    | \$            | 52.507     | 0                             |                                 | (816)                                          | (816)                | (0,01) |
|            | 08.2025          | £           | 269.310    |               | 366.475    | 0                             |                                 | (2.627)                                        | (2.627)              | (0,03) |
|            | 08.2025          | \$          | 4.992      | TRY           | 207.350    | 65                            | 0                               | 65                                             | 0,00                 |        |
|            | 09.2025          |             | 293        | MXN           | 5.639      | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |        |
|            | BSH              | 07.2025     | DKK        | 69.202        | \$         | 10.539                        | 0                               |                                                | (349)                | (349)  |
| 07.2025    |                  | PEN         | 40.823     |               | 11.039     | 0                             |                                 | (459)                                          | (459)                | (0,01) |
| 09.2025    |                  |             | 18.787     |               | 5.146      | 0                             |                                 | (135)                                          | (135)                | 0,00   |
| 09.2025    |                  | \$          | 313        | PEN           | 1.135      | 6                             | 0                               | 6                                              | 0,00                 |        |
| CBK        | 07.2025          | CAD         | 9.394      | \$            | 6.796      | 0                             |                                 | (89)                                           | (89)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | €           | 32.856     |               | 37.801     | 0                             |                                 | (767)                                          | (767)                | (0,01) |
|            | 07.2025          | £           | 5.702      |               | 7.757      | 0                             |                                 | (57)                                           | (57)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | ¥           | 234.600    |               | 1.648      | 24                            | 0                               | 24                                             | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | KRW         | 10.119.722 |               | 7.363      | 0                             |                                 | (119)                                          | (119)                | 0,00   |
|            | 07.2025          | THB         | 25.762     |               | 775        | 0                             |                                 | (19)                                           | (19)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD         | 167.668    |               | 5.154      | 0                             |                                 | (618)                                          | (618)                | (0,01) |
|            | 07.2025          | \$          | 42.798     | BRL           | 250.257    | 3.054                         | 0                               | 3.054                                          | 0,04                 |        |
|            | 07.2025          |             | 1.976      | CHF           | 1.608      | 44                            | 0                               | 44                                             | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 23.076     | £             | 17.026     | 256                           | 0                               | 256                                            | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 1.086      | IDR           | 17.686.693 | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 5.626      | KRW           | 7.707.386  | 73                            | 0                               | 73                                             | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 124        | PEN           | 453        | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 312        | THB           | 10.417     | 9                             | 0                               | 9                                              | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |             | 11.324     | TWD           | 336.540    | 262                           | 0                               | 262                                            | 0,00                 |        |
|            | 08.2025          | INR         | 36.042     | \$            | 418        | 0                             |                                 | (1)                                            | (1)                  | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD         | 162.893    |               | 5.000      | 0                             |                                 | (662)                                          | (662)                | (0,01) |
|            | 08.2025          | \$          | 442        | CNH           | 3.179      | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |        |
|            | 08.2025          |             | 527        | INR           | 45.350     | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |        |
|            | 08.2025          |             | 518        | PEN           | 1.868      | 7                             | 0                               | 7                                              | 0,00                 |        |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| DUB        | 11.2025          | PEN                    | \$                       | 2.335                            | \$ 0                               | \$ (64)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | DKK                      | 51.736                           | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | ILS                      | 99                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 277                    | TWD                      | 8.230                            | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | \$                       | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    |                          | 8.124                            | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    |                          | 229                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    |                          | 43.338                           | 0                                  | (2.584)                                              | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | CAD                    |                          | 2.629                            | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | CHF                    |                          | 1.963                            | 0                                  | (57)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      |                          | 34.082                           | 0                                  | (263)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    |                          | 53                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | AUD                      | 261.168                          | 405                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 706                    | CNH                      | 5.076                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 11.050                 | DKK                      | 70.318                           | 14                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 8                      | HKD                      | 60                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 135.041                | ¥                        | 19.372.652                       | 0                                  | (923)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | 4.797                  | PLN                      | 17.690                           | 97                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | \$                       | 170.857                          | 0                                  | (408)                                                | (0,01)                  |
| GLM        | 08.2025          | CNH                    |                          | 7.842                            | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    |                          | 11.050                           | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    |                          | 110                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | CHF                      | 296                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 34.082                 | ¥                        | 4.942.735                        | 263                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 9                      | SGD                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | \$                       | 38.758                           | 0                                  | (867)                                                | (0,01)                  |
|            | 09.2025          | PEN                    |                          | 22.907                           | 0                                  | (856)                                                | (0,01)                  |
|            | 09.2025          | \$                     | BRL                      | 20.906                           | 45                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | 0                      | PEN                      | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 11.2025          | PEN                    | \$                       | 1.820                            | 0                                  | (50)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    |                          | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    |                          | 522                              | 0                                  | (63)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | €                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 257                    | IDR                      | 4.195.360                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 16                     | TWD                      | 535                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | \$                       | 219                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | SGD                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 166                    | TWD                      | 5.439                            | 23                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | \$                       | 2.792                            | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | DKK                    |                          | 8.122                            | 0                                  | (316)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      |                          | 11.219                           | 0                                  | (181)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    |                          | 438                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    |                          | 7.481                            | 0                                  | (292)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    |                          | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    |                          | 3.009                            | 0                                  | (360)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | CAD                      | 713                              | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 670                    | CNH                      | 4.830                            | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 125                    | DKK                      | 815                              | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 468                    | KRW                      | 641.820                          | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | 8.632                  | PLN                      | 31.904                           | 193                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 59                     | SGD                      | 76                               | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.417                  | TWD                      | 42.089                           | 32                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | \$                       | 15.058                           | 0                                  | (61)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    |                          | 7.954                            | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    |                          | 74                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 2.755                            | 0                                  | (365)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 20.736                           | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 4                      | SGD                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | \$                       | 1.215                            | 0                                  | (26)                                                 | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CAD                    |                          | 155.494                          | 0                                  | (601)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | €                      |                          | 13.709                           | 0                                  | (313)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      |                          | 26.499                           | 16                                 | (324)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    |                          | 5.364                            | 0                                  | (193)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    |                          | 114                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    |                          | 391                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    |                          | 1.451                            | 0                                  | (177)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CAD                      | 120.761                          | 650                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 640                    | CNH                      | 4.611                            | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 6.087                  | €                        | 5.191                            | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | 6.159                  | £                        | 4.544                            | 68                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 217                    | IDR                      | 3.522.770                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 5.915                  | ¥                        | 849.780                          | 0                                  | (32)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 142                    | SGD                      | 182                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 468                    | THB                      | 15.607                           | 13                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.254                  | TWD                      | 39.732                           | 114                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | \$                       | 87.851                           | 0                                  | (652)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | CNH                    |                          | 1.990                            | 0                                  | (19)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 1.941                            | 0                                  | (244)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 4.624                            | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 08.2025          | 114                    | SGD                      | 147                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | \$                       | 221                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu zahlende Betrag | Zu erhaltende Währung | Zu erhaltende Betrag | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| RYL SCX    | 07.2025          | ¥                   | 1.580.515          | \$                    | 10.838               | \$ 0                          | \$ (104)                        | \$ (104)                                       | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 184                |                       | 19                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 354                |                       | 277                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 4.493              | CAD                   | 6.146                | 11                            | 0                               | 11                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 408                | €                     | 348                  | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 8.417              | £                     | 6.135                | 1                             | (9)                             | (8)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.029              | ¥                     | 437.622              | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 186                | NOK                   | 1.875                | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 25                 | PLN                   | 92                   | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 10                 | SEK                   | 93                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 10                 | SGD                   | 12                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 57.200             | \$                    | 7.990                | 0                             | (26)                            | (26)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 1.875              |                       | 186                  | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 10.838             | ¥                     | 1.574.705            | 104                           | 0                               | 104                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 2.170              | CNH                   | 15.719               | 33                            | 0                               | 33                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 8.175              | \$                    | 5.972                | 8                             | (27)                            | (19)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 11.340.161         |                       | 78.218               | 0                             | (290)                           | (290)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 29                 |                       | 23                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.197              | IDR                   | 19.511.279           | 4                             | 0                               | 4                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 0                  | ILS                   | 2                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 12.567             | TWD                   | 371.894              | 235                           | 0                               | 235                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 98.546             | \$                    | 13.795               | 0                             | (14)                            | (14)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | INR                 | 6.643              |                       | 77                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 22.109             |                       | 678                  | 0                             | (91)                            | (91)                                           | 0,00                 |
| 08.2025    | \$               | 9.522               | CNH                | 68.956                | 140                  | 0                             | 140                             | 0,00                                           |                      |
| SOG        | 08.2025          |                     | 14                 | ¥                     | 1.954                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 23                 | SGD                   | 29                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 229.277            | \$                    | 1.588                | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.906              | CAD                   | 2.600                | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 482                | €                     | 419                  | 10                            | 0                               | 10                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 19                 | NOK                   | 195                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | INR                 | 38                 | \$                    | 0                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 195                |                       | 19                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SSB        | 08.2025          | \$                  | 1.588              | ¥                     | 228.436              | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 261.995            | \$                    | 354.746              | 0                             | (4.278)                         | (4.278)                                        | (0,05)               |
|            | 07.2025          | PEN                 | 107.784            |                       | 29.250               | 0                             | (1.104)                         | (1.104)                                        | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 3.106              | CAD                   | 4.231                | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| UAG        | 11.2025          | PEN                 | 12.618             | \$                    | 3.420                | 0                             | (123)                           | (123)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 1.872              |                       | 184                  | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 2.088              |                       | 63                   | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | \$                  | 4                  | ILS                   | 15                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.973              | ¥                     | 285.542              | 4                             | 0                               | 4                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          |                     | 702                | MXN                   | 13.601               | 13                            | 0                               | 13                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 254.778            | \$                    | 164.277              | 0                             | (2.692)                         | (2.692)                                        | (0,03)               |
|            | 07.2025          | ¥                   | 2.634.477          |                       | 18.294               | 55                            | 0                               | 55                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.285.611          | €                     | 1.096.330            | 1.315                         | 0                               | 1.315                                          | 0,01                 |
|            | 08.2025          | €                   | 1.096.330          | \$                    | 1.288.417            | 0                             | (1.316)                         | (1.316)                                        | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 18.294             | ¥                     | 2.624.781            | 0                             | (55)                            | (55)                                           | 0,00                 |
|            |                  |                     |                    |                       |                      | \$ 11.190                     | \$ (70.724)                     | \$ (59.534)                                    | (0,72)               |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |      |      |      |      |      |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|------|------|------|------|------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                 | 2.265                 | \$                            | 1.472                           | \$                                             | 0                    | (13) | \$   | (13) | 0,00 |      |
|            | 08.2025          | \$                  | 1.472                 | AUD                           | 2.265                           |                                                | 13                   | 0    |      | 13   | 0,00 |      |
| BOA        | 07.2025          | AUD                 | 294                   | \$                            | 191                             |                                                | 0                    | (1)  |      | (1)  | 0,00 |      |
| BRC        | 07.2025          | \$                  | 1.499                 | AUD                           | 2.326                           |                                                | 25                   | 0    |      | 25   | 0,00 |      |
| BSH        | 07.2025          |                     | 1.419                 |                               | 2.210                           |                                                | 29                   | 0    |      | 29   | 0,00 |      |
| FAR        | 07.2025          | AUD                 | 2.252                 | \$                            | 1.472                           |                                                | 0                    | (4)  |      | (4)  | 0,00 |      |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.508                 | AUD                           | 2.337                           |                                                | 24                   | 0    |      | 24   | 0,00 |      |
|            | 08.2025          |                     | 1.473                 |                               | 2.252                           |                                                | 3                    | 0    |      | 3    | 0,00 |      |
|            |                  |                     |                       |                               | \$                              | 94                                             |                      | \$   | (18) | \$   | 76   | 0,00 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                 | 161.885               | \$                            | 202.686                         | \$ 0                                           | (0,01)               |
| BOA        | 08.2025          | \$                  | 202.686               | CHF                           | 161.215                         | 688                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 1.500                 | \$                            | 1.836                           | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | \$                  | 856                   | CHF                           | 693                             | 15                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 1.428                 | \$                            | 1.733                           | 0                                              | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK        | 07.2025          | \$ 10.766              | \$ 13.260                | \$ 0                             | \$ (264)                           | \$ (264)                                             | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | 161.268                | 201.441                  | 0                                | (1.157)                            | (1.157)                                              | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 201.533             | 165.957                  | 6.956                            | 0                                  | 6.956                                                | 0,08                    |
|            | 08.2025          | 201.441                | 160.604                  | 1.161                            | 0                                  | 1.161                                                | 0,01                    |
| JPM        | 07.2025          | CHF 263                | \$ 321                   | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | 2.585                  | 3.201                    | 0                                | (47)                               | (47)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 200.607             | CHF 164.855              | 6.497                            | 0                                  | 6.497                                                | 0,08                    |
| MYI        | 07.2025          | CHF 2.641              | \$ 3.244                 | 0                                | (74)                               | (74)                                                 | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025          | \$ 193.839             | CHF 158.973              | 5.876                            | 0                                  | 5.876                                                | 0,07                    |
| SCX        | 07.2025          | CHF 1.269              | \$ 1.556                 | 0                                | (38)                               | (38)                                                 | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 21.193                        | \$ (2.387)                         | \$ 18.806                                            | 0,23                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CZK (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| DUB        | 07.2025          | \$ 2.750               | CZK 59.869               | \$ 93                            | \$ 0                               | \$ 93                                                | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CZK 63.307             | \$ 3.004                 | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 3.004               | CZK 63.241               | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | 2.909                  | 64.027                   | 132                              | 0                                  | 132                                                  | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | CZK 60.050             | \$ 2.843                 | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 2.843               | CZK 59.987               | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | 2.909                  | 64.187                   | 139                              | 0                                  | 139                                                  | 0,01                    |
| UAG        | 07.2025          | CZK 64.466             | \$ 3.058                 | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 3.058               | CZK 64.399               | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 377                           | \$ (14)                            | \$ 363                                               | 0,01                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, Class E EUR (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD 5.453              | \$ 3.542                 | \$ 0                             | \$ (31)                            | \$ (31)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 213                  | 292                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD 165                | 99                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 3.544               | AUD 5.453                | 31                               | 0                                  | 31                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 292                    | £ 213                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 99                     | NZD 165                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | 97.281                 | € 85.556                 | 3.148                            | 0                                  | 3.148                                                | 0,04                    |
| BPS        | 07.2025          | € 213                  | \$ 242                   | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | £ 10.937               | 14.881                   | 0                                | (107)                              | (107)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD 0                  | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1.618               | € 1.420                  | 50                               | 0                                  | 50                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 3                      | ¥ 400                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 14.883                 | £ 10.937                 | 107                              | 0                                  | 107                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | € 578                  | \$ 662                   | 0                                | (16)                               | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 1                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1                   | CHF 1                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 3.715                  | € 3.189                  | 28                               | 0                                  | 28                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 68                     | SEK 650                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | € 89.072               | \$ 103.333               | 0                                | (1.225)                            | (1.225)                                              | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$ 103.333             | € 88.877                 | 1.223                            | 0                                  | 1.223                                                | 0,01                    |
| FAR        | 07.2025          | CHF 788                | \$ 984                   | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 146.238              | 1.005                    | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.518               | AUD 5.453                | 55                               | 0                                  | 55                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 957                    | CHF 788                  | 33                               | 0                                  | 33                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.537                  | ¥ 220.540                | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 984                    | CHF 785                  | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 1.005                  | ¥ 145.701                | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| IND        | 07.2025          | SEK 651                | \$ 69                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 69                  | SEK 649                  | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | 501                    | CAD 684                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 98                     | NZD 165                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CAD 11.910             | \$ 8.664                 | 0                                | (64)                               | (64)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | € 37                   | 42                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 8.668               | CAD 11.906               | 57                               | 0                                  | 57                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.431                  | € 1.252                  | 38                               | 0                                  | 38                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 293                    | £ 213                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 67                     | ¥ 9.674                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 8.664                  | CAD 11.890               | 64                               | 0                                  | 64                                                   | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | ¥ 46.285               | \$ 317                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 34                  | ¥ 4.982                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 317                    | 46.115                   | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | 267                    | 38.478                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | ¥ 6.758                | \$ 47                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 47                  | ¥ 6.734                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | 14.809                 | £ 10.937                 | 179                              | 0                                  | 179                                                  | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | 22                     | ¥ 3.251                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          | ¥ 77.658               | \$ 539                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 912                 | € 807                    | 36                               | 0                                  | 36                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 539                    | ¥ 77.373                 | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 5.072                         | \$ (1.486)                         | \$ 3.586                                             | 0,04                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 503.592              | \$ 589.646               | \$ 0                             | \$ (1.495)                         | \$ (1.495)                                           | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$ 590.938             | € 503.592                | 1.493                            | 0                                  | 1.493                                                | 0,02                    |
| BOA        | 07.2025          | € 638.199              | \$ 561.277               | 20.655                           | 0                                  | 20.655                                               | 0,25                    |
| BPS        | 07.2025          | € 13.138               | \$ 15.196                | 0                                | (225)                              | (225)                                                | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | € 7.449                | \$ 8.532                 | 0                                | (212)                              | (212)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 638.696             | € 562.411                | 21.490                           | 0                                  | 21.490                                               | 0,26                    |
| CBK        | 07.2025          | € 14.581               | \$ 16.847                | 0                                | (269)                              | (269)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 1.727               | € 1.508                  | 43                               | 0                                  | 43                                                   | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | € 553.129              | \$ 641.685               | 0                                | (7.604)                            | (7.604)                                              | (0,09)                  |
|            | 08.2025          | \$ 641.685             | € 551.917                | 7.595                            | 0                                  | 7.595                                                | 0,09                    |
| MBC        | 07.2025          | € 23.905               | \$ 27.697                | 0                                | (364)                              | (364)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 112                 | € 98                     | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          | € 548.512              | \$ 643.213               | 0                                | (658)                              | (658)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 603.714             | € 534.392                | 23.582                           | 0                                  | 23.582                                               | 0,28                    |
|            | 08.2025          | 644.617                | 548.512                  | 658                              | 0                                  | 658                                                  | 0,01                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 75.519                        | \$ (10.827)                        | \$ 64.692                                            | 0,78                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend, Class R GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 175.993              | \$ 241.498               | \$ 326                           | \$ 0                               | \$ 326                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 241.532             | £ 175.993                | 0                                | (324)                              | (324)                                                | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | £ 1.923                | \$ 2.610                 | 0                                | (25)                               | (25)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | £ 196.901              | \$ 267.865               | 4                                | (1.962)                            | (1.958)                                              | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 253.499             | £ 187.751                | 3.785                            | 0                                  | 3.785                                                | 0,04                    |
| CBK        | 08.2025          | £ 261.385              | \$ 192.082               | 1.873                            | 0                                  | 1.873                                                | 0,02                    |
|            | 07.2025          | £ 5.790                | \$ 7.846                 | 0                                | (87)                               | (87)                                                 | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | £ 406                  | \$ 548                   | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 265.162             | £ 196.828                | 4.560                            | 0                                  | 4.560                                                | 0,05                    |
| MBC        | 07.2025          | £ 3.434                | \$ 4.661                 | 2                                | (46)                               | (44)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 160                 | £ 118                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | £ 189.946              | \$ 260.454               | 161                              | 0                                  | 161                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 265.227             | £ 195.881                | 3.199                            | 0                                  | 3.199                                                | 0,04                    |
| UAG        | 08.2025          | £ 260.488              | \$ 189.946               | 0                                | (157)                              | (157)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £ 6.184                | \$ 8.376                 | 0                                | (99)                               | (99)                                                 | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 13.912                        | \$ (2.709)                         | \$ 11.203                                            | 0,13                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 07.2025          | NOK 433                | \$ 43                    | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | \$ 9.937               | NOK 101.215              | 65                               | 0                                  | 65                                                   | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | 392                    | \$ 3.998                 | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | NOK 92.844             | \$ 9.204                 | 30                               | 0                                  | 30                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 10.006              | NOK 101.736              | 47                               | 0                                  | 47                                                   | 0,00                    |
| RYL        | 08.2025          | 9.204                  | \$ 92.827                | 0                                | (30)                               | (30)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 10                     | \$ 101                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | NOK 102.565            | \$ 10.215                | 80                               | 0                                  | 80                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 10.215              | NOK 102.545              | 0                                | (80)                               | (80)                                                 | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | 9.021                  | \$ 91.611                | 32                               | 0                                  | 32                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 257                           | \$ (110)                           | \$ 147                                               | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 07.2025          | SEK 118                | \$ 12                    | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 9                   | SEK 87                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | SEK 412                | \$ 43                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 134                 | SEK 1.293                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | SEK 811.482            | \$ 85.617                | 471                              | (1)                                | 470                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          | \$ 85.360              | SEK 807.283              | 0                                | (472)                              | (472)                                                | (0,01)                  |
| FAR        | 07.2025          | SEK 83.080             | \$ 795.759               | 417                              | 0                                  | 417                                                  | 0,01                    |
| IND        | 07.2025          | SEK 804.521            | \$ 85.040                | 624                              | 0                                  | 624                                                  | 0,01                    |
|            | 08.2025          | \$ 85.040              | SEK 802.791              | 0                                | (625)                              | (625)                                                | (0,02)                  |
| MBC        | 07.2025          | SEK 2.004              | \$ 211                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MYI        | 07.2025          | \$ 3                   | SEK 28                   | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | 79.443                 | 763.464                  | 665                              | 0                                  | 665                                                  | 0,01                    |
| RYL        | 07.2025          | SEK 725                | \$ 77                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | \$ 89                  | SEK 851                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | 0                      | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | 83.080                 | 798.301                  | 683                              | 0                                  | 683                                                  | 0,01                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 2.863                         | \$ (1.098)                         | \$ 1.765                                             | 0,02                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA                              | 07.2025          | SGD 15.486             | \$ 12.093                | \$ 0                             | \$ (65)                            | \$ (65)                                              | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | \$ 12.093              | SGD 15.450               | 67                               | 0                                  | 67                                                   | 0,00                    |
| BRC                              | 07.2025          | 267                    | 343                      | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| CBK                              | 07.2025          | SGD 1.077              | \$ 839                   | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 506                 | SGD 646                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| DUB                              | 07.2025          | 14.939                 | 19.245                   | 171                              | 0                                  | 171                                                  | 0,00                    |
| FAR                              | 07.2025          | SGD 34.314             | \$ 26.905                | 0                                | (37)                               | (37)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 29.820              | SGD 38.365               | 303                              | 0                                  | 303                                                  | 0,01                    |
|                                  | 08.2025          | 26.905                 | 34.232                   | 40                               | 0                                  | 40                                                   | 0,00                    |
| GLM                              | 07.2025          | SGD 15.239             | \$ 11.955                | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | \$ 11.955              | SGD 15.202               | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
| JPM                              | 07.2025          | SGD 15.653             | \$ 12.225                | 0                                | (65)                               | (65)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 32.273              | SGD 41.456               | 275                              | 0                                  | 275                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | 12.225                 | 15.617                   | 67                               | 0                                  | 67                                                   | 0,00                    |
| MBC                              | 07.2025          | SGD 38.842             | \$ 30.036                | 0                                | (460)                              | (460)                                                | (0,01)                  |
|                                  | 07.2025          | \$ 24.830              | SGD 31.856               | 182                              | 0                                  | 182                                                  | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | 29.813                 | 38.466                   | 464                              | 0                                  | 464                                                  | 0,01                    |
| MYI                              | 07.2025          | SGD 424                | \$ 331                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$ 1.286               | SGD 1.648                | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| SCX                              | 07.2025          | SGD 6.558              | \$ 5.084                 | 0                                | (65)                               | (65)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | \$ 5.084               | SGD 6.543                | 66                               | 0                                  | 66                                                   | 0,00                    |
| SSB                              | 07.2025          | 128                    | 163                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025          | 56                     | 71                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  |                  |                        |                          | \$ 1.659                         | \$ (711)                           | \$ 948                                               | 0,01                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 44.168                                            | 0,53                    |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKTWERT<br>(000S) | % DES<br>NETTOVERMÖGENS |
|--------------------------------------------|----------------|---------------------|-------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                     |                         |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 22.000      | \$ 2.640            | 0,03                    |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | \$ 2.640            | 0,03                    |
| Summe Anlagen                              |                | \$ 8.942.525        | 107,40                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |                | \$ (615.827)        | (7,40)                  |
| Nettovermögen                              |                | \$ 8.326.698        | 100,00                  |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

## (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,42 %):

| Emittentenbeschreibung              | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum  | Kosten           | Marktwert        | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|---------|------------------|------------|------------------|------------------|----------------------|
| Aurizon Network Pty. Ltd.           | 6,560 % | 21.12.2034       | 21.11.2024 | \$ 329           | \$ 343           | 0,00                 |
| Coastal Gaslink Pipeline LP         | 5,857   | 30.03.2049       | 04.06.2024 | 3.654            | 4.143            | 0,05                 |
| Constellation Pharmaceuticals, Inc. | 5,550   | 01.07.2033       | 16.01.2025 | 3.434            | 3.487            | 0,04                 |
| Hardwood Funding LLC                | 4,840   | 07.06.2028       | 11.03.2025 | 2.700            | 2.716            | 0,03                 |
| Hardwood Funding LLC                | 4,980   | 07.06.2030       | 11.03.2025 | 2.100            | 2.121            | 0,03                 |
| Hardwood Funding LLC                | 5,160   | 07.06.2032       | 11.03.2025 | 2.700            | 2.732            | 0,03                 |
| Morgan Stanley                      | 0,000   | 02.04.2032       | 11.02.2020 | 41.992           | 32.556           | 0,39                 |
| Pantheon Senior Debt Secondaries    | 6,317   | 26.03.2026       | 18.03.2025 | 2.800            | 2.800            | 0,03                 |
| Project Alfa                        | 4,256   | 27.02.2026       | 28.02.2025 | 1.966            | 2.218            | 0,03                 |
|                                     |         |                  |            | <b>\$ 61.675</b> | <b>\$ 53.116</b> | <b>0,63</b>          |

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 69.533 USD (31. Dezember 2024: 4.514 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 426 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 593 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 237.072 USD (31. Dezember 2024: 177.978 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 19.280 USD (31. Dezember 2024: 34.010 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 7.463.881                                                    | \$ 65.283                                                    | \$ 7.529.164        |
| Investmentfonds                     | 812.756                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 812.756             |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 481.308                                                         | 0                                                            | 481.308             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (4.048)                                                                     | 120.705                                                         | 0                                                            | 116.657             |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 2.640                                                           | 0                                                            | 2.640               |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 808.708</b>                                                           | <b>\$ 8.068.534</b>                                             | <b>\$ 65.283</b>                                             | <b>\$ 8.942.525</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 8.619.658                                                    | \$ 34.665                                                    | \$ 8.654.323        |
| Investmentfonds                     | 506.540                                                                     | 259.065                                                         | 0                                                            | 765.605             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (10.133)                                                                    | (21.726)                                                        | 0                                                            | (31.859)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 2.750                                                           | 0                                                            | 2.750               |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 496.407</b>                                                           | <b>\$ 8.859.747</b>                                             | <b>\$ 34.665</b>                                             | <b>\$ 9.390.819</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                       | 3,000 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (934)     | \$ (934)                                       | (0,01)                  |
|                                           | 4,250      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (30.204)     | (30.233)                                       | (0,36)                  |
|                                           | 4,270      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (12.232)     | (12.243)                                       | (0,15)                  |
|                                           | 4,280      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (5.769)      | (5.775)                                        | (0,07)                  |
|                                           | 4,290      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (3.110)      | (3.113)                                        | (0,04)                  |
|                                           | 4,300      | 18.06.2025       | 01.08.2025         | (1.833)      | (1.836)                                        | (0,02)                  |
|                                           | 4,300      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (745)        | (746)                                          | (0,01)                  |
| BRC                                       | 1,250      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (1.229)    | (1.444)                                        | (0,02)                  |
|                                           | 3,250      | 16.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | \$ (870)     | (871)                                          | (0,01)                  |
| JML                                       | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (7.153)    | (8.403)                                        | (0,10)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                    |              | <b>\$ (65.598)</b>                             | <b>(0,79)</b>           |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (1)                              | \$ 0                                  | \$ (1)                          | \$ (397)                            | \$ 330                                | \$ (67)                         |
| BOA        | 23.574                              | (22.470)                              | 1.104                           | (171)                               | 0                                     | (171)                           |
| BPS        | (2.102)                             | 1.840                                 | (262)                           | 13.370                              | (11.980)                              | 1.390                           |
| BRC        | (16.368)                            | 14.200                                | (2.168)                         | 1.208                               | (1.590)                               | (382)                           |
| BSH        | (908)                               | 800                                   | (108)                           | (29)                                | 0                                     | (29)                            |
| CBK        | 690                                 | (1.190)                               | (500)                           | (569)                               | 290                                   | (279)                           |
| DUB        | 259                                 | (270)                                 | (11)                            | 2.875                               | (2.610)                               | 265                             |
| FAR        | 3.045                               | (2.370)                               | 675                             | 147                                 | 0                                     | 147                             |
| GLM        | (240)                               | 190                                   | (50)                            | (1.471)                             | 1.460                                 | (11)                            |
| GST        | 866                                 | (970)                                 | (104)                           | 482                                 | (490)                                 | (8)                             |
| IND        | (1)                                 | 0                                     | (1)                             | 222                                 | 0                                     | 222                             |
| JPM        | 4.620                               | (4.590)                               | 30                              | 1.522                               | (1.210)                               | 312                             |
| MBC        | 4.621                               | (3.600)                               | 1.021                           | (21.496)                            | 18.610                                | (2.886)                         |
| MYC        | (57)                                | (10)                                  | (67)                            | (32)                                | (10)                                  | (42)                            |
| MYI        | 755                                 | (1.190)                               | (435)                           | 70                                  | 140                                   | 210                             |
| RBC        | 5.874                               | (4.830)                               | 1.044                           | (12)                                | 0                                     | (12)                            |
| RYL        | 33                                  | 0                                     | 33                              | 12                                  | 0                                     | 12                              |
| SAL        | (1)                                 | 0                                     | (1)                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| SCX        | (72)                                | (130)                                 | (202)                           | (11.878)                            | 12.890                                | 1.012                           |
| SOG        | 148                                 | 0                                     | 148                             | 14                                  | 0                                     | 14                              |
| SSB        | (2.122)                             | 2.250                                 | 128                             | (178)                               | 290                                   | 112                             |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (125)                               | 0                                     | (125)                           |
| UAG        | 630                                 | (1.040)                               | (410)                           | (73)                                | 0                                     | (73)                            |
| WST        | 20.925                              | (19.190)                              | 1.735                           | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 47,90             | 49,30             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 23,52             | 24,10             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,05              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 7,72              | 6,52              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 4,57              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,49              | 0,01              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,63              | 0,37              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,29              | 0,44              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,03              | 0,03              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 13,80             | 19,23             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------|-------------------|-------------------|
| Australien            | 3,05              | 2,95              |
| Österreich            | 0,24              | 0,20              |
| Belgien               | 0,34              | 0,34              |
| Bermuda               | 0,45              | 0,41              |
| Brasilien             | 0,33              | 0,30              |
| Kanada                | 2,41              | 2,38              |
| Kaimaninseln          | 1,32              | 1,45              |
| Chile                 | 0,05              | 0,01              |
| Kolumbien             | 0,12              | 0,12              |
| Tschechische Republik | 0,22              | 0,11              |
| Dänemark              | 0,38              | 0,31              |
| Finnland              | 0,30              | 0,29              |
| Frankreich            | 2,97              | 3,15              |
| Deutschland           | 0,99              | 1,34              |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,49              | 0,35              |
| Hongkong              | k. A.             | 0,00              |
| Ungarn                | 0,17              | 0,08              |
| Indien                | 0,28              | 0,27              |
| Indonesien            | 0,20              | 0,20              |
| Irland                | 0,48              | 0,59              |
| Insel Man             | 0,15              | 0,14              |
| Israel                | 0,41              | 0,38              |
| Italien               | 1,36              | 2,12              |
| Japan                 | 1,99              | 1,30              |
| Jersey, Kanalinseln   | 0,52              | 0,32              |
| Kasachstan            | 0,04              | 0,04              |
| Liberia               | 0,22              | 0,20              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Luxemburg                                                                              | 0,62              | 1,00              |
| Mexiko                                                                                 | 1,14              | 1,03              |
| Multinational                                                                          | 0,11              | 0,11              |
| Niederlande                                                                            | 2,39              | 3,65              |
| Norwegen                                                                               | 0,40              | 0,51              |
| Panama                                                                                 | 0,29              | 0,22              |
| Peru                                                                                   | 0,90              | 0,69              |
| Polen                                                                                  | 0,24              | 0,16              |
| Portugal                                                                               | 0,23              | 0,20              |
| Katar                                                                                  | 0,15              | 0,15              |
| Rumänien                                                                               | 0,74              | 0,59              |
| Russland                                                                               | 0,00              | 0,00              |
| Saudi-Arabien                                                                          | 1,08              | 1,15              |
| Singapur                                                                               | 0,32              | 0,36              |
| Slowakei                                                                               | 0,01              | 0,02              |
| Südafrika                                                                              | 0,83              | 0,74              |
| Südkorea                                                                               | 0,68              | 0,51              |
| Spanien                                                                                | 0,83              | 1,08              |
| Supranational                                                                          | 0,47              | 0,48              |
| Schweden                                                                               | 0,01              | 0,33              |
| Schweiz                                                                                | 1,56              | 1,86              |
| Thailand                                                                               | k. A.             | 0,09              |
| Türkei                                                                                 | 0,03              | 0,03              |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 0,28              | 0,22              |
| Großbritannien                                                                         | 6,74              | 6,64              |
| USA                                                                                    | 50,82             | 58,86             |
| Jungferninseln (Britisch)                                                              | 0,08              | 0,32              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | k. A.             | 0,07              |
| Investmentfonds                                                                        | 9,76              | 8,88              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 5,78              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,53              | (0,31)            |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,02              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | (0,01)            | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | (0,01)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | (0,02)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | (0,05)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,15              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,26              | 0,14              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes                                             | 0,01              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | 0,01              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,02              | 0,00              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes                                             | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | (0,01)            | 0,01              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,02              | 0,02              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,72)            | 0,65              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,22              | (0,86)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,03              | 0,03              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (7,40)            | (8,96)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund

| Beschreibung                                       | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                        | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens | Beschreibung                                         | Pari<br>(000S) | Markt-<br>Wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>Vermö-<br>gens |
|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Übertragbare Wertpapiere                           |                |                          |                                   | UCB S.A.                                            |                |                          |                                   | Staatsemissionen                                     |                |                          |                                   |
| Australien                                         |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 20.03.2030 € 2.000 \$2.409 0,09   |                |                          |                                   | Colombia Government International Bond               |                |                          |                                   |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                   |                |                          |                                   | 20.572 0,81                                         |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 14.11.2035 \$ 4.400 \$4.430 0,18   |                |                          |                                   |
| APPF Commercial Finance Pty. Ltd.                  |                |                          |                                   | Staatsemissionen                                    |                |                          |                                   | Summe Kolumbien                                      |                |                          |                                   |
| 3,600 % fällig am 11.11.2031 AUD 800 \$ 465 0,02   |                |                          |                                   | Communaute Francaise de Belgique                    |                |                          |                                   | Tschechische Republik                                |                |                          |                                   |
| Boral Finance Pty. Ltd.                            |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 11.06.2035 2.000 1.790 0,07       |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                     |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 01.05.2028 \$ 52 50 0,00         |                |                          |                                   | Summe Belgien                                       |                |                          |                                   | EPH Financing International A/S                      |                |                          |                                   |
| Commonwealth Bank of Australia                     |                |                          |                                   | 22.362 0,88                                         |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am                                    |                |                          |                                   |
| 5,929 % fällig am 14.03.2046 4.200 4.128 0,16      |                |                          |                                   | Brasilien                                           |                |                          |                                   | 02.07.2032 (b) € 4.500 5.321 0,21                    |                |                          |                                   |
| ETSA Utilities Finance Pty. Ltd.                   |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                    |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 30.11.2029 1.800 2.261 0,09        |                |                          |                                   |
| 5,108 % fällig am 03.06.2027 AUD 1.300 869 0,03    |                |                          |                                   | Itau Unibanco Holding S.A.                          |                |                          |                                   | Summe Tschechische Republik                          |                |                          |                                   |
| GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                         |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 27.02.2030 \$ 4.550 4.670 0,18    |                |                          |                                   | Dänemark                                             |                |                          |                                   |
| 3,400 % fällig am 30.09.2026 \$ 850 838 0,03       |                |                          |                                   | Kanada                                              |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                     |                |                          |                                   |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.                |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                    |                |                          |                                   | AP Moller - Maersk A/S                               |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 03.05.2030 € 1.200 1.471 0,06    |                |                          |                                   | Bank of Nova Scotia                                 |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am                                    |                |                          |                                   |
| GPT Wholesale Office Fund                          |                |                          |                                   | 4,932 % fällig am 14.02.2029 3.000 3.039 0,12       |                |                          |                                   | 05.03.2036 (i) 1.700 2.050 0,08                      |                |                          |                                   |
| 3,222 % fällig am 05.11.2031 AUD 1.740 1.021 0,04  |                |                          |                                   | Brookfield Finance, Inc.                            |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 14.09.2033 \$ 7.301 7.701 0,30     |                |                          |                                   |
| Lendlease Finance Ltd.                             |                |                          |                                   | 2,724 % fällig am 15.04.2031 4.850 4.388 0,17       |                |                          |                                   | Danske Bank A/S                                      |                |                          |                                   |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027 1.370 868 0,03        |                |                          |                                   | Brookfield Property Finance ULC                     |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 26.05.2033 € 1.200 1.412 0,06      |                |                          |                                   |
| Macquarie University                               |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 13.02.2028 CAD 1.100 845 0,03     |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 09.11.2028 1.000 1.225 0,05        |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 22.05.2030 750 441 0,02          |                |                          |                                   | Canadian Imperial Bank of Commerce                  |                |                          |                                   | Nykredit Realkredit A/S                              |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 07.09.2028 250 160 0,01          |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 01.10.2029 € 3.500 4.124 0,16     |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 12.07.2027 1.650 1.897 0,07        |                |                          |                                   |
| Mirvac Group Finance Ltd.                          |                |                          |                                   | 4,414 % fällig am 08.06.2028 \$ 3.100 3.138 0,12    |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 19.01.2029 200 248 0,01            |                |                          |                                   |
| 5,150 % fällig am 18.03.2031 2.580 1.699 0,07      |                |                          |                                   | CGI, Inc.                                           |                |                          |                                   | Orsted A/S                                           |                |                          |                                   |
| National Australia Bank Ltd.                       |                |                          |                                   | 2,300 % fällig am 14.09.2031 1.000 865 0,04         |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 13.09.2034 £ 1.300 1.705 0,07      |                |                          |                                   |
| 4,898 % fällig am 06.03.2028 \$ 3.500 3.495 0,14   |                |                          |                                   | Federation des Caisses Desjardins du Quebec         |                |                          |                                   | TDC Net A/S                                          |                |                          |                                   |
| NBN Co. Ltd.                                       |                |                          |                                   | 2,683 % fällig am 29.05.2030 € 4.500 5.291 0,21     |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 09.08.2032 € 5.600 6.730 0,26      |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 29.11.2032 € 1.700 2.013 0,08    |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 18.04.2028 1.400 1.683 0,07       |                |                          |                                   | 5,186 % fällig am 02.08.2029 750 922 0,04            |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 22.03.2030 2.300 2.760 0,11      |                |                          |                                   | Manulife Financial Corp.                            |                |                          |                                   | 5,618 % fällig am 06.02.2030 1.200 1.501 0,06        |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 28.08.2031 AUD 2.200 1.479 0,06  |                |                          |                                   | 3,703 % fällig am 16.03.2032 \$ 1.000 947 0,04      |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.06.2031 2.800 3.648 0,14        |                |                          |                                   |
| Telstra Group Ltd.                                 |                |                          |                                   | National Bank of Canada                             |                |                          |                                   | Summe Dänemark                                       |                |                          |                                   |
| 5,650 % fällig am 06.03.2034 1.050 721 0,03        |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 25.04.2028 € 500 605 0,02         |                |                          |                                   | Finland                                              |                |                          |                                   |
| Transurban Finance Co. Pty. Ltd.                   |                |                          |                                   | Open Text Corp.                                     |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                     |                |                          |                                   |
| 2,450 % fällig am 16.03.2031 \$ 2.100 1.866 0,07   |                |                          |                                   | 6,900 % fällig am 01.12.2027 \$ 1.900 1.969 0,08    |                |                          |                                   | Ahlstrom Holding Oy                                  |                |                          |                                   |
| Vicinity Centres Trust                             |                |                          |                                   | Royal Bank of Canada                                |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 04.02.2028 \$ 400 382 0,02         |                |                          |                                   |
| 4,927 % fällig am 02.06.2028 AUD 2.500 1.668 0,06  |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 25.07.2028 € 3.700 4.485 0,18     |                |                          |                                   | Balder Finland Oyj                                   |                |                          |                                   |
| 26.012 1,02                                        |                |                          |                                   | TELUS Corp.                                         |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 20.01.2029 € 400 434 0,02          |                |                          |                                   |
| Staatsemissionen                                   |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 15.10.2055 \$ 2.300 2.321 0,09    |                |                          |                                   | Fingrid Oyj                                          |                |                          |                                   |
| Australia Government International Bond            |                |                          |                                   | 33.700 1,33                                         |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 04.12.2029 1.600 1.877 0,07        |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 21.04.2026 525 347 0,01          |                |                          |                                   | Staatsemissionen                                    |                |                          |                                   | Nordea Bank Abp                                      |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 21.06.2034 29.300 19.488 0,77    |                |                          |                                   | Canada Government International Bond                |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 05.05.2028 2.500 3.067 0,12        |                |                          |                                   |
| New South Wales Treasury Corp.                     |                |                          |                                   | 2,250 % fällig am 01.12.2029 CAD 16.500 11.823 0,46 |                |                          |                                   | 5,760 0,23                                           |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 20.09.2035 3.100 2.020 0,08      |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.03.2032 7.600 5.565 0,22       |                |                          |                                   | Kreditbeteiligungen und -abtretung                   |                |                          |                                   |
| Summe Australien                                   |                |                          |                                   | CPPIB Capital, Inc.                                 |                |                          |                                   | Ahlstrom Oyj                                         |                |                          |                                   |
| 47.867 1,88                                        |                |                          |                                   | 4,300 % fällig am 02.06.2034 3.500 2.675 0,11       |                |                          |                                   | TBD % fällig am 23.05.2030 \$ 1.500 1.498 0,06       |                |                          |                                   |
| Österreich                                         |                |                          |                                   | Province of Ontario                                 |                |                          |                                   | Staatsemissionen                                     |                |                          |                                   |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                   |                |                          |                                   | 4,100 % fällig am 04.03.2033 15.500 11.794 0,46     |                |                          |                                   | Kuntarahoitus Oyj                                    |                |                          |                                   |
| Erste Group Bank AG                                |                |                          |                                   | Province of Quebec                                  |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 25.09.2028 € 2.200 2.641 0,10      |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 09.01.2031 € 1.000 1.188 0,05    |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 05.05.2031 € 7.400 7.532 0,30     |                |                          |                                   | Summe Finnland                                       |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 16.01.2031 1.000 1.225 0,05      |                |                          |                                   | 1,850 % fällig am 13.02.2027 CAD 500 362 0,01       |                |                          |                                   | 9.899 0,39                                           |                |                          |                                   |
| UniCredit Bank Austria AG                          |                |                          |                                   | 39.751 1,56                                         |                |                          |                                   | Frankreich                                           |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 21.09.2029 2.600 3.118 0,12      |                |                          |                                   | 73.451 2,89                                         |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                     |                |                          |                                   |
| Summe Österreich                                   |                |                          |                                   | Kaimaninseln                                        |                |                          |                                   | Accor S.A.                                           |                |                          |                                   |
| 5.531 0,22                                         |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                    |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 11.03.2031 1.300 1.566 0,06        |                |                          |                                   |
| Belgien                                            |                |                          |                                   | MAF Sukuk Ltd.                                      |                |                          |                                   | Altarea S.C.A.                                       |                |                          |                                   |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                   |                |                          |                                   | 3,933 % fällig am 28.02.2030 \$ 400 387 0,01        |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 16.01.2030 1.100 1.162 0,05        |                |                          |                                   |
| Barry Callebaut Services NV                        |                |                          |                                   | Chile                                               |                |                          |                                   | Arkea Home Loans SFH S.A.                            |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 19.08.2031 1.200 1.418 0,05      |                |                          |                                   | Staatsemissionen                                    |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 01.08.2033 9.900 11.758 0,46       |                |                          |                                   |
| FLUVIUS System Operator C.V.                       |                |                          |                                   | Chile Government International Bond                 |                |                          |                                   | AXA S.A.                                             |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 12.03.2035 3.000 3.470 0,14      |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 29.01.2040 € 800 659 0,03         |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 07.10.2041 500 522 0,02            |                |                          |                                   |
| KBC Group NV                                       |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 22.01.2051 2.200 1.408 0,06       |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 11.07.2043 2.300 2.969 0,12        |                |                          |                                   |
| 4,375 % fällig am 06.12.2031 3.800 4.771 0,19      |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 09.07.2031 3.600 4.348 0,17       |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 16.07.2033 (e)(g) 1.500 1.870 0,07 |                |                          |                                   |
| 5,796 % fällig am 19.01.2029 \$ 1.000 1.033 0,04   |                |                          |                                   | 4,340 % fällig am 07.03.2042 \$ 1.000 868 0,03      |                |                          |                                   | Banque Federative du Credit Mutuel S.A.              |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 05.09.2028 (e)(g) € 600 782 0,03 |                |                          |                                   | Summe Chile                                         |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 29.06.2028 900 989 0,04            |                |                          |                                   |
| Proximus SADP                                      |                |                          |                                   | 7.283 0,29                                          |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 21.11.2029 1.800 2.208 0,09        |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 17.11.2033 2.000 2.456 0,10      |                |                          |                                   | Kolumbien                                           |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 18.09.2030 800 993 0,04            |                |                          |                                   |
| Silfin NV                                          |                |                          |                                   | Unternehmensanleihen und Wechsel                    |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 02.05.2030 1.100 1.360 0,05        |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 11.04.2027 2.400 2.816 0,11      |                |                          |                                   | Grupo Nutresa S.A.                                  |                |                          |                                   | BNP Paribas S.A.                                     |                |                          |                                   |
| Sofina S.A.                                        |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 12.05.2030 1.100 1.155 0,04       |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 19.01.2030 1.500 1.618 0,06        |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 23.09.2028 1.300 1.417 0,06      |                |                          |                                   | 9,000 % fällig am 12.05.2035 900 973 0,04           |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 13.07.2031 £ 500 551 0,02          |                |                          |                                   |
|                                                    |                |                          |                                   | 2.128 0,08                                          |                |                          |                                   | 1,675 % fällig am 30.06.2027 \$ 6.650 6.463 0,25     |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 3,132 % fällig am 20.01.2033 (i)                  | \$ 1.400       | \$ 1.247                 | 0,05                              | Societe Des Grands Projets EPIC                      | \$ 2.000       | \$ 2.196                 | 0,09                              | Bundesrepublik Deutschland               | € 13.000       | \$ 15.141                | 0,59                              |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028                      | 2.833          | 2.824                    | 0,11                              | 3,700 % fällig am 25.05.2033                         |                |                          |                                   | Land Hessen                              |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 13.11.2032                      | € 1.800        | 2.268                    | 0,09                              | Societe Nationale SNCF S.A.                          | 1.400          | 1.672                    | 0,06                              | 2,875 % fällig am 04.07.2033             | 1.200          | 1.415                    | 0,06                              |
| 5,125 % fällig am 13.01.2029                      | \$ 800         | 812                      | 0,03                              | 3,625 % fällig am 03.04.2035                         |                |                          |                                   | Land Nordrhein-Westfalen                 |                |                          |                                   |
| 5,906 % fällig am 19.11.2035                      | 5.500          | 5.551                    | 0,22                              | UNEDIC ASSEO                                         | 900            | 1.049                    | 0,04                              | 0,500 % fällig am 25.11.2039             | 200            | 160                      | 0,01                              |
| 7,375 % fällig am 10.09.2034 (e)(g)               | 800            | 814                      | 0,03                              | 3,125 % fällig am 25.11.2034                         |                |                          |                                   | 2,900 % fällig am 07.06.2033             | 1.975          | 2.328                    | 0,09                              |
| <b>BPCE S.A.</b>                                  |                |                          |                                   |                                                      |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| 2,045 % fällig am 19.10.2027                      | 4.000          | 3.869                    | 0,15                              | Summe Frankreich                                     |                | 151.395                  | 5,95                              | Summe Deutschland                        |                | 124.082                  | 4,87                              |
| 3,116 % fällig am 19.10.2032                      | 300            | 260                      | 0,01                              |                                                      |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 11.01.2029                      | € 100          | 121                      | 0,00                              | <b>DEUTSCHLAND</b>                                   |                |                          |                                   | <b>GUERNSEY, KANALINSELN</b>             |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 26.02.2036                      | 800            | 936                      | 0,04                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>              |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 26.02.2036                      | 2.400          | 2.963                    | 0,12                              | Amprion GmbH                                         | 1.400          | 1.646                    | 0,06                              | Globalworth Real Estate Investments Ltd. |                |                          |                                   |
| 5,389 % fällig am 28.05.2031                      | \$ 2.500       | 2.546                    | 0,10                              | 3,125 % fällig am 27.08.2030                         |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 31.03.2030             | 987            | 1.179                    | 0,05                              |
| 6,508 % fällig am 18.01.2035                      | 1.100          | 1.142                    | 0,04                              | 3,450 % fällig am 22.09.2027                         | 2.800          | 3.349                    | 0,13                              | Sirius Real Estate Ltd.                  |                |                          |                                   |
| 6,612 % fällig am 19.10.2027                      | 3.000          | 3.072                    | 0,12                              | 3,625 % fällig am 21.05.2031                         | 1.800          | 2.161                    | 0,08                              | 1,125 % fällig am 22.06.2026             | 2.500          | 2.882                    | 0,11                              |
| 6,915 % fällig am 14.01.2046                      | 2.250          | 2.348                    | 0,09                              | 3,850 % fällig am 27.08.2039                         | 1.700          | 1.952                    | 0,08                              | 1,750 % fällig am 24.11.2028             | 2.300          | 2.560                    | 0,10                              |
| <b>BPCE SFH S.A.</b>                              |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 27.09.2028                         | 2.600          | 3.152                    | 0,12                              | Summe Guernsey, Kanalinseln              |                | 6.621                    | 0,26                              |
| 3,000 % fällig am 24.03.2032                      | € 1.400        | 1.653                    | 0,07                              | 3,971 % fällig am 22.09.2032                         | 900            | 1.091                    | 0,04                              |                                          |                |                          |                                   |
| <b>Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A.</b>  |                |                          |                                   | <b>Commerzbank AG</b>                                |                |                          |                                   | <b>HONGKONG</b>                          |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 12.01.2034                      | 1.000          | 1.162                    | 0,05                              | 2,500 % fällig am 25.02.2028                         | 2.000          | 2.365                    | 0,09                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>Cie de Financement Foncier S.A.</b>            |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 13.06.2033                         | 2.400          | 2.875                    | 0,11                              | Hong Kong Government International Bond  |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 17.05.2029                      | 4.000          | 4.807                    | 0,19                              | 3,625 % fällig am 14.01.2032                         | 2.400          | 2.843                    | 0,11                              | 3,750 % fällig am 07.06.2032             | 3.500          | 4.306                    | 0,17                              |
| <b>Cie de Saint-Gobain S.A.</b>                   |                |                          |                                   | <b>Deutsche Bahn Finance GmbH</b>                    |                |                          |                                   | <b>UNGARN</b>                            |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 04.04.2028                      | 1.000          | 1.182                    | 0,05                              | 4,000 % fällig am 23.11.2043                         | 300            | 366                      | 0,01                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>Credit Agricole Assurances S.A.</b>            |                |                          |                                   | <b>Deutsche Bank AG</b>                              |                |                          |                                   | Hungary Government International Bond    |                |                          |                                   |
| 1,500 % fällig am 06.10.2031                      | 3.100          | 3.216                    | 0,13                              | 1,875 % fällig am 23.02.2028                         | 2.500          | 2.902                    | 0,11                              | 4,875 % fällig am 22.03.2040             | 6.260          | 7.194                    | 0,28                              |
| <b>Credit Agricole S.A.</b>                       |                |                          |                                   | 2,129 % fällig am 24.11.2026                         | \$ 400         | 396                      | 0,02                              | <b>INDIEN</b>                            |                |                          |                                   |
| 0,125 % fällig am 09.12.2027                      | 700            | 778                      | 0,03                              | 2,311 % fällig am 16.11.2027                         | 2.200          | 2.135                    | 0,08                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 26.09.2034                      | 2.000          | 2.324                    | 0,09                              | 3,125 % fällig am 19.05.2033                         | € 1.300        | 1.554                    | 0,06                              | <b>JSW Hydro Energy Ltd.</b>             |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 23.01.2031                      | 4.100          | 4.952                    | 0,19                              | 3,375 % fällig am 13.02.2031                         | 1.000          | 1.177                    | 0,05                              | 4,125 % fällig am 18.05.2031             | \$ 2.343       | 2.159                    | 0,08                              |
| 4,375 % fällig am 27.11.2033                      | 2.400          | 2.978                    | 0,12                              | 3,547 % fällig am 18.09.2031                         | \$ 250         | 234                      | 0,01                              | <b>ReNew Pvt Ltd.</b>                    |                |                          |                                   |
| 5,301 % fällig am 12.07.2028                      | \$ 1.700       | 1.749                    | 0,07                              | 3,742 % fällig am 07.01.2033                         | 1.300          | 1.171                    | 0,05                              | 5,875 % fällig am 05.03.2027             | 1.765          | 1.752                    | 0,07                              |
| 5,875 % fällig am 23.03.2035 (e)(g)               | € 2.100        | 2.448                    | 0,10                              | 5,403 % fällig am 11.09.2035                         | 2.300          | 2.288                    | 0,09                              | <b>ReNew Wind Energy AP2</b>             |                |                          |                                   |
| <b>Electricite de France S.A.</b>                 |                |                          |                                   | <b>Deutsche Börse AG</b>                             |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 14.07.2028             | 1.500          | 1.425                    | 0,06                              |
| 3,250 % fällig am 07.05.2032                      | 1.200          | 1.395                    | 0,05                              | 3,875 % fällig am 28.09.2026                         | € 1.500        | 1.792                    | 0,07                              | <b>SAEL Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 07.05.2037                      | 1.500          | 1.755                    | 0,07                              | 3,875 % fällig am 28.09.2033                         | 2.800          | 3.436                    | 0,14                              | 7,800 % fällig am 31.07.2031             | 680            | 663                      | 0,03                              |
| 4,625 % fällig am 25.01.2043                      | 1.500          | 1.749                    | 0,07                              | <b>E.ON SE</b>                                       |                |                          |                                   | Summe Indien                             |                | 5.999                    | 0,24                              |
| 4,625 % fällig am 07.05.2045                      | 5.000          | 5.751                    | 0,23                              | 3,750 % fällig am 15.01.2036                         | 1.700          | 2.021                    | 0,08                              | <b>INDONESIEN</b>                        |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 25.01.2035                      | £ 600          | 801                      | 0,03                              | <b>Eurogrid GmbH</b>                                 |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                          |                                   |
| 7,375 % fällig am 17.06.2035 (e)                  | 3.400          | 4.714                    | 0,19                              | 3,075 % fällig am 18.10.2027                         | 1.300          | 1.546                    | 0,06                              | <b>Bank Mandiri Persero Tbk PT</b>       |                |                          |                                   |
| <b>ELO SACA</b>                                   |                |                          |                                   | 3,279 % fällig am 05.09.2031                         | 1.000          | 1.179                    | 0,05                              | 2,000 % fällig am 19.04.2026             | 800            | 784                      | 0,03                              |
| 3,250 % fällig am 23.07.2027                      | € 400          | 454                      | 0,02                              | 3,598 % fällig am 01.02.2029                         | 2.900          | 3.499                    | 0,14                              | <b>INTERNATIONAL</b>                     |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 08.12.2028                      | 2.000          | 2.133                    | 0,08                              | 3,915 % fällig am 01.02.2034                         | 2.100          | 2.519                    | 0,10                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                          |                                   |
| <b>Engie S.A.</b>                                 |                |                          |                                   | <b>HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH</b>            |                |                          |                                   | Thames Water Super Senior Issuer PLC     |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 11.01.2035                      | 2.000          | 2.412                    | 0,09                              | 3,875 % fällig am 05.06.2030                         | 3.200          | 3.861                    | 0,15                              | 9,750 % fällig am 10.10.2025             | £ 15           | 20                       | 0,00                              |
| <b>Kering S.A.</b>                                |                |                          |                                   | <b>Kreditanstalt fuer Wiederaufbau</b>               |                |                          |                                   | <b>IRLAND</b>                            |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 11.03.2032                      | 3.500          | 4.036                    | 0,16                              | 0,000 % fällig am 15.09.2028 (c)                     | 7.450          | 8.172                    | 0,32                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>  |                |                          |                                   |
| <b>New Immo Holding S.A.</b>                      |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 30.09.2030                         | \$ 1.100       | 941                      | 0,04                              | <b>Arbour CLO DAC</b>                    |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026                      | 900            | 1.043                    | 0,04                              | 0,875 % fällig am 15.09.2026                         | £ 1.600        | 2.113                    | 0,08                              | 3,293 % fällig am 15.11.2037             | € 900          | 1.057                    | 0,04                              |
| <b>Opal Bidco S.A.S.</b>                          |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 07.06.2032                         | € 1.300        | 1.406                    | 0,06                              | <b>Ares European CLO DAC</b>             |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 31.03.2032                      | 1.900          | 2.281                    | 0,09                              | 2,000 % fällig am 15.11.2029                         | 1.800          | 2.085                    | 0,08                              | 3,266 % fällig am 21.10.2034             | 546            | 640                      | 0,03                              |
| <b>Societe Generale S.A.</b>                      |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 04.10.2029                         | 4.300          | 5.066                    | 0,20                              | <b>Avoca Static CLO DAC</b>              |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 01.03.2041                      | \$ 1.050       | 746                      | 0,03                              | 2,625 % fällig am 10.01.2034                         | 4.700          | 5.454                    | 0,21                              | 3,249 % fällig am 15.01.2035             | 463            | 543                      | 0,02                              |
| 7,367 % fällig am 10.01.2053                      | 2.200          | 2.307                    | 0,09                              | 2,750 % fällig am 01.10.2027                         | 2.300          | 2.743                    | 0,11                              |                                          |                | 2.240                    | 0,09                              |
| <b>Suez SACA</b>                                  |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 14.02.2033                         | 750            | 884                      | 0,03                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>  |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 03.11.2032                      | € 1.200        | 1.534                    | 0,06                              | 2,875 % fällig am 31.03.2032                         | 1.000          | 1.193                    | 0,05                              | <b>AIB Group PLC</b>                     |                |                          |                                   |
|                                                   |                | 125.162                  | 4,92                              | 4,250 % fällig am 15.02.2030                         | £ 2.300        | 3.178                    | 0,13                              | 2,250 % fällig am 04.04.2028             | 800            | 935                      | 0,04                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                             |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 03.02.2031                         | 2.400          | 3.408                    | 0,13                              | 3,750 % fällig am 20.03.2033             | 900            | 1.071                    | 0,04                              |
| <b>BPCE Home Loans FCT</b>                        |                |                          |                                   | <b>Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG</b> |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 23.10.2031             | 1.900          | 2.448                    | 0,10                              |
| 2,786 % fällig am 31.10.2058                      | 3.800          | 4.474                    | 0,18                              | <b>in Muenchen</b>                                   |                |                          |                                   | <b>Bank of Ireland Group PLC</b>         |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 26.05.2042                         | € 1.700        | 1.683                    | 0,07                              | 6,375 % fällig am 10.03.2030 (e)(g)      | 800            | 962                      | 0,04                              |
| <b>Action Logement Services</b>                   |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 26.05.2044                         | 900            | 1.086                    | 0,04                              | 7,594 % fällig am 06.12.2032             | £ 3.000        | 4.316                    | 0,17                              |
| 3,125 % fällig am 28.09.2037                      | 400            | 444                      | 0,02                              | <b>Robert Bosch GmbH</b>                             |                |                          |                                   | <b>CCEP Finance Ireland DAC</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Agence Francaise de Developpement</b>          |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 02.06.2027                         | 1.700          | 2.041                    | 0,08                              | 0,500 % fällig am 06.09.2029             | € 1.900        | 2.037                    | 0,08                              |
| 3,750 % fällig am 20.09.2038                      | 1.400          | 1.654                    | 0,06                              | 4,375 % fällig am 02.06.2043                         | 1.000          | 1.186                    | 0,05                              | <b>Smurfit Kappa Treasury ULC</b>        |                |                          |                                   |
| <b>Caisse Francaise de Financement Local S.A.</b> |                |                          |                                   | <b>Volkswagen Financial Services AG</b>              |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 15.01.2030             | \$ 3.700       | 3.776                    | 0,15                              |
| 3,250 % fällig am 17.04.2035                      | 3.900          | 4.575                    | 0,18                              | 3,875 % fällig am 10.09.2030                         | 500            | 601                      | 0,02                              |                                          |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 20.03.2029                      | 600            | 729                      | 0,03                              | <b>Vonovia SE</b>                                    |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 17.01.2029                      | 2.600          | 3.164                    | 0,12                              | 0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)                     | 200            | 233                      | 0,01                              |                                          |                |                          |                                   |
| <b>Ile-de-France Mobilites</b>                    |                |                          |                                   | <b>ZF Finance GmbH</b>                               |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| 3,450 % fällig am 25.06.2049                      | 1.200          | 1.284                    | 0,05                              | 2,250 % fällig am 03.05.2028                         | 1.800          | 1.920                    | 0,08                              |                                          |                |                          |                                   |
| 3,700 % fällig am 14.06.2038                      | 3.900          | 4.553                    | 0,18                              |                                                      |                | 98.903                   | 3,88                              |                                          |                |                          |                                   |
| <b>SNCF Reseau</b>                                |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                              |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| 0,750 % fällig am 25.05.2036                      | 500            | 439                      | 0,02                              | <b>Land Baden-Wuerttemberg</b>                       |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
|                                                   |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 26.06.2031                         | 2.600          | 3.095                    | 0,12                              |                                          |                |                          |                                   |
|                                                   |                |                          |                                   | <b>Land Berlin</b>                                   |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
|                                                   |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 14.02.2033                         | 2.600          | 3.040                    | 0,12                              |                                          |                |                          |                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Trane Technologies Financing Ltd.</b>           |                |                          |                                   | <b>NTT Finance Corp.</b>                                    |                |                          |                                   | <b>MEXIKO</b>                               |                |                          |                                   |
| 5,100 % fällig am 13.06.2034                       | \$             | 2.625                    | 0,10                              | 3,359 % fällig am 12.03.2031                                | €              | 800                      | 0,04                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>     |                |                          |                                   |
|                                                    |                |                          |                                   | 4,372 % fällig am 27.07.2027                                | \$             | 800                      | 0,03                              | <b>Banco Mercantil del Norte S.A.</b>       |                |                          |                                   |
|                                                    |                | 18.211                   | 0,72                              | <b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>                |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 24.01.2032                |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   | 2,472 % fällig am 14.01.2029                                | 4.800          | 4.509                    | 0,18                              | (e)(g)                                      | \$             | 2.300                    | 0,09                              |
| <b>Ireland Government International Bond</b>       |                |                          |                                   | <b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>                      |                |                          |                                   | <b>BBVA Bancomer S.A.</b>                   |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 18.10.2043                       | €              | 3.000                    | 0,13                              | 1,350 % fällig am 16.09.2026                                | 2.500          | 2.413                    | 0,09                              | 7,625 % fällig am 11.02.2035 (g)            | 300            | 309                      | 0,01                              |
| Summe Irland                                       |                | 23.806                   | 0,94                              | <b>Toyota Motor Corp.</b>                                   |                |                          |                                   | 8,125 % fällig am 08.01.2039 (g)            | 2.700          | 2.793                    | 0,11                              |
| <b>ITALIEN</b>                                     |                |                          |                                   | 4,450 % fällig am 30.06.2030                                | 3.700          | 3.716                    | 0,15                              | <b>Metalsa S.A. de C.V.</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>            |                |                          |                                   | 5,053 % fällig am 30.06.2035                                | 700            | 706                      | 0,03                              | 3,750 % fällig am 04.05.2031                | 4.300          | 3.537                    | 0,14                              |
| <b>Koromo Italy SRL</b>                            |                |                          |                                   |                                                             |                | 65.369                   | 2,57                              | <b>Trust Fibra Uno</b>                      |                |                          |                                   |
| 2,734 % fällig am 26.02.2035                       | 456            | 536                      | 0,02                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                     |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 13.02.2034                | 2.300          | 2.344                    | 0,09                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | <b>Development Bank of Japan, Inc.</b>                      |                |                          |                                   |                                             |                | 11.118                   | 0,44                              |
| <b>Banco di Desio e della Brianza SpA</b>          |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 11.09.2028                                | €              | 1.400                    | 0,06                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                     |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 13.03.2028                       | 1.400          | 1.711                    | 0,07                              | <b>Japan Government International Bond</b>                  |                |                          |                                   | <b>Mexico Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| <b>BPER Banca SpA</b>                              |                |                          |                                   | 2,100 % fällig am 20.09.2054                                | ¥              | 290.000                  | 0,07                              | 4,000 % fällig am                           |                |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am 28.10.2029                       | 1.700          | 1.876                    | 0,07                              | 2,400 % fällig am 20.03.2045                                | 808.000        | 5.631                    | 0,22                              | 24.08.2034 (d)                              | MXN            | 0                        | 0,00                              |
| <b>Intesa Sanpaolo SpA</b>                         |                |                          |                                   | 2,400 % fällig am 20.03.2055                                | 290.000        | 1.845                    | 0,07                              | 4,490 % fällig am 25.05.2032                | €              | 1.550                    | 0,07                              |
| 2,625 % fällig am 11.03.2036                       | £              | 1.000                    | 0,04                              | Summe Japan                                                 |                | 10.855                   | 0,42                              | 6,338 % fällig am 04.05.2053                | \$             | 2.000                    | 0,07                              |
| 4,000 % fällig am 23.09.2029                       | \$             | 1.300                    | 0,05                              |                                                             |                | 76.224                   | 2,99                              |                                             |                | 3.684                    | 0,14                              |
| 4,198 % fällig am 01.06.2032                       | 900            | 828                      | 0,03                              | <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                                  |                |                          |                                   | Summe Mexiko                                |                | 14.802                   | 0,58                              |
| 4,950 % fällig am 01.06.2042                       | 2.100          | 1.700                    | 0,07                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |                |                          |                                   | <b>MULTINATIONAL</b>                        |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 14.03.2029                       | £              | 1.000                    | 0,06                              | <b>Aptiv Swiss Holdings Ltd.</b>                            |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>     |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 31.05.2033                       | 1.100          | 1.622                    | 0,06                              | 3,100 % fällig am                                           |                |                          |                                   | <b>NXP BV</b>                               |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 20.06.2033                       | \$             | 600                      | 0,03                              | 01.12.2051 (i)                                              | \$             | 1.800                    | 0,04                              | 3,875 % fällig am 18.06.2026                | 300            | 298                      | 0,01                              |
| 7,778 % fällig am 20.06.2054                       | 400            | 449                      | 0,02                              | <b>Heathrow Funding Ltd.</b>                                |                |                          |                                   | <b>NIEDERLANDE</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA</b> |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 16.01.2038                                | €              | 2.800                    | 0,13                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>     |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 30.11.2028                       | €              | 1.000                    | 0,05                              | Summe Jersey, Kanalinseln                                   |                | 4.331                    | 0,17                              | <b>Bumper NL BV</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>Mundys SpA</b>                                  |                |                          |                                   | <b>LUXEMBURG</b>                                            |                |                          |                                   | 2,539 % fällig am 21.03.2036                | €              | 6.100                    | 0,28                              |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028                       | 1.400          | 1.589                    | 0,06                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |                |                          |                                   | 2,569 % fällig am 22.03.2035                | 1.743          | 2.050                    | 0,08                              |
| <b>Nexi SpA</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Acef Holding S.C.A.</b>                                  |                |                          |                                   |                                             |                | 9.218                    | 0,36                              |
| 2,125 % fällig am 30.04.2029                       | 1.800          | 2.014                    | 0,08                              | 0,750 % fällig am 14.06.2028                                | 1.700          | 1.880                    | 0,07                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>     |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 21.05.2031                       | 1.400          | 1.658                    | 0,06                              | 1,250 % fällig am 26.04.2030                                | 2.600          | 2.759                    | 0,11                              | <b>ABN AMRO Bank NV</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>UniCredit SpA</b>                               |                |                          |                                   | <b>Bevco Lux SARL</b>                                       |                |                          |                                   | 2,470 % fällig am 13.12.2029                | \$             | 6.800                    | 0,25                              |
| 1,982 % fällig am 03.06.2027                       | €              | 1.900                    | 0,07                              | 1,000 % fällig am 16.01.2030                                | 1.900          | 2.012                    | 0,08                              | 3,000 % fällig am 25.02.2031                | €              | 4.000                    | 0,19                              |
| 3,500 % fällig am 31.07.2030                       | \$             | 2.500                    | 0,12                              | <b>CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV-</b> |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 28.07.2025                | \$             | 1.500                    | 0,06                              |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035                       | \$             | 2.080                    | 0,08                              | <b>SIF-Pan European Core Fund</b>                           |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am                           |                |                          |                                   |
| 7,296 % fällig am 02.04.2034                       | 2.600          | 2.751                    | 0,11                              | 0,500 % fällig am 27.01.2028                                | 600            | 662                      | 0,03                              | 22.09.2033 (e)(g)                           | €              | 2.500                    | 0,11                              |
| Summe Italien                                      |                | 28.736                   | 1,13                              | 0,900 % fällig am 12.10.2029                                | 3.700          | 3.962                    | 0,16                              | <b>Achmea Bank NV</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 27.03.2034                                | 2.300          | 2.820                    | 0,11                              | 3,000 % fällig am 31.01.2030                | 4.600          | 5.497                    | 0,22                              |
| <b>Cassa Depositi e Prestiti SpA</b>               |                |                          |                                   | <b>CPI Property Group S.A.</b>                              |                |                          |                                   | <b>Alliander NV</b>                         |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 30.04.2029                       | 1.500          | 1.570                    | 0,06                              | 1,750 % fällig am 14.01.2030                                | 1.550          | 1.598                    | 0,06                              | 4,500 % fällig am 27.03.2032 (e)            | 1.600          | 1.926                    | 0,08                              |
| <b>Italy Buoni Poliennali Del Tesoro</b>           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 22.01.2028                                | £              | 500                      | 0,03                              | <b>American Medical Systems Europe BV</b>   |                |                          |                                   |
| 4,050 % fällig am 30.10.2037                       | €              | 3.800                    | 0,19                              | <b>Logicoor Financing SARL</b>                              |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 08.03.2029                | 1.100          | 1.320                    | 0,05                              |
| 4,100 % fällig am 30.04.2046                       | 3.660          | 4.349                    | 0,17                              | 0,625 % fällig am 17.11.2025                                | €              | 2.000                    | 0,09                              | 3,500 % fällig am 08.03.2032                | 1.800          | 2.158                    | 0,08                              |
|                                                    |                | 10.577                   | 0,42                              | <b>Nestle Finance International Ltd.</b>                    |                |                          |                                   | <b>Amvest RCF Custodian BV</b>              |                |                          |                                   |
| Summe Italien                                      |                | 39.849                   | 1,57                              | 3,500 % fällig am 14.01.2045                                | 400            | 451                      | 0,02                              | 3,750 % fällig am 11.06.2031                | 2.100          | 2.455                    | 0,10                              |
| <b>JAPAN</b>                                       |                |                          |                                   | <b>P3 Group SARL</b>                                        |                |                          |                                   | <b>ASR Nederland NV</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 19.04.2032                                | 2.100          | 2.483                    | 0,10                              | 3,625 % fällig am 12.12.2028                | 300            | 361                      | 0,01                              |
| <b>East Japan Railway Co.</b>                      |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 13.02.2030                                | 5.275          | 6.455                    | 0,25                              | 6,625 % fällig am                           |                |                          |                                   |
| 3,976 % fällig am 05.09.2032                       | 750            | 928                      | 0,04                              | <b>Prologis International Funding S.A.</b>                  |                |                          |                                   | 27.12.2031 (e)(g)                           | 2.300          | 2.845                    | 0,11                              |
| 4,389 % fällig am 05.09.2043                       | 3.100          | 3.792                    | 0,15                              | 3,700 % fällig am 07.10.2034                                | 2.000          | 2.315                    | 0,09                              | 7,000 % fällig am 07.12.2043                | 2.000          | 2.746                    | 0,11                              |
| <b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b>        |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 01.07.2036                                | 2.100          | 2.546                    | 0,10                              | <b>Ayvens Bank NV</b>                       |                |                          |                                   |
| 0,337 % fällig am 08.06.2027                       | 900            | 1.038                    | 0,04                              | <b>Raizen Fuels Finance S.A.</b>                            |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 07.09.2026                | 3.300          | 3.777                    | 0,15                              |
| 1,538 % fällig am 20.07.2027                       | \$             | 1.650                    | 0,06                              | 6,950 % fällig am 05.03.2054                                | \$             | 3.800                    | 0,14                              | <b>Compass Group Finance Netherlands BV</b> |                |                          |                                   |
| 1,640 % fällig am 13.10.2027                       | 300            | 290                      | 0,01                              | <b>Segro Capital SARL</b>                                   |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 08.03.2030                | 1.700          | 2.011                    | 0,08                              |
| 2,048 % fällig am 17.07.2030                       | 700            | 622                      | 0,02                              | 1,875 % fällig am 23.03.2030                                | €              | 950                      | 0,04                              | <b>Cooperative Rabobank UA</b>              |                |                          |                                   |
| 2,494 % fällig am 13.10.2032                       | 2.900          | 2.539                    | 0,10                              | <b>Stoneweg Ereit Lux Finco SARL</b>                        |                |                          |                                   | 1,004 % fällig am 24.09.2026                | \$             | 3.500                    | 0,14                              |
| 2,757 % fällig am 13.09.2026                       | 3.932          | 3.863                    | 0,15                              | 4,250 % fällig am 30.01.2031                                | 1.800          | 2.137                    | 0,08                              | 1,106 % fällig am 24.02.2027                | 800            | 783                      | 0,03                              |
| 3,197 % fällig am 10.06.2031                       | €              | 1.800                    | 0,08                              | Summe Luxemburg                                             |                | 39.644                   | 1,56                              | 3,649 % fällig am 06.04.2028                | 3.100          | 3.061                    | 0,12                              |
| <b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>                |                |                          |                                   | <b>MAURITIUS</b>                                            |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 21.07.2026                | 1.000          | 992                      | 0,04                              |
| 2,201 % fällig am 10.07.2031                       | \$             | 2.900                    | 0,10                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am                           |                |                          |                                   |
| 2,839 % fällig am 13.09.2026                       | 3.811          | 3.747                    | 0,15                              | <b>Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.</b>            |                |                          |                                   | 29.06.2029 (e)(g)                           | €              | 2.000                    | 0,09                              |
| 3,170 % fällig am 11.09.2027                       | 9.226          | 9.037                    | 0,36                              | 4,250 % fällig am 25.03.2027                                | \$             | 1.047                    | 0,04                              | 5,250 % fällig am 14.09.2027                | £              | 1.200                    | 0,07                              |
| 3,261 % fällig am 22.05.2030                       | 3.800          | 3.631                    | 0,14                              | <b>Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.</b>                 |                |                          |                                   | 5,447 % fällig am 05.03.2030                | \$             | 500                      | 0,02                              |
| <b>Nippon Life Insurance Co.</b>                   |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 27.09.2028                                | 3.000          | 3.027                    | 0,12                              | <b>CTP NV</b>                               |                |                          |                                   |
| 2,900 % fällig am 16.09.2051                       | 700            | 604                      | 0,02                              | <b>India Green Power Holdings</b>                           |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 27.09.2031                | €              | 500                      | 0,02                              |
| <b>Nomura Holdings, Inc.</b>                       |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 22.02.2027                                | 1.040          | 1.012                    | 0,04                              | 4,750 % fällig am 05.02.2030                | 3.300          | 4.065                    | 0,16                              |
| 2,172 % fällig am 14.07.2028                       | 4.100          | 3.829                    | 0,15                              | Summe Mauritius                                             |                | 5.055                    | 0,20                              | <b>Danfoss Finance BV</b>                   |                |                          |                                   |
| 2,329 % fällig am 22.01.2027                       | 3.900          | 3.773                    | 0,15                              |                                                             |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 28.04.2026                | 1.300          | 1.498                    | 0,06                              |
| <b>Norinchukin Bank</b>                            |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   | <b>Digital Dutch Finco BV</b>               |                |                          |                                   |
| 1,284 % fällig am 22.09.2026                       | 2.000          | 1.922                    | 0,08                              |                                                             |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 13.09.2033                | 5.300          | 6.231                    | 0,24                              |
| 2,080 % fällig am 22.09.2031                       | 800            | 682                      | 0,03                              |                                                             |                |                          |                                   | <b>Digital Intrepid Holding BV</b>          |                |                          |                                   |
| 5,094 % fällig am 16.10.2029                       | 5.600          | 5.684                    | 0,22                              |                                                             |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.07.2031                | 250            | 247                      | 0,01                              |
|                                                    |                |                          |                                   |                                                             |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 18.07.2032                | 1.000          | 1.005                    | 0,04                              |

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>DSV Finance BV</b>                         |                |                          |                                   | <b>Wabtec Transportation Netherlands BV</b>         |                |                          |                                   | <b>POLEN</b>                                      |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 06.11.2028                  | € 400          | \$ 475                   | 0,02                              | 1,250 % fällig am 03.12.2027                        | € 4.200        | \$ 4.775                 | 0,19                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 06.11.2030                  | 200            | 237                      | 0,01                              | <b>ZF Europe Finance BV</b>                         |                |                          |                                   | <b>ORLEN S.A.</b>                                 |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 06.11.2032                  | 600            | 706                      | 0,03                              | 4,750 % fällig am 31.01.2029                        | 3.100          | 3.430                    | 0,13                              | 3,625 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 06.11.2034                  | 600            | 690                      | 0,03                              |                                                     |                |                          |                                   | 02.07.2032 (b)                                    | € 1.900        | \$ 2.214                 | 0,09                              |
| <b>Enel Finance International NV</b>          |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                               |                |                          |                                   | <b>RUMÄNIEN</b>                                   |                |                          |                                   |
| 0,625 % fällig am 28.05.2029                  | 1.500          | 1.623                    | 0,06                              | <b>Green Lion BV</b>                                |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   |
| 2,125 % fällig am 12.07.2028                  | \$ 700         | 654                      | 0,03                              | 2,603 % fällig am 23.10.2060                        | 4.600          | 5.388                    | 0,21                              | <b>Romania Government International Bond</b>      |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 12.07.2031                  | 3.600          | 3.160                    | 0,12                              | 2,633 % fällig am 23.07.2065                        | 4.900          | 5.744                    | 0,22                              | 1,375 % fällig am 02.12.2029                      | 500            | 514                      | 0,02                              |
| 3,875 % fällig am 23.01.2035                  | € 4.000        | 4.765                    | 0,19                              | <b>Green Storm BV</b>                               |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 13.07.2030                      | 2.500          | 2.524                    | 0,10                              |
| 7,500 % fällig am 14.10.2032                  | \$ 600         | 684                      | 0,03                              | 2,420 % fällig am 22.02.2071                        | 4.700          | 5.495                    | 0,22                              | 2,625 % fällig am 02.12.2040                      | 3.400          | 2.488                    | 0,10                              |
| <b>Flora Food Management BV</b>               |                |                          |                                   | 2,480 % fällig am 22.02.2062                        | 4.700          | 5.507                    | 0,22                              | 3,750 % fällig am 07.02.2034                      | 900            | 903                      | 0,03                              |
| 6,875 % fällig am 02.07.2029                  | € 2.600        | 3.103                    | 0,12                              | 2,810 % fällig am 22.02.2068                        | 200            | 235                      | 0,01                              | 4,625 % fällig am 03.04.2049                      | 100            | 88                       | 0,00                              |
| <b>Holcim Sterling Finance Netherlands BV</b> |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 11.07.2032 (i)                  | 1.200          | 1.423                    | 0,06                              |
| 2,250 % fällig am 04.04.2034                  | £ 1.800        | 1.930                    | 0,08                              |                                                     |                |                          |                                   | Summe Rumänien                                    |                | 7.940                    | 0,31                              |
| <b>Iberdrola International BV</b>             |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   | <b>SERBIEN</b>                                    |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 15.09.2033                  | \$ 1.200       | 1.299                    | 0,05                              | <b>BNG Bank NV</b>                                  |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>ING Groep NV</b>                           |                |                          |                                   | 0,050 % fällig am 20.11.2029                        | 700            | 742                      | 0,03                              | <b>Serbia Government International Bond</b>       |                |                          |                                   |
| 1,250 % fällig am 16.02.2027                  | € 600          | 700                      | 0,03                              | 2,750 % fällig am 11.01.2034                        | 3.000          | 3.482                    | 0,14                              | 1,650 % fällig am 03.03.2033                      | 400            | 385                      | 0,01                              |
| 3,375 % fällig am 19.11.2032                  | 1.100          | 1.294                    | 0,05                              | 2,750 % fällig am 28.08.2034                        | 1.800          | 2.079                    | 0,08                              | <b>SINGAPUR</b>                                   |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 12.02.2035                  | 3.400          | 4.128                    | 0,16                              | 3,000 % fällig am 11.01.2033                        | 5.000          | 5.937                    | 0,24                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   |
| 5,525 % fällig am 25.03.2036                  | \$ 6.500       | 6.620                    | 0,26                              | 3,250 % fällig am 29.08.2033                        | 14.000         | 16.872                   | 0,66                              | <b>Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.</b>   |                |                          |                                   |
| <b>JAB Holdings BV</b>                        |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 19.05.2028                        | \$ 1.600       | 1.588                    | 0,06                              | 5,699 % fällig am 11.04.2045                      | \$ 8.000       | 7.995                    | 0,31                              |
| 4,500 % fällig am 08.04.2052                  | 7.300          | 5.551                    | 0,22                              | <b>Nederlandse Waterschapsbank NV</b>               |                |                          |                                   | 5,781 % fällig am 11.04.2043                      | 5.978          | 5.972                    | 0,24                              |
| 5,000 % fällig am 12.06.2033                  | € 200          | 250                      | 0,01                              | 0,125 % fällig am 03.09.2035                        | € 2.000        | 1.738                    | 0,07                              |                                                   |                | 13.967                   | 0,55                              |
| <b>JDE Peet's NV</b>                          |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 10.01.2034                        | 2.500          | 2.864                    | 0,11                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |                |                          |                                   |
| 0,500 % fällig am 16.01.2029                  | 100            | 108                      | 0,00                              | 2,750 % fällig am 17.12.2029                        | 500            | 594                      | 0,02                              | <b>Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.</b>    |                |                          |                                   |
| 1,125 % fällig am 16.06.2033                  | 800            | 776                      | 0,03                              | 3,000 % fällig am 20.04.2033                        | 2.900          | 3.435                    | 0,14                              | 5,340 % fällig am 19.05.2063                      | 1.250          | 1.160                    | 0,05                              |
| 1,375 % fällig am 15.01.2027                  | \$ 1.482       | 1.411                    | 0,06                              | <b>Netherlands Government International Bond</b>    |                |                          |                                   | <b>SingTel Group Treasury Pte. Ltd.</b>           |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 24.09.2031                  | 2.458          | 2.097                    | 0,08                              | 3,250 % fällig am 15.01.2044                        | 2.150          | 2.574                    | 0,10                              | 3,875 % fällig am 28.08.2028                      | 900            | 892                      | 0,03                              |
| 4,125 % fällig am 23.01.2030                  | € 800          | 978                      | 0,04                              |                                                     |                |                          |                                   | <b>United Overseas Bank Ltd.</b>                  |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 23.01.2034                  | 300            | 369                      | 0,01                              | Summe Niederlande                                   |                | 41.905                   | 1,65                              | 3,863 % fällig am 07.10.2032 (g)                  | 4.000          | 3.942                    | 0,15                              |
| <b>Lseg Netherlands BV</b>                    |                |                          |                                   |                                                     |                | 251.432                  | 9,88                              |                                                   |                | 5.994                    | 0,23                              |
| 4,125 % fällig am 29.09.2026                  | 1.500          | 1.794                    | 0,07                              | <b>NEUSEELAND</b>                                   |                |                          |                                   | Summe Singapur                                    |                | 19.961                   | 0,78                              |
| 4,231 % fällig am 29.09.2030                  | 2.100          | 2.603                    | 0,10                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   | <b>SLOWENIEN</b>                                  |                |                          |                                   |
| <b>Nationale-Nederlanden Bank NV</b>          |                |                          |                                   | <b>Auckland Council</b>                             |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   |
| 0,500 % fällig am 21.09.2028                  | 2.900          | 3.185                    | 0,12                              | 3,000 % fällig am 18.03.2034                        | 1.700          | 1.970                    | 0,08                              | <b>Slovenia Government International Bond</b>     |                |                          |                                   |
| 1,875 % fällig am 17.05.2032                  | 500            | 550                      | 0,02                              | <b>NORWEGEN</b>                                     |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| <b>NE Property BV</b>                         |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                                   | 02.07.2035 (b)                                    | € 4.880        | 5.730                    | 0,22                              |
| 2,000 % fällig am 20.01.2030                  | 3.900          | 4.319                    | 0,17                              | <b>DNB Bank ASA</b>                                 |                |                          |                                   | <b>SÜDAFRIKA</b>                                  |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027                  | 600            | 711                      | 0,03                              | 3,000 % fällig am 29.11.2030                        | 2.000          | 2.347                    | 0,09                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>NIBC Bank NV</b>                           |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 15.01.2031                        | 400            | 474                      | 0,02                              | <b>South Africa Government International Bond</b> |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 24.01.2030                  | 5.900          | 6.982                    | 0,27                              | 3,125 % fällig am 20.05.2031                        | 700            | 821                      | 0,03                              | 7,100 % fällig am 19.11.2036                      | \$ 2.900       | 2.880                    | 0,11                              |
| <b>NN Group NV</b>                            |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 01.11.2029                        | 700            | 868                      | 0,04                              | <b>SÜDKOREA</b>                                   |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 13.01.2048                  | 200            | 244                      | 0,01                              | <b>Norsk Hydro ASA</b>                              |                |                          |                                   | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>           |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 11.09.2034                  |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 23.01.2032                        | 3.900          | 4.604                    | 0,18                              | <b>KB Kookmin Card Co. Ltd.</b>                   |                |                          |                                   |
| (e)(g)                                        | 1.700          | 1.979                    | 0,08                              | <b>Statkraft A/S</b>                                |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 13.05.2026                      | 2.600          | 2.532                    | 0,10                              |
| 6,000 % fällig am 03.11.2043                  | 2.100          | 2.753                    | 0,11                              | 3,125 % fällig am 13.12.2031                        | 500            | 590                      | 0,02                              | <b>KEB Hana Bank</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Novo Nordisk Finance Netherlands BV</b>    |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 22.03.2039                        | 500            | 594                      | 0,02                              | 5,375 % fällig am 23.04.2027                      | 1.500          | 1.530                    | 0,06                              |
| 2,340 % fällig am 27.05.2027                  | 2.750          | 3.231                    | 0,13                              |                                                     |                | 10.298                   | 0,40                              | <b>Kookmin Bank</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>OCI NV</b>                                 |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)                  | 900            | 805                      | 0,03                              |
| 6,700 % fällig am 16.03.2033                  | \$ 2.000       | 2.215                    | 0,09                              | <b>Kommunalbanken A/S</b>                           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 13.04.2027                      | € 2.000        | 2.411                    | 0,10                              |
| <b>Prosus NV</b>                              |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 05.11.2031                        | 1.200          | 1.400                    | 0,06                              | <b>KT Corp.</b>                                   |                |                          |                                   |
| 2,085 % fällig am 19.01.2030                  | € 1.300        | 1.451                    | 0,06                              | Summe Norwegen                                      |                | 11.698                   | 0,46                              | 4,375 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| 2,778 % fällig am 19.01.2034                  | 200            | 214                      | 0,01                              | <b>PERU</b>                                         |                |                          |                                   | 03.01.2029 (b)                                    | \$ 2.600       | 2.600                    | 0,10                              |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027                  | \$ 2.200       | 2.155                    | 0,08                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>             |                |                          |                                   | <b>Shinhan Bank Co. Ltd.</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Sagax Euro MTN NL BV</b>                   |                |                          |                                   | <b>Banco de Credito del Peru S.A.</b>               |                |                          |                                   | 1,183 % fällig am 29.09.2025                      | AUD 1.100      | 716                      | 0,03                              |
| 1,000 % fällig am 17.05.2029                  | € 1.000        | 1.077                    | 0,04                              | 6,450 % fällig am 30.07.2035                        | \$ 2.600       | 2.653                    | 0,10                              | 3,320 % fällig am 29.01.2027                      | € 300          | 357                      | 0,01                              |
| <b>Sartorius Finance BV</b>                   |                |                          |                                   | <b>Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.</b> |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 14.09.2026                  | 600            | 718                      | 0,03                              | 9,700 % fällig am 05.03.2045                        | PEN 2.500      | 736                      | 0,03                              | 23.04.2029 (g)                                    | \$ 1.100       | 1.072                    | 0,04                              |
| 4,375 % fällig am 14.09.2029                  | 500            | 615                      | 0,02                              |                                                     |                | 3.389                    | 0,13                              | 4,375 % fällig am                                 |                |                          |                                   |
| <b>Siemens Financieringsmaatschappij NV</b>   |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                             |                |                          |                                   | 13.04.2032 (g)                                    | 2.200          | 2.109                    | 0,08                              |
| 2,625 % fällig am 27.05.2029                  | 2.200          | 2.591                    | 0,10                              | <b>Corp. Financiera de Desarrollo S.A.</b>          |                |                          |                                   | 5,747 % fällig am 16.11.2025                      | AUD 1.500      | 989                      | 0,04                              |
| 3,125 % fällig am 27.05.2033                  | 900            | 1.057                    | 0,04                              | 5,500 % fällig am 06.05.2030                        | \$ 2.000       | 2.027                    | 0,08                              | <b>Shinhan Financial Group Co. Ltd.</b>           |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 27.05.2036                  | 300            | 355                      | 0,01                              | <b>Peru Government International Bond</b>           |                |                          |                                   | 1,350 % fällig am 10.01.2026                      | \$ 300         | 295                      | 0,01                              |
| 3,625 % fällig am 22.02.2044                  | 500            | 560                      | 0,02                              | 1,950 % fällig am                                   |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 24.07.2028                      | 900            | 915                      | 0,04                              |
| <b>Sika Capital BV</b>                        |                |                          |                                   | 17.11.2036 (i)                                      | € 2.000        | 1.906                    | 0,08                              | <b>SK Hynix, Inc.</b>                             |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 03.11.2026                  | 2.000          | 2.388                    | 0,09                              | 5,500 % fällig am 30.03.2036                        | \$ 1.000       | 1.002                    | 0,04                              | 6,375 % fällig am 17.01.2028                      | 3.400          | 3.547                    | 0,14                              |
| <b>Stedin Holding NV</b>                      |                |                          |                                   |                                                     |                | 4.935                    | 0,20                              | Summe Südkorea                                    |                | 19.878                   | 0,78                              |
| 0,500 % fällig am 14.11.2029                  | 100            | 107                      | 0,00                              |                                                     |                | 8.324                    | 0,33                              |                                                   |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 20.06.2031                  | 4.000          | 4.845                    | 0,19                              |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>TenneT Holding BV</b>                      |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 28.04.2032                  | 1.000          | 1.250                    | 0,05                              |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Universal Music Group NV</b>               |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 13.06.2031                  | 1.800          | 2.205                    | 0,09                              |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Vesteda Finance BV</b>                     |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 0,750 % fällig am 18.10.2031                  | 5.000          | 5.008                    | 0,20                              |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Volkswagen International Finance NV</b>    |                |                          |                                   |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |
| 5,994 % fällig am 15.11.2033 (e)              | 1.700          | 2.015                    | 0,08                              |                                                     |                |                          |                                   |                                                   |                |                          |                                   |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

|                                                                              | PARI   | MARKT- WERT | % DES NETTO- VERMÖ- GENS |                                      | PARI                                 | MARKT- WERT | % DES NETTO- VERMÖ- GENS |                                         | PARI                         | MARKT- WERT                  | % DES NETTO- VERMÖ- GENS |       |      |
|------------------------------------------------------------------------------|--------|-------------|--------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|-------------|--------------------------|-----------------------------------------|------------------------------|------------------------------|--------------------------|-------|------|
| BESCHREIBUNG                                                                 | (000S) | (000S)      |                          | BESCHREIBUNG                         | (000S)                               | (000S)      |                          | BESCHREIBUNG                            | (000S)                       | (000S)                       |                          |       |      |
| SPANIEN                                                                      |        |             |                          | 3,375 % fällig am 05.10.2054         |                                      |             |                          | €                                       | 5.600                        | \$ 5.992                     | 0,23                     |       |      |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                                             |        |             |                          |                                      |                                      |             |                          |                                         |                              |                              |                          |       |      |
| Amadeus IT Group S.A.                                                        |        |             |                          |                                      |                                      | 16.521      | 0,65                     | 8,500 % fällig am                       |                              |                              |                          |       |      |
| 3,375 % fällig am 25.03.2030                                                 | €      | 800         | \$ 953                   | 0,04                                 | Summe Supranational                  | 42.295      | 1,66                     | 15.06.2030 (e)(g)                       | £                            | 1.200                        | 1.715 0,07               |       |      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.                                         |        |             |                          | SCHWEDEN                             |                                      |             |                          | Berkeley Group PLC                      |                              |                              |                          |       |      |
| 4,625 % fällig am 13.01.2031                                                 | 1.000  | 1.251       | 0,05                     | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL     |                                      |             |                          | 2,500 % fällig am 11.08.2031            |                              |                              |                          |       |      |
| 5,381 % fällig am 13.03.2029                                                 | \$     | 2.200       | 2.267                    | 0,09                                 | Castellum AB                         |             |                          | British Telecommunications PLC          |                              |                              |                          |       |      |
| 5,862 % fällig am 14.09.2026                                                 | 1.200  | 1.203       | 0,05                     | 3,125 % fällig am 02.12.2026 (e)     | 2.000                                | 2.302       | 0,09                     | 3,250 % fällig am 08.11.2029            |                              |                              |                          |       |      |
| 7,750 % fällig am                                                            |        |             |                          | Ellevio AB                           |                                      |             |                          | 3,875 % fällig am 20.01.2034            |                              |                              |                          |       |      |
| 14.01.2032 (e)(g)                                                            | 1.300  | 1.321       | 0,05                     | 3,750 % fällig am 14.05.2035         | 1.500                                | 1.758       | 0,07                     | 6,375 % fällig am 03.12.2055            |                              |                              |                          |       |      |
| Banco Santander S.A.                                                         |        |             |                          | EQT AB                               |                                      |             |                          | Brookfield Finance UK PLC               |                              |                              |                          |       |      |
| 3,250 % fällig am 14.02.2028                                                 | €      | 800         | 962                      | 0,04                                 | 0,875 % fällig am 14.05.2031         | 2.900       | 2.946                    | 0,11                                    | 2,340 % fällig am 30.01.2032 |                              |                          |       |      |
| 3,625 % fällig am                                                            |        |             |                          | 2,375 % fällig am 06.04.2028         | 1.000                                | 1.165       | 0,05                     | Burberry Group PLC                      |                              |                              |                          |       |      |
| 21.03.2029 (e)(g)                                                            | 600    | 651         | 0,03                     | 2,875 % fällig am 06.04.2032         | 3.500                                | 3.921       | 0,15                     | 1,125 % fällig am 21.09.2025            |                              |                              |                          |       |      |
| 4,125 % fällig am                                                            | 1.000  | 1.151       | 0,04                     | Fastighets AB Balder                 |                                      |             |                          | 5,750 % fällig am 20.06.2030            |                              |                              |                          |       |      |
| 6,499 % fällig am 23.01.2031                                                 | AUD    | 3.500       | 2.431                    | 0,09                                 | 1,250 % fällig am 28.01.2028         | 100         | 112                      | 0,00                                    | Chanel Ceres PLC             |                              |                          |       |      |
| 6,921 % fällig am 08.08.2033                                                 | \$     | 5.000       | 5.422                    | 0,21                                 | Sagax AB                             |             |                          | 0,500 % fällig am 31.07.2026            |                              |                              |                          |       |      |
| Bankinter S.A.                                                               |        |             |                          | 1,125 % fällig am 30.01.2027         | 800                                  | 915         | 0,04                     | 1,000 % fällig am 31.07.2031            |                              |                              |                          |       |      |
| 0,625 % fällig am 06.10.2027                                                 | €      | 1.000       | 1.127                    | 0,04                                 | 4,000 % fällig am 13.03.2032         | 2.300       | 2.729                    | 0,11                                    | Clarion Funding PLC          |                              |                          |       |      |
| CaixaBank S.A.                                                               |        |             |                          |                                      |                                      | 15.848      | 0,62                     | 1,250 % fällig am 13.11.2032            |                              |                              |                          |       |      |
| 0,625 % fällig am 21.01.2028                                                 | 3.000  | 3.426       | 0,13                     | STAATSEMISSIONEN                     |                                      |             |                          | 1,875 % fällig am 22.01.2035            |                              |                              |                          |       |      |
| 1,500 % fällig am 03.12.2026                                                 | £      | 700         | 946                      | 0,04                                 | Sweden Government International Bond |             | 864                      | 0,04                                    | Compass Group PLC            |                              |                          |       |      |
| 5,375 % fällig am 14.11.2030                                                 | €      | 100         | 129                      | 0,01                                 | 0,125 % fällig am 09.09.2030         | 9.000       |                          |                                         | 3,250 % fällig am 16.09.2033 |                              |                          |       |      |
| 7,500 % fällig am                                                            |        |             |                          |                                      | Summe Schweden                       | 16.712      | 0,66                     | CSL Finance PLC                         |                              |                              |                          |       |      |
| 16.01.2030 (e)(g)                                                            | 1.600  | 2.065       | 0,08                     | SCHWEIZ                              |                                      |             |                          | 4,250 % fällig am 27.04.2032            |                              |                              |                          |       |      |
| Cellnex Finance Co. S.A.                                                     |        |             |                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL     |                                      |             |                          | Derwent London PLC                      |                              |                              |                          |       |      |
| 3,875 % fällig am 07.07.2041                                                 | \$     | 1.000       | 790                      | 0,03                                 | UBS AG                               |             |                          |                                         | 1,875 % fällig am 17.11.2031 |                              |                          |       |      |
| Iberdrola Finanzas S.A.                                                      |        |             |                          |                                      | 5,650 % fällig am 11.09.2028         | \$          | 3.300                    | 3.437                                   | 0,14                         | DS Smith PLC                 |                          |       |      |
| 4,247 % fällig am                                                            | €      | 1.000       | 1.194                    | 0,05                                 | UBS Group AG                         |             |                          |                                         | 4,375 % fällig am 27.07.2027 |                              |                          |       |      |
| 28.05.2030 (e)                                                               |        |             |                          | 1,305 % fällig am 02.02.2027         | 1.600                                | 1.570       | 0,06                     | Ferguson Finance PLC                    |                              |                              |                          |       |      |
| Telefonica Emisiones S.A.                                                    |        |             |                          | 4,125 % fällig am 24.09.2025         | 4.300                                | 4.293       | 0,17                     | 3,250 % fällig am 02.06.2030            |                              |                              |                          |       |      |
| 4,183 % fällig am 21.11.2033                                                 | 1.100  | 1.326       | 0,05                     | 4,194 % fällig am 01.04.2031         | 10.350                               | 10.138      | 0,40                     | 4,650 % fällig am 20.04.2032            |                              |                              |                          |       |      |
| Werfen S.A.                                                                  |        |             |                          | 4,282 % fällig am 09.01.2028         | 1.050                                | 1.046       | 0,04                     | Grainger PLC                            |                              |                              |                          |       |      |
| 3,625 % fällig am 12.02.2032                                                 | 4.600  | 5.392       | 0,21                     | 4,550 % fällig am 17.04.2026         | 1.100                                | 1.100       | 0,04                     | 3,000 % fällig am 03.07.2030            |                              |                              |                          |       |      |
| 4,625 % fällig am 06.06.2028                                                 | 2.200  | 2.704       | 0,11                     | 5,959 % fällig am 12.01.2034         | 1.400                                | 1.474       | 0,06                     | Haleon UK Capital PLC                   |                              |                              |                          |       |      |
|                                                                              |        | 36.711      | 1,44                     | Summe Schweiz                        |                                      | 23.058      | 0,91                     | 2,875 % fällig am 18.09.2028            |                              |                              |                          |       |      |
| STAATSEMISSIONEN                                                             |        |             |                          | THAILAND                             |                                      |             |                          | 4,625 % fällig am 18.09.2033            |                              |                              |                          |       |      |
| Adif Alta Velocidad                                                          |        |             |                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL     |                                      |             |                          | HSBC Holdings PLC                       |                              |                              |                          |       |      |
| 3,500 % fällig am 30.04.2032                                                 | 200    | 240         | 0,01                     | Bangkok Bank PCL                     |                                      |             |                          | 1,750 % fällig am 24.07.2027            |                              |                              |                          |       |      |
| Junta de Andalucia                                                           |        |             |                          | 6,056 % fällig am 25.03.2040 (g)     | 2.000                                | 2.002       | 0,08                     | 2,804 % fällig am 24.05.2032            |                              |                              |                          |       |      |
| 3,950 % fällig am 30.04.2033                                                 | 2.500  | 3.097       | 0,12                     | VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE         |                                      |             |                          | 2,848 % fällig am 04.06.2031            |                              |                              |                          |       |      |
| Junta de Castilla y Leon                                                     |        |             |                          | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL     |                                      |             |                          | 2,871 % fällig am 22.11.2032            |                              |                              |                          |       |      |
| 2,900 % fällig am 30.04.2032                                                 | 4.700  | 5.505       | 0,22                     | Abu Dhabi National Energy Co. PJSC   |                                      |             |                          | 3,000 % fällig am 22.07.2028            |                              |                              |                          |       |      |
| 3,500 % fällig am 30.04.2033                                                 | 1.400  | 1.684       | 0,07                     | 4,750 % fällig am 09.03.2037         | 4.000                                | 3.831       | 0,15                     | 3,973 % fällig am 22.05.2030            |                              |                              |                          |       |      |
| Spain Government International Bond                                          |        |             |                          | GROSSBRITANNIEN                      |                                      |             |                          | 4,041 % fällig am 13.03.2028            |                              |                              |                          |       |      |
| 1,000 % fällig am 30.07.2042                                                 | 3.170  | 2.463       | 0,10                     | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE     |                                      |             |                          | 4,292 % fällig am 12.09.2026            |                              |                              |                          |       |      |
| 3,200 % fällig am 31.10.2035                                                 | 2.650  | 3.103       | 0,12                     | Pulse UK PLC                         |                                      |             |                          | 4,856 % fällig am 23.05.2033            |                              |                              |                          |       |      |
| Xunta de Galicia                                                             |        |             |                          | 4,884 % fällig am 27.05.2036         | £                                    | 1.800       | 2.469                    | 0,10                                    | 5,402 % fällig am 11.08.2033 |                              |                          |       |      |
| 3,296 % fällig am 30.04.2031                                                 | 900    | 1.085       | 0,04                     | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL     |                                      |             |                          | Informa PLC                             |                              |                              |                          |       |      |
|                                                                              |        | 17.177      | 0,68                     | Affinity Water Finance PLC           |                                      |             |                          | 2,125 % fällig am 06.10.2025            |                              |                              |                          |       |      |
| Summe Spanien                                                                |        | 53.888      | 2,12                     | 6,250 % fällig am 12.09.2040         | 850                                  | 1.184       | 0,05                     | InterContinental Hotels Group PLC       |                              |                              |                          |       |      |
| SUPRANATIONAL                                                                |        |             |                          | Anglian Water Services Financing PLC |                                      |             |                          | 3,375 % fällig am 08.10.2028            |                              |                              |                          |       |      |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                                             |        |             |                          | 2,750 % fällig am 26.10.2029         | 100                                  | 125         | 0,00                     | International Distribution Services PLC |                              |                              |                          |       |      |
| Asian Development Bank                                                       |        |             |                          | 6,250 % fällig am 12.09.2044         | 2.500                                | 3.317       | 0,13                     | 7,375 % fällig am 14.09.2030            |                              |                              |                          |       |      |
| 1,500 % fällig am 04.05.2028                                                 | CAD    | 2.000       | 1.414                    | 0,05                                 | Assura Financing PLC                 |             |                          | John Lewis PLC                          |                              |                              |                          |       |      |
| Banque Ouest Africaine de Developpement                                      |        |             |                          | 1,625 % fällig am 30.06.2033         | 1.200                                | 1.226       | 0,05                     | 4,250 % fällig am 18.12.2034            |                              |                              |                          |       |      |
| 2,750 % fällig am 22.01.2033                                                 | €      | 3.800       | 3.746                    | 0,15                                 | Aviva PLC                            |             |                          | Land Securities Capital Markets PLC     |                              |                              |                          |       |      |
| Rat der Europäischen Entwicklungsbank                                        |        |             |                          | 6,125 % fällig am 12.09.2054         | 400                                  | 550         | 0,02                     | 4,875 % fällig am 15.09.2034            |                              |                              |                          |       |      |
| 3,625 % fällig am 08.05.2028                                                 | \$     | 3.000       | 2.992                    | 0,12                                 | 7,750 % fällig am                    |             |                          | Legal & General Group PLC               |                              |                              |                          |       |      |
| Eurofima Europeaische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmateri |        |             |                          | 30.09.2032 (e)(g)                    | 1.500                                | 2.095       | 0,08                     | 6,625 % fällig am 01.04.2055            |                              |                              |                          |       |      |
| 3,125 % fällig am 09.11.2031                                                 | €      | 3.200       | 3.844                    | 0,15                                 | Barclays PLC                         |             |                          | Lloyds Banking Group PLC                |                              |                              |                          |       |      |
| Europäische Investitionsbank                                                 |        |             |                          | 1,700 % fällig am 03.11.2026         | 700                                  | 950         | 0,04                     | 3,500 % fällig am 06.11.2030            |                              |                              |                          |       |      |
| 0,750 % fällig am 15.07.2027                                                 | AUD    | 2.100       | 1.302                    | 0,05                                 | 2,279 % fällig am 24.11.2027         | \$          | 1.000                    | 970                                     | 0,04                         | €                            | 700                      | 838   | 0,03 |
| Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung                         |        |             |                          | 2,667 % fällig am 10.03.2032         | 1.000                                | 888         | 0,03                     | 3,750 % fällig am 18.03.2028            |                              |                              |                          |       |      |
| 0,125 % fällig am 03.01.2051                                                 | €      | 1.600       | 813                      | 0,03                                 | 2,894 % fällig am 24.11.2032         |             | 300                      | 266                                     | 0,01                         | £                            | 1.600                    | 1.581 | 0,06 |
| 2,600 % fällig am 28.08.2031                                                 | 1.200  | 1.406       | 0,05                     | 3,250 % fällig am 12.02.2027         | £                                    | 1.000       | 1.344                    | 0,05                                    | 5,462 % fällig am 05.01.2028 |                              |                          |       |      |
| 3,100 % fällig am 14.04.2038                                                 | 2.900  | 3.343       | 0,13                     | 4,918 % fällig am 08.08.2030         | €                                    | 600         | 752                      | 0,03                                    | 5,679 % fällig am 05.01.2035 |                              |                          |       |      |
| 3,875 % fällig am 28.08.2034                                                 | \$     | 1.825       | 1.775                    | 0,07                                 | 5,746 % fällig am 09.08.2033         | \$          | 3.350                    | 3.474                                   | 0,14                         | 5,920 % fällig am 07.08.2027 |                          |       |      |
| International Development Association                                        |        |             |                          | 6,224 % fällig am 09.05.2034         | 600                                  | 637         | 0,03                     | 5,985 % fällig am 07.08.2027            |                              |                              |                          |       |      |
| 3,200 % fällig am 18.01.2044                                                 | €      | 1.500       | 1.674                    | 0,07                                 | 7,090 % fällig am 06.11.2029         | £           | 3.000                    | 4.380                                   | 0,17                         | 7,500 % fällig am            |                          |       |      |
| 4,375 % fällig am 11.06.2029                                                 | \$     | 3.400       | 3.465                    | 0,14                                 |                                      |             |                          |                                         | 27.06.2030 (e)(g)            |                              |                          |       |      |
|                                                                              |        | 25.774      | 1,01                     | LONDON & QUADRANT HOUSING TRUST      |                                      |             |                          | 2,125 % fällig am 31.03.2032            |                              |                              |                          |       |      |
| STAATSEMISSIONEN                                                             |        |             |                          | LONDON POWER NETWORKS PLC            |                                      |             |                          | 3,837 % fällig am 11.06.2037            |                              |                              |                          |       |      |
| Europäische Union                                                            |        |             |                          | LSEGA Financing PLC                  |                                      |             |                          | €                                       |                              |                              |                          |       |      |
| 1,250 % fällig am 04.02.2043                                                 | €      | 9.800       | 8.050                    | 0,32                                 | 2,500 % fällig am 06.04.2031         | \$          | 1.809                    | 1.617                                   | 0,06                         | €                            | 2.200                    | 2.584 | 0,10 |
| 3,250 % fällig am 04.02.2050                                                 | 2.300  | 2.479       | 0,10                     | Marex Group PLC                      |                                      |             |                          | 3,200 % fällig am 06.04.2041            |                              |                              |                          |       |      |
|                                                                              |        |             |                          | 5,829 % fällig am 08.05.2028         | 1.900                                | 1.925       | 0,08                     | Marks & Spencer PLC                     |                              |                              |                          |       |      |
|                                                                              |        |             |                          | 4,500 % fällig am 10.07.2027         | £                                    | 300         | 400                      | 0,02                                    | 4,500 % fällig am 10.07.2027 |                              |                          |       |      |

|                                      |        |        |        | % DES  |                             |                              |        |        | % DES  |                                      |        |                   |        |        | % DES |
|--------------------------------------|--------|--------|--------|--------|-----------------------------|------------------------------|--------|--------|--------|--------------------------------------|--------|-------------------|--------|--------|-------|
| BESCHREIBUNG                         | PARI   | MARKT- | NETTO- | VERMÖ- | BESCHREIBUNG                | PARI                         | MARKT- | NETTO- | VERMÖ- | BESCHREIBUNG                         | PARI   | MARKT-            | NETTO- | VERMÖ- | % DES |
|                                      | (000S) | WERT   | WERT   | GENS   |                             | (000S)                       | WERT   | WERT   | GENS   |                                      | (000S) | WERT              | WERT   | GENS   |       |
| Motability Operations Group PLC      |        |        |        |        | Yorkshire Water Finance PLC |                              |        |        |        | AT&T, Inc.                           |        |                   |        |        |       |
| 1,500 % fällig am 20.01.2041         | £      | 400    | \$     | 308    | 0,01                        | 6,375 % fällig am 18.11.2034 | £      | 3.350  | \$     | 4.745                                | 0,19   | 3,550 % fällig am |        |        |       |
| 3,500 % fällig am 17.07.2031         | €      | 2.300  |        | 2.737  | 0,11                        |                              |        |        |        | 15.09.2055 (i)                       |        | \$                | 246    | \$     | 166   |
| 3,625 % fällig am 24.07.2029         |        | 3.100  |        | 3.736  | 0,15                        |                              |        |        |        |                                      |        |                   | 3.900  |        | 2.619 |
| 3,625 % fällig am 22.01.2033         |        | 1.300  |        | 1.532  | 0,06                        |                              |        |        |        | 3,650 % fällig am 15.09.2059         |        |                   | 600    |        | 420   |
| 3,875 % fällig am 24.01.2034         |        | 3.100  |        | 3.697  | 0,15                        |                              |        |        |        | 3,800 % fällig am 01.12.2057         |        |                   | 2.200  |        | 1.540 |
| 4,000 % fällig am 22.01.2037         |        | 1.400  |        | 1.655  | 0,06                        |                              |        |        |        | 3,850 % fällig am 01.06.2060         |        |                   |        |        | 0,06  |
| 4,250 % fällig am 17.06.2035         |        | 1.700  |        | 2.066  | 0,08                        |                              |        |        |        | 4,850 % fällig am                    |        |                   |        |        |       |
| Nationwide Building Society          |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 25.05.2047 (h)                       | CAD    | 1.500             | 1.054  | 0,04   |       |
| 3,960 % fällig am 18.07.2030         | \$     | 600    |        | 586    | 0,02                        |                              |        |        |        | Autodesk, Inc.                       |        |                   |        |        |       |
| NatWest Group PLC                    |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,400 % fällig am 15.12.2031         | \$     | 4.574             | 4.015  | 0,16   |       |
| 0,780 % fällig am 26.02.2030         | €      | 1.200  |        | 1.306  | 0,05                        |                              |        |        |        | AutoZone, Inc.                       |        |                   |        |        |       |
| 2,057 % fällig am 09.11.2028         | £      | 1.900  |        | 2.457  | 0,10                        |                              |        |        |        | 5,125 % fällig am 15.06.2030         |        | 5.100             | 5.231  | 0,21   |       |
| 4,699 % fällig am 14.03.2028         | €      | 1.000  |        | 1.219  | 0,05                        |                              |        |        |        |                                      |        |                   |        |        |       |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029         | \$     | 1.200  |        | 1.212  | 0,05                        |                              |        |        |        | Avangrid, Inc.                       |        |                   |        |        |       |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030         |        | 2.100  |        | 2.131  | 0,08                        |                              |        |        |        | 3,800 % fällig am 01.06.2029         |        | 2.058             | 2.011  | 0,08   |       |
| NatWest Markets PLC                  |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | Bain Capital Specialty Finance, Inc. |        |                   |        |        |       |
| 5,899 % fällig am 23.08.2028         | AUD    | 900    |        | 617    | 0,02                        |                              |        |        |        | 5,950 % fällig am 15.03.2030         |        | 2.900             | 2.868  | 0,11   |       |
| Ocado Group PLC                      |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | Bank of America Corp.                |        |                   |        |        |       |
| 11,000 % fällig am 15.06.2030        | £      | 1.300  |        | 1.739  | 0,07                        |                              |        |        |        | 0,583 % fällig am 24.08.2028         | €      | 200               | 225    | 0,01   |       |
| Peabody Capital PLC                  |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 1,102 % fällig am 24.05.2032         |        | 300               | 313    | 0,01   |       |
| 2,750 % fällig am 02.03.2034         |        | 500    |        | 561    | 0,02                        |                              |        |        |        | 1,734 % fällig am 22.07.2027         | \$     | 300               | 292    | 0,01   |       |
| Places For People Treasury PLC       |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 1,898 % fällig am 23.07.2031         |        | 2.700             | 2.373  | 0,09   |       |
| 5,375 % fällig am 05.03.2032         |        | 2.100  |        | 2.890  | 0,11                        |                              |        |        |        | 2,087 % fällig am 14.06.2029         |        | 2.400             | 2.250  | 0,09   |       |
| Places for People Treasury PLC       |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,299 % fällig am 21.07.2032         |        | 600               | 523    | 0,02   |       |
| 6,250 % fällig am 06.12.2041         |        | 2.300  |        | 3.156  | 0,12                        |                              |        |        |        | 2,687 % fällig am 22.04.2032         |        | 6.600             | 5.925  | 0,23   |       |
| Prudential Funding Asia PLC          |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,824 % fällig am 27.04.2033         | €      | 700               | 796    | 0,03   |       |
| 2,950 % fällig am 03.11.2033         | \$     | 600    |        | 562    | 0,02                        |                              |        |        |        | 2,884 % fällig am 22.10.2030         | \$     | 1.100             | 1.030  | 0,04   |       |
| Santander UK Group Holdings PLC      |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,972 % fällig am 04.02.2033         |        | 300               | 269    | 0,01   |       |
| 1,673 % fällig am 14.06.2027         |        | 800    |        | 777    | 0,03                        |                              |        |        |        | 3,559 % fällig am 23.04.2027         |        | 2.300             | 2.284  | 0,09   |       |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028         |        | 5.900  |        | 5.783  | 0,23                        |                              |        |        |        | 3,824 % fällig am 20.01.2028         |        | 2.214             | 2.195  | 0,09   |       |
| 6,534 % fällig am 10.01.2029         |        | 600    |        | 626    | 0,02                        |                              |        |        |        | 4,083 % fällig am 20.03.2051         |        | 1.300             | 1.033  | 0,04   |       |
| 6,833 % fällig am 21.11.2026         |        | 750    |        | 756    | 0,03                        |                              |        |        |        | 5,015 % fällig am 22.07.2033         |        | 4.900             | 4.959  | 0,20   |       |
| 7,482 % fällig am 29.08.2029         | £      | 1.600  |        | 2.357  | 0,09                        |                              |        |        |        | 5,288 % fällig am 25.04.2034         |        | 700               | 714    | 0,03   |       |
| Severn Trent Utilities Finance PLC   |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 5,468 % fällig am 23.01.2035         |        | 4.600             | 4.728  | 0,19   |       |
| 2,625 % fällig am 22.02.2033         |        | 1.900  |        | 2.178  | 0,09                        |                              |        |        |        | 5,511 % fällig am 24.01.2036         |        | 10.000            | 10.286 | 0,40   |       |
| 3,875 % fällig am 04.08.2035         | €      | 2.000  |        | 2.364  | 0,09                        |                              |        |        |        | Bank of New York Mellon Corp.        |        |                   |        |        |       |
| 4,000 % fällig am 05.03.2034         |        | 4.500  |        | 5.403  | 0,21                        |                              |        |        |        | 4,706 % fällig am 01.02.2034         |        | 2.800             | 2.770  | 0,11   |       |
| 5,250 % fällig am 04.04.2036         | £      | 1.900  |        | 2.542  | 0,10                        |                              |        |        |        | Becton Dickinson & Co.               | €      | 400               | 480    | 0,02   |       |
| 5,875 % fällig am 31.07.2038         |        | 2.600  |        | 3.595  | 0,14                        |                              |        |        |        | Blackstone Holdings Finance Co. LLC  |        |                   |        |        |       |
| Skipton Building Society             |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,850 % fällig am 05.08.2051         | \$     | 600               | 364    | 0,01   |       |
| 3,250 % fällig am 18.06.2029         | €      | 2.000  |        | 2.405  | 0,09                        |                              |        |        |        | 6,200 % fällig am 22.04.2033         |        | 900               | 965    | 0,04   |       |
| SSE PLC                              |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | BlueHub Loan Fund, Inc.              |        |                   |        |        |       |
| 3,500 % fällig am 18.03.2032         |        | 1.400  |        | 1.665  | 0,07                        |                              |        |        |        | 3,099 % fällig am 01.01.2030         |        | 650               | 585    | 0,02   |       |
| 3,740 % fällig am                    |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | BMW U.S. Capital LLC                 |        |                   |        |        |       |
| 14.01.2026 (e)                       | £      | 1.094  |        | 1.485  | 0,06                        |                              |        |        |        | 4,600 % fällig am 13.08.2027         |        | 1.600             | 1.609  | 0,06   |       |
| 4,000 % fällig am 05.09.2031         | €      | 3.500  |        | 4.284  | 0,17                        |                              |        |        |        | Booking Holdings, Inc.               |        |                   |        |        |       |
| Standard Chartered PLC               |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 4,125 % fällig am 12.05.2033         | €      | 600               | 735    | 0,03   |       |
| 2,678 % fällig am 29.06.2032         | \$     | 500    |        | 441    | 0,02                        |                              |        |        |        | Boston Properties LP                 |        |                   |        |        |       |
| 4,874 % fällig am 10.05.2031         | €      | 2.500  |        | 3.143  | 0,12                        |                              |        |        |        | 2,550 % fällig am 01.04.2032         | \$     | 930               | 785    | 0,03   |       |
| Swiss RE Subordinated Finance PLC    |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 6,500 % fällig am 15.01.2034 (i)     |        | 1.300             | 1.392  | 0,05   |       |
| 6,191 % fällig am 01.04.2046         | \$     | 2.000  |        | 2.001  | 0,08                        |                              |        |        |        | Broadcom, Inc.                       |        |                   |        |        |       |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 5,050 % fällig am 12.07.2029         |        | 3.700             | 3.790  | 0,15   |       |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027         | £      | 15     |        | 23     | 0,00                        |                              |        |        |        | Bush Foundation                      |        |                   |        |        |       |
| TP ICAP Finance PLC                  |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,754 % fällig am 01.10.2050         |        | 375               | 235    | 0,01   |       |
| 2,625 % fällig am 18.11.2028         |        | 400    |        | 505    | 0,02                        |                              |        |        |        | Capital One Financial Corp.          |        |                   |        |        |       |
| 6,375 % fällig am 12.06.2032         |        | 1.900  |        | 2.648  | 0,10                        |                              |        |        |        | 6,183 % fällig am 30.01.2036 (i)     |        | 2.000             | 2.037  | 0,08   |       |
| 7,875 % fällig am 17.04.2030         |        | 1.200  |        | 1.788  | 0,07                        |                              |        |        |        | 6,377 % fällig am 08.06.2034         |        | 2.200             | 2.343  | 0,09   |       |
| Travis Perkins PLC                   |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | CBRE Services, Inc.                  |        |                   |        |        |       |
| 3,750 % fällig am 17.02.2026         |        | 425    |        | 573    | 0,02                        |                              |        |        |        | 2,500 % fällig am 01.04.2031         |        | 1.000             | 884    | 0,03   |       |
| United Utilities Water Finance PLC   |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | Centene Corp.                        |        |                   |        |        |       |
| 3,500 % fällig am 27.02.2033         | €      | 2.400  |        | 2.800  | 0,11                        |                              |        |        |        | 2,625 % fällig am 01.08.2031         |        | 600               | 514    | 0,02   |       |
| 3,750 % fällig am 23.05.2034         |        | 3.500  |        | 4.113  | 0,16                        |                              |        |        |        | 3,000 % fällig am 15.10.2030         |        | 7.000             | 6.259  | 0,25   |       |
| Virgin Media Secured Finance PLC     |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | Charles Schwab Corp.                 |        |                   |        |        |       |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030         | £      | 1.800  |        | 2.233  | 0,09                        |                              |        |        |        | 5,643 % fällig am 19.05.2029         |        | 600               | 622    | 0,02   |       |
| Vmed O2 UK Financing PLC             |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 5,853 % fällig am 19.05.2034         |        | 600               | 638    | 0,03   |       |
| 4,500 % fällig am 15.07.2031         |        | 1.000  |        | 1.231  | 0,05                        |                              |        |        |        | Church & Dwight Co., Inc.            |        |                   |        |        |       |
| 5,625 % fällig am                    |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 5,600 % fällig am 15.11.2032         |        | 1.200             | 1.265  | 0,05   |       |
| 15.04.2032 (b)                       | €      | 2.750  |        | 3.276  | 0,13                        |                              |        |        |        | Citibank N.A.                        |        |                   |        |        |       |
| Vodafone Group PLC                   |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 4,876 % fällig am 19.11.2027         |        | 2.400             | 2.415  | 0,10   |       |
| 2,500 % fällig am 24.05.2039         |        | 1.500  |        | 1.511  | 0,06                        |                              |        |        |        | 5,803 % fällig am 29.09.2028         |        | 2.500             | 2.614  | 0,10   |       |
| 5,125 % fällig am 04.06.2081         | \$     | 2.659  |        | 2.018  | 0,08                        |                              |        |        |        | Citigroup, Inc.                      |        |                   |        |        |       |
| Wessex Water Services Finance PLC    |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,572 % fällig am 03.06.2031         |        | 6.400             | 5.806  | 0,23   |       |
| 6,125 % fällig am 19.09.2034         | £      | 3.100  |        | 4.301  | 0,17                        |                              |        |        |        | 4,412 % fällig am 31.03.2031         |        | 5.800             | 5.740  | 0,23   |       |
| Workspace Group PLC                  |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | Comcast Corp.                        |        |                   |        |        |       |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028         |        | 1.800  |        | 2.278  | 0,09                        |                              |        |        |        | 3,969 % fällig am 01.11.2047         |        | 506               | 390    | 0,02   |       |
| Yorkshire Building Society           |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 3,999 % fällig am 01.11.2049         |        | 967               | 736    | 0,03   |       |
| 3,511 % fällig am 11.10.2030         |        | 2.400  |        | 3.125  | 0,12                        |                              |        |        |        | 4,049 % fällig am 01.11.2052         |        | 1.320             | 994    | 0,04   |       |
|                                      |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 5,500 % fällig am 15.05.2064         |        | 2.000             | 1.864  | 0,07   |       |
|                                      |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | CommonSpirit Health                  |        |                   |        |        |       |
|                                      |        |        |        |        |                             |                              |        |        |        | 2,782 % fällig am 01.10.2030         |        | 600               | 550    | 0,02   |       |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | </ |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|----|
|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|----|

| BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Niagara Mohawk Power Corp.<br>1,960 % fällig am 27.06.2030        | \$ 3.300       | \$ 2.915                 | 0,11                              | RGA Global Funding<br>2,700 % fällig am 18.01.2029                                  | \$ 1.000       | \$ 938                   | 0,04                              | VF Corp.<br>0,625 % fällig am 25.02.2032                                                                                                         | € 600          | \$ 497                   | 0,02                              |
| 5,783 % fällig am 16.09.2052                                      | 2.690          | 2.635                    | 0,10                              | Robert Bosch Finance LLC<br>2,489 % fällig am 28.11.2026                            | € 2.200        | 2.586                    | 0,10                              | 4,125 % fällig am 07.03.2026                                                                                                                     | 200            | 234                      | 0,01                              |
| Northern States Power Co.<br>2,250 % fällig am 01.04.2031         | 1.000          | 902                      | 0,04                              | 2,750 % fällig am 28.05.2028                                                        | 900            | 1.061                    | 0,04                              | 4,250 % fällig am 07.03.2029                                                                                                                     | 2.900          | 3.270                    | 0,13                              |
| 2,600 % fällig am 01.06.2051                                      | 1.432          | 866                      | 0,03                              | Roche Holdings, Inc.<br>4,203 % fällig am 09.09.2029                                | \$ 500         | 501                      | 0,02                              | VMware LLC<br>4,700 % fällig am 15.05.2030                                                                                                       | \$ 3.000       | 3.013                    | 0,12                              |
| 2,900 % fällig am 01.03.2050                                      | 1.700          | 1.108                    | 0,04                              | Santander Holdings USA, Inc.<br>6,174 % fällig am 09.01.2030                        | 2.300          | 2.394                    | 0,09                              | Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,350 % fällig am 27.03.2030 (i)                                                                      | 500            | 509                      | 0,02                              |
| 4,500 % fällig am 01.06.2052                                      | 1.218          | 1.035                    | 0,04                              | SCE Recovery Funding LLC<br>4,697 % fällig am 15.06.2042                            | 1.802          | 1.755                    | 0,07                              | 5,650 % fällig am 25.03.2032                                                                                                                     | 2.000          | 2.034                    | 0,08                              |
| Northwestern University<br>4,940 % fällig am 01.12.2035           | 3.000          | 3.022                    | 0,12                              | ServiceNow, Inc.<br>1,400 % fällig am 01.09.2030                                    | 3.200          | 2.774                    | 0,11                              | Warnermedia Holdings, Inc.<br>4,279 % fällig am 15.03.2032                                                                                       | 3.400          | 2.865                    | 0,11                              |
| NSTAR Electric Co.<br>3,100 % fällig am 01.06.2051                | 1.675          | 1.095                    | 0,04                              | Solar Star Funding LLC<br>5,375 % fällig am 30.06.2035                              | 3.703          | 3.816                    | 0,15                              | 5,141 % fällig am 15.03.2052                                                                                                                     | 1.600          | 1.002                    | 0,04                              |
| 4,950 % fällig am 15.09.2052                                      | 3.600          | 3.199                    | 0,13                              | Southern California Edison Co.<br>2,500 % fällig am 01.06.2031                      | 200            | 174                      | 0,01                              | 5,391 % fällig am 15.03.2062                                                                                                                     | 500            | 347                      | 0,01                              |
| Nuveen LLC<br>4,000 % fällig am 01.11.2028                        | 300            | 298                      | 0,01                              | 2,750 % fällig am 01.02.2032                                                        | 1.700          | 1.466                    | 0,06                              | Westinghouse Air Brake Technologies Corp.<br>4,700 % fällig am 15.09.2028                                                                        | 2.500          | 2.515                    | 0,10                              |
| NVR, Inc.<br>3,000 % fällig am 15.05.2030                         | 700            | 652                      | 0,03                              | 3,600 % fällig am 01.02.2045                                                        | 3.400          | 2.343                    | 0,09                              | Weyerhaeuser Co.<br>4,000 % fällig am 15.11.2029                                                                                                 | 2.700          | 2.653                    | 0,10                              |
| Oglethorpe Power Corp.<br>5,900 % fällig am 15.05.2055            | 6.200          | 6.099                    | 0,24                              | 3,650 % fällig am 01.06.2051                                                        | 3.500          | 2.317                    | 0,09                              | 4,000 % fällig am 15.04.2030                                                                                                                     | 1.100          | 1.073                    | 0,04                              |
| Oncor Electric Delivery Co. LLC<br>3,500 % fällig am 15.05.2031   | € 4.500        | 5.376                    | 0,21                              | 3,900 % fällig am 01.12.2041                                                        | 100            | 76                       | 0,00                              | 6,875 % fällig am 15.12.2033                                                                                                                     | 70             | 77                       | 0,00                              |
| OneMain Finance Corp.<br>7,125 % fällig am 15.11.2031 (i)         | \$ 650         | 677                      | 0,03                              | 4,125 % fällig am 01.03.2048                                                        | 4.000          | 2.905                    | 0,11                              | Willis North America, Inc.<br>5,350 % fällig am 15.05.2033                                                                                       | 100            | 103                      | 0,00                              |
| Oracle Corp.<br>3,950 % fällig am 25.03.2051                      | 300            | 222                      | 0,01                              | 4,875 % fällig am 01.02.2027                                                        | 300            | 302                      | 0,01                              | Wisconsin Power & Light Co.<br>4,950 % fällig am 01.04.2033                                                                                      | 8.249          | 8.263                    | 0,32                              |
| 5,500 % fällig am 03.08.2035 (i)                                  | 7.000          | 7.158                    | 0,28                              | 4,875 % fällig am 01.03.2049                                                        | 200            | 160                      | 0,01                              | WP Carey, Inc.<br>2,450 % fällig am 01.02.2032                                                                                                   | 1.200          | 1.029                    | 0,04                              |
| Pacific Gas & Electric Co.<br>6,700 % fällig am 01.04.2053        | 7.700          | 7.730                    | 0,30                              | 5,200 % fällig am 01.06.2034                                                        | 1.100          | 1.068                    | 0,04                              | Xylem, Inc.<br>2,250 % fällig am 30.01.2031                                                                                                      | 4.080          | 3.618                    | 0,14                              |
| Pacific Life Global Funding<br>1,375 % fällig am 14.04.2026       | 605            | 592                      | 0,02                              | 5,450 % fällig am 01.06.2031                                                        | 400            | 407                      | 0,02                              | Yale University<br>4,701 % fällig am 15.04.2032                                                                                                  | 3.100          | 3.145                    | 0,12                              |
| 1,600 % fällig am 21.09.2028                                      | 1.000          | 921                      | 0,04                              | 5,950 % fällig am 01.11.2032                                                        | 3.750          | 3.852                    | 0,15                              | Zimmer Biomet Holdings, Inc.<br>1,164 % fällig am 15.11.2027                                                                                     | € 400          | 454                      | 0,02                              |
| 2,450 % fällig am 11.01.2032                                      | 2.000          | 1.725                    | 0,07                              | Southwestern Electric Power Co.<br>3,250 % fällig am 01.11.2051                     | 3.200          | 2.071                    | 0,08                              | 3,518 % fällig am 15.12.2032                                                                                                                     | 200            | 234                      | 0,01                              |
| Pacific LifeCorp<br>3,350 % fällig am 15.09.2050                  | 200            | 135                      | 0,01                              | Southwestern Public Service Co.<br>5,150 % fällig am 01.06.2052                     | 2.000          | 1.728                    | 0,07                              | Zoetis, Inc.<br>4,700 % fällig am 01.02.2043                                                                                                     | \$ 1.700       | 1.554                    | 0,06                              |
| PacifiCorp<br>5,350 % fällig am 01.12.2053                        | 1.200          | 1.080                    | 0,04                              | Starwood Property Trust, Inc.<br>7,250 % fällig am 01.04.2029                       | 1.000          | 1.053                    | 0,04                              |                                                                                                                                                  |                | 760.742                  | 29,89                             |
| Paychex, Inc.<br>5,350 % fällig am 15.04.2032                     | 400            | 411                      | 0,02                              | Stryker Corp.<br>1,950 % fällig am 15.06.2030                                       | 2.700          | 2.409                    | 0,09                              | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                                                                                                        |                |                          |                                   |
| Penn Mutual Life Insurance Co.<br>3,800 % fällig am 29.04.2061    | 1.800          | 1.174                    | 0,05                              | 3,375 % fällig am 11.09.2032                                                        | € 1.300        | 1.534                    | 0,06                              | Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>6,069 % fällig am 08.11.2030                                                                              | 1.200          | 1.205                    | 0,05                              |
| PG&E Recovery Funding LLC<br>4,838 % fällig am 01.06.2035         | 1.837          | 1.849                    | 0,07                              | 4,850 % fällig am 08.12.2028                                                        | \$ 1.500       | 1.530                    | 0,06                              | Life Time Fitness, Inc.<br>6,785 % fällig am 05.11.2031                                                                                          | 1.095          | 1.099                    | 0,04                              |
| 5,529 % fällig am 01.06.2051                                      | 2.200          | 2.170                    | 0,09                              | Synchrony Financial<br>4,500 % fällig am 23.07.2025                                 | 500            | 500                      | 0,02                              |                                                                                                                                                  |                | 2.304                    | 0,09                              |
| Piedmont Operating Partnership LP<br>9,250 % fällig am 20.07.2028 | 2.100          | 2.340                    | 0,09                              | Synopsys, Inc.<br>4,650 % fällig am 01.04.2028                                      | 200            | 202                      | 0,01                              | <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                                                                              |                |                          |                                   |
| Principal Life Global Funding<br>1,250 % fällig am 16.08.2026     | 2.750          | 2.660                    | 0,10                              | 4,850 % fällig am 01.04.2030                                                        | 500            | 507                      | 0,02                              | California Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2022<br>4,190 % fällig am 01.06.2037                                      | 2.100          | 1.968                    | 0,08                              |
| Prologis Euro Finance LLC<br>1,500 % fällig am 08.02.2034         | € 3.250        | 3.242                    | 0,13                              | 5,000 % fällig am 01.04.2032                                                        | 5.600          | 5.675                    | 0,22                              | California State General Obligation Bonds, Series 2025<br>5,100 % fällig am 01.09.2035                                                           | 1.900          | 1.931                    | 0,07                              |
| Prologis LP<br>2,250 % fällig am 15.01.2032                       | \$ 600         | 521                      | 0,02                              | Sysco Corp.<br>5,400 % fällig am 23.03.2035                                         | 4.700          | 4.784                    | 0,19                              | Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010<br>6,630 % fällig am 01.02.2035                                                     | 1.538          | 1.617                    | 0,06                              |
| 4,200 % fällig am 15.02.2033                                      | CAD 3.800      | 2.804                    | 0,11                              | T-Mobile USA, Inc.<br>2,550 % fällig am 15.02.2031                                  | 2.000          | 1.791                    | 0,07                              | University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022<br>3,504 % fällig am 01.04.2052                                                                | 1.300          | 959                      | 0,04                              |
| Protective Life Global Funding<br>1,737 % fällig am 21.09.2030    | \$ 800         | 700                      | 0,03                              | 3,300 % fällig am 15.02.2051                                                        | 900            | 598                      | 0,02                              | University of Pittsburgh of the Commonwealth System of Higher Education, Pennsylvania Revenue Bonds, Series 2017<br>3,646 % fällig am 15.09.2036 | 2.000          | 1.804                    | 0,07                              |
| Public Service Co. of Colorado<br>2,700 % fällig am 15.01.2051    | 2.025          | 1.209                    | 0,05                              | 3,600 % fällig am 15.11.2060                                                        | 300            | 200                      | 0,01                              |                                                                                                                                                  |                | 8.279                    | 0,32                              |
| 3,200 % fällig am 01.03.2050                                      | 2.827          | 1.884                    | 0,07                              | 4,700 % fällig am 15.01.2035                                                        | 500            | 485                      | 0,02                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                                                                                                     |                |                          |                                   |
| Public Service Co. of Oklahoma<br>2,200 % fällig am 15.08.2031    | 2.800          | 2.428                    | 0,10                              | Tapestry, Inc.<br>5,500 % fällig am 11.03.2035                                      | 2.000          | 2.009                    | 0,08                              | Freddie Mac<br>1,142 % fällig am 25.08.2029 (a)                                                                                                  | 2.283          | 73                       | 0,00                              |
| 3,150 % fällig am 15.08.2051                                      | 3.900          | 2.449                    | 0,10                              | Teachers Insurance & Annuity Association of America<br>4,270 % fällig am 15.05.2047 | 400            | 326                      | 0,01                              | Uniform Mortgage-Backed Security<br>3,000 % fällig am 01.07.2052                                                                                 | 5.799          | 5.031                    | 0,20                              |
| Public Service Electric & Gas Co.<br>3,100 % fällig am 15.03.2032 | 2.550          | 2.333                    | 0,09                              | Toll Brothers Finance Corp.<br>5,600 % fällig am 15.06.2035                         | 1.700          | 1.714                    | 0,07                              | 4,000 % fällig am 01.12.2052                                                                                                                     | 18.698         | 17.423                   | 0,68                              |
| 4,650 % fällig am 15.03.2033                                      | 3.200          | 3.182                    | 0,13                              | Topaz Solar Farms LLC<br>5,750 % fällig am 30.09.2039                               | 1.168          | 1.148                    | 0,05                              | - 01.07.2053                                                                                                                                     | 59.005         | 56.633                   | 2,23                              |
| PVH Corp.<br>4,125 % fällig am 16.07.2029                         | € 1.600        | 1.918                    | 0,08                              | Travelers Cos., Inc.<br>6,250 % fällig am 15.06.2037                                | 225            | 248                      | 0,01                              | 4,500 % fällig am 01.07.2052                                                                                                                     | 59.005         | 56.633                   | 2,23                              |
| Quanta Services, Inc.<br>2,900 % fällig am 01.10.2030             | \$ 3.300       | 3.044                    | 0,12                              | U.S. Bancorp<br>5,836 % fällig am 12.06.2034 (i)                                    | 600            | 630                      | 0,02                              | - 01.06.2054                                                                                                                                     | 86.614         | 85.141                   | 3,35                              |
| Rayonier LP<br>2,750 % fällig am 17.05.2031                       | 2.500          | 2.212                    | 0,09                              | Union Electric Co.<br>5,125 % fällig am 15.03.2055                                  | 2.600          | 2.407                    | 0,09                              | 5,000 % fällig am 01.02.2053                                                                                                                     |                | 164.301                  | 6,46                              |
| Realty Income Corp.<br>1,750 % fällig am 13.07.2033               | £ 2.000        | 2.112                    | 0,08                              | USAA Capital Corp.<br>2,125 % fällig am 01.05.2030                                  | 1.000          | 911                      | 0,04                              | - 01.05.2054                                                                                                                                     |                |                          |                                   |
| Reliance, Inc.<br>2,150 % fällig am 15.08.2030                    | \$ 1.000       | 887                      | 0,04                              | 4,375 % fällig am 01.06.2028                                                        | 2.700          | 2.719                    | 0,11                              | <b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>                                                                                                                     |                |                          |                                   |
| RELX Capital, Inc.<br>4,000 % fällig am 18.03.2029                | 700            | 695                      | 0,03                              | Veralto Corp.<br>5,500 % fällig am 18.09.2026                                       | 7.200          | 7.288                    | 0,29                              | U.S. Treasury Bonds<br>3,000 % fällig am 15.02.2048 (i)                                                                                          | 20.500         | 15.238                   | 0,60                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | Verisk Analytics, Inc.<br>5,250 % fällig am 15.03.2035                              | 1.250          | 1.258                    | 0,05                              | 3,000 % fällig am 15.08.2048 (i)                                                                                                                 | 13.800         | 10.210                   | 0,40                              |
|                                                                   |                |                          |                                   | Verizon Communications, Inc.<br>1,500 % fällig am 18.09.2030                        | 3.760          | 3.249                    | 0,13                              |                                                                                                                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 2,850 % fällig am 03.09.2041                                                        | 1.550          | 1.099                    | 0,04                              |                                                                                                                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 3,400 % fällig am 22.03.2041                                                        | 500            | 386                      | 0,02                              |                                                                                                                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 3,700 % fällig am 22.03.2061                                                        | 261            | 180                      | 0,01                              |                                                                                                                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,780 % fällig am 15.02.2035 (i)                                                    | 1.258          | 1.226                    | 0,05                              |                                                                                                                                                  |                |                          |                                   |
|                                                                   |                |                          |                                   | 4,862 % fällig am 21.08.2046                                                        | 2.000          | 1.787                    | 0,07                              |                                                                                                                                                  |                |                          |                                   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| 3,375 % fällig am 15.08.2042 (i)                 | \$ 9.700        | \$ 8.145                  | 0,32                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                   |                 |                           |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.05.2043 (i)                 | 9.200           | 8.220                     | 0,32                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                 |                           |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.11.2042 (i)                 | 20.200          | 18.435                    | 0,73                              | PIMCO Funds: Global                      |                 |                           |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.05.2044 (i)                 | 11.000          | 10.791                    | 0,42                              | Investors Series plc -                   |                 |                           |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.02.2055 (i)                 | 8.900           | 8.666                     | 0,34                              | PIMCO Climate Bond                       |                 |                           |                                   |
|                                                  |                 |                           |                                   | Fund (f)                                 | 3.234.468       | \$ 34.593                 | 1,36                              |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d) |                 |                           |                                   |                                          |                 |                           |                                   |
| 0,125 % fällig am 15.02.2051 (i)                 | 3.450           | 1.881                     | 0,08                              |                                          |                 |                           |                                   |
| 0,625 % fällig am 15.07.2032 (i)                 | 1.435           | 1.339                     | 0,05                              |                                          |                 |                           |                                   |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033 (i)                 | 9.928           | 9.646                     | 0,38                              | Summe Investmentfonds                    |                 | \$ 34.593                 | 1,36                              |
| U.S. Treasury STRIPS                             |                 |                           |                                   |                                          |                 |                           |                                   |
| 0,000 % fällig am 15.05.2046 (c)(i)              | 2.200           | 790                       | 0,03                              |                                          |                 |                           |                                   |
|                                                  |                 | 93.361                    | 3,67                              |                                          |                 |                           |                                   |
| Summe USA                                        |                 | 1.042.452                 | 40,96                             |                                          |                 |                           |                                   |
| Summe Übertragbare Wertpapiere                   |                 | \$ 2.536.048              | 99,65                             |                                          |                 |                           |                                   |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                     | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|-----------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS                     | 4,470 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 19.700     | U.S. Treasury Notes 4,250 %<br>fällig am 30.06.2029 | \$ (20.124)                | \$ 19.700                      | \$ 19.702                                                      | 0,78                    |
| JPS                     | 4,550      | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 13.300        | U.S. Treasury Notes 0,750 %<br>fällig am 31.08.2026 | (13.584)                   | 13.300                         | 13.302                                                         | 0,52                    |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                     | \$ (33.708)                | \$ 33.000                      | \$ 33.004                                                      | 1,30                    |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2027     | 858                     | \$ 1.386                                        | 0,05                    |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures  | Long  | 09.2025     | 439                     | 278                                             | 0,01                    |
| Canada Government 2-Year Bond September Futures      | Long  | 09.2025     | 804                     | 102                                             | 0,00                    |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures     | Long  | 09.2025     | 22                      | (5)                                             | 0,00                    |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025     | 517                     | 124                                             | 0,01                    |
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025     | 25                      | 3                                               | 0,00                    |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures             | Short | 09.2025     | 150                     | 396                                             | 0,02                    |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 1.425                   | 1.125                                           | 0,04                    |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 1.877                   | 1.993                                           | 0,08                    |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Short | 09.2025     | 562                     | (1.013)                                         | (0,04)                  |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025     | 445                     | (840)                                           | (0,03)                  |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Long  | 09.2025     | 1.094                   | 3.747                                           | 0,15                    |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 304                     | 1.287                                           | 0,05                    |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Short | 09.2025     | 254                     | (463)                                           | (0,02)                  |
|                                                      |       |             |                         | \$ 8.120                                        | 0,32                    |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|----------|-----------|-------------------------|
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250     | 25.07.2025    | 13                      | \$ (3)   | \$ (3)    | 0,00                    |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500       | 25.07.2025    | 13                      | (2)      | (2)       | 0,00                    |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | 129,000       | 25.07.2025    | 9                       | (4)      | (3)       | 0,00                    |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500       | 25.07.2025    | 9                       | (5)      | (1)       | 0,00                    |
|                                                                |               |               |                         | \$ (14)  | \$ (9)    | 0,00                    |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                         | \$ 8.111 |           | 0,32                    |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Referenzeinheit                    | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Ally Financial, Inc.               | 5,000 %                        | 20.12.2027       | \$ 1.100                  | \$ (12)                                         | 0,00                    |
| American International Group, Inc. | 1,000                          | 20.12.2026       | 900                       | (4)                                             | 0,00                    |
| American International Group, Inc. | 1,000                          | 20.12.2027       | 1.000                     | (1)                                             | 0,00                    |
| AT&T, Inc.                         | 1,000                          | 20.06.2026       | 2.500                     | (5)                                             | 0,00                    |
| AT&T, Inc.                         | 1,000                          | 20.06.2028       | 700                       | 4                                               | 0,00                    |
| Bank of America Corp.              | 1,000                          | 20.12.2025       | 1.200                     | (3)                                             | 0,00                    |
| British Telecommunications PLC     | 1,000                          | 20.12.2025       | € 100                     | (1)                                             | 0,00                    |
| British Telecommunications PLC     | 1,000                          | 20.12.2027       | 300                       | 2                                               | 0,00                    |
| Ford Motor Co.                     | 5,000                          | 20.12.2028       | \$ 5.400                  | (85)                                            | 0,00                    |
| Ford Motor Credit Co. LLC          | 5,000                          | 20.06.2027       | 600                       | (21)                                            | 0,00                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.          | 1,000                          | 20.06.2026       | 4.000                     | 2                                               | 0,00                    |
| Goldman Sachs Group, Inc.          | 1,000                          | 20.12.2026       | 3.000                     | (11)                                            | 0,00                    |
| MetLife, Inc.                      | 1,000                          | 20.06.2028       | 1.700                     | 10                                              | 0,00                    |
| Morgan Stanley                     | 1,000                          | 20.12.2025       | 2.900                     | 1                                               | 0,00                    |
| Morgan Stanley                     | 1,000                          | 20.06.2026       | 5.200                     | 4                                               | 0,00                    |
| Telefonica Emisiones S.A.          | 1,000                          | 20.06.2028       | € 1.000                   | 5                                               | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                          | 20.06.2026       | \$ 700                    | (1)                                             | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                          | 20.12.2026       | 2.200                     | (1)                                             | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                          | 20.12.2027       | 700                       | 3                                               | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                          | 20.06.2028       | 6.700                     | 44                                              | 0,00                    |
| Verizon Communications, Inc.       | 1,000                          | 20.12.2028       | 1.700                     | 14                                              | 0,00                    |
|                                    |                                |                  |                           | \$ (56)                                         | 0,00                    |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 33.700                 | \$ 87                                           | 0,00                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt     | variabler<br>Zinssatz               | variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 1,785 %         | 12.08.2051       | \$ 800     | \$ 40                                           | 0,00                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,000           | 19.03.2030       | 60.000     | (838)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,250           | 18.06.2030       | 31.600     | (196)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,300           | 15.11.2053       | 3.700      | 427                                             | 0,01                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,363           | 15.11.2049       | 4.700      | 481                                             | 0,02                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,368           | 15.11.2049       | 2.000      | 203                                             | 0,01                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,370           | 15.11.2049       | 3.100      | 314                                             | 0,01                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,375           | 15.11.2049       | 1.900      | 191                                             | 0,01                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,395           | 15.11.2049       | 4.400      | 427                                             | 0,02                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,461           | 15.11.2049       | 5.000      | 432                                             | 0,02                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,500           | 20.06.2054       | 25.000     | 1.151                                           | 0,04                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,667           | 31.05.2028       | 9.700      | (66)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,842           | 04.03.2030       | 3.300      | (49)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                 | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       |                         | 3,930           | 24.03.2035       | 1.200      | (20)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI                      |                         | 13,291          | 02.01.2029       | BRL 18.000 | 28                                              | 0,00                    |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI                      |                         | 13,320          | 02.01.2029       | 1.900      | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI                      |                         | 13,926          | 04.01.2027       | 12.000     | (6)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI                      |                         | 13,927          | 04.01.2027       | 98.000     | (51)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                 | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS |                         | 3,000           | 01.06.2034       | CAD 3.400  | (27)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR                 |                         | 0,600           | 15.12.2050       | € 2.300    | 158                                             | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup> | 6-Month EUR-EURIBOR                 |                         | 2,000           | 17.09.2027       | 11.000     | 79                                              | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup> | 6-Month EUR-EURIBOR                 |                         | 2,250           | 17.09.2030       | 83.390     | 882                                             | 0,03                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>  | 6-Month EUR-EURIBOR                 |                         | 2,250           | 17.09.2035       | 2.200      | (25)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>  | 6-Month EUR-EURIBOR                 |                         | 2,250           | 17.09.2055       | 39.400     | 1.508                                           | 0,06                    |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR                 |                         | 2,450           | 05.05.2035       | 1.200      | 21                                              | 0,00                    |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR                 |                         | 2,550           | 16.04.2035       | 400        | 3                                               | 0,00                    |
| Erhalt                 | CPURNSA                             |                         | 2,475           | 16.06.2031       | \$ 2.600   | 44                                              | 0,00                    |
|                        |                                     |                         |                 |                  |            | \$ 5.114                                        | 0,20                    |
|                        |                                     |                         |                 |                  |            | \$ 5.145                                        | 0,20                    |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %       | 16.07.2025    | 4.000                     | \$ (5)  | \$ 0      | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 7.800                     | (9)     | (1)       | 0,00                    |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000         | 16.07.2025    | 3.700                     | (4)     | 0         | 0,00                    |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850         | 16.07.2025    | 4.100                     | (5)     | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900         | 16.07.2025    | 3.600                     | (4)     | 0         | 0,00                    |
|            |                                  |                         |               |               |                           | \$ (27) | \$ (2)    | 0,00                    |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,555 %       | 24.07.2025    | 1.800                     | \$ (6)   | \$ (7)    | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,637         | 18.07.2025    | 1.900                     | (6)      | (10)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,700         | 21.07.2025    | 1.800                     | (6)      | (14)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770         | 09.07.2025    | 2.000                     | (6)      | (18)      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,905         | 24.07.2025    | 1.800                     | (6)      | (3)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,037         | 18.07.2025    | 1.900                     | (6)      | (1)       | 0,00                    |
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050         | 21.07.2025    | 1.800                     | (6)      | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120         | 09.07.2025    | 2.000                     | (6)      | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564         | 24.07.2025    | 1.800                     | (6)      | (7)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605         | 23.07.2025    | 1.900                     | (7)      | (9)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914         | 24.07.2025    | 1.800                     | (6)      | (3)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955         | 23.07.2025    | 1.900                     | (6)      | (2)       | 0,00                    |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380         | 03.07.2025    | 800                       | (2)      | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460         | 16.07.2025    | 1.100                     | (3)      | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640         | 03.07.2025    | 800                       | (2)      | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720         | 16.07.2025    | 1.100                     | (3)      | (2)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,750         | 03.07.2025    | 2.500                     | (9)      | (17)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,790         | 09.07.2025    | 2.400                     | (8)      | (25)      | (0,01)                  |
| GLM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,100         | 03.07.2025    | 2.500                     | (9)      | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,140         | 09.07.2025    | 2.400                     | (8)      | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525         | 28.07.2025    | 1.700                     | (6)      | (6)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583         | 23.07.2025    | 900                       | (3)      | (4)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653         | 14.07.2025    | 2.400                     | (7)      | (11)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680         | 07.07.2025    | 1.000                     | (4)      | (4)       | 0,00                    |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695         | 17.07.2025    | 1.900                     | (6)      | (13)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775         | 07.07.2025    | 2.100                     | (6)      | (19)      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875         | 28.07.2025    | 1.700                     | (6)      | (4)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933         | 23.07.2025    | 900                       | (3)      | (1)       | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030         | 07.07.2025    | 1.000                     | (4)      | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053         | 14.07.2025    | 2.400                     | (7)      | 0         | 0,00                    |
| MYC        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095         | 17.07.2025    | 1.900                     | (6)      | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125         | 07.07.2025    | 2.100                     | (6)      | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772         | 10.07.2025    | 2.000                     | (7)      | (19)      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122         | 10.07.2025    | 2.000                     | (7)      | 0         | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664         | 14.07.2025    | 2.700                     | (8)      | (13)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669         | 07.07.2025    | 1.900                     | (7)      | (6)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697         | 16.07.2025    | 1.800                     | (5)      | (12)      | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715         | 02.07.2025    | 2.200                     | (8)      | (9)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725         | 03.07.2025    | 1.900                     | (7)      | (10)      | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019         | 07.07.2025    | 1.900                     | (7)      | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064         | 14.07.2025    | 2.700                     | (8)      | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065         | 02.07.2025    | 2.200                     | (8)      | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075         | 03.07.2025    | 1.900                     | (7)      | 0         | 0,00                    |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097         | 16.07.2025    | 1.800                     | (5)      | 0         | 0,00                    |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | \$ (265) | \$ (252)  | (0,01)                  |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| BOA        | Italy Government International Bond | 1,000 %                        | 20.12.2026       | \$ 2.300                  | \$ 11                                     | \$ 18                                              | \$ 29     | 0,00                    |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD                 | \$                    | 10                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | AUD                   | 59.844                        | 345                             | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | €                     | 20.382                        | 61                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | £                     | 1.804                         | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | NZD                   | 331                           | 2                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | \$                    | 38.897                        | 0                               | (346)                                         | (0,01)               |
|            | 08.2025          | €                   |                       | 23.917                        | 0                               | (60)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £                   |                       | 2.476                         | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NZD                 |                       | 199                           | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  |                       | 10                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | IDR                 | \$                    | 1.528                         | 0                               | (7)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PEN                 |                       | 688                           | 0                               | (16)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | £                     | 747                           | 10                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | KRW                   | 1.191.870                     | 7                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | SGD                   | 213                           | 1                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | \$                    | 166                           | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   |                       | 5                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | IDR                 |                       | 4.659.184                     | 286                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 |                       | 54.948                        | 40                              | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 |                       | 3.812                         | 116                             | (1)                                           | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | \$                  | BRL                   | 1.198                         | 7                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | IDR                   | 10.188.144                    | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | THB                   | 16.545                        | 9                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | TWD                   | 4.193                         | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | \$                    | 2.056                         | 0                               | (282)                                         | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | INR                   | 48.021                        | 6                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   |                       | 750.992                       | 0                               | (28.697)                                      | (1,13)               |
|            | 07.2025          | KRW                 |                       | 44.503                        | 32                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 |                       | 409                           | 40                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | €                     | 6.691                         | 5.844                           | 168                                           | 0,01                 |
| BRC        | 07.2025          |                     | £                     | 141.094                       | 1.375                           | 0                                             | 0,05                 |
|            | 07.2025          |                     | ¥                     | 2.467                         | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | PLN                   | 288                           | 3                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £                   | \$                    | 191.999                       | 0                               | (1.377)                                       | (0,05)               |
|            | 08.2025          | TWD                 |                       | 14.604                        | 498                             | (10)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 |                       | 28                            | 20                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   |                       | 12.712                        | 14.561                          | (361)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | KRW                 |                       | 4.802.383                     | 3.497                           | (54)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 |                       | 705                           | 549                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 |                       | 10.925                        | 329                             | (8)                                           | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | \$                  | AUD                   | 1.557                         | 10                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | BRL                   | 99.990                        | 1.095                           | 0                                             | 0,04                 |
|            | 07.2025          |                     | €                     | 14.366                        | 12.520                          | 0                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | IDR                   | 20.923.303                    | 4                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | SEK                   | 56.307                        | 0                               | (33)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | THB                   | 6.677                         | 6                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | TWD                   | 197.474                       | 158                             | 0                                             | 0,01                 |
|            | 08.2025          | SEK                 | \$                    | 56.186                        | 5.941                           | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 |                       | 168.582                       | 5.163                           | (696)                                         | (0,03)               |
|            | 08.2025          | \$                  | INR                   | 4.309                         | 371.346                         | (3)                                           | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | DKK                 | \$                    | 342                           | 0                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 |                       | 68.181                        | 50                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 |                       | 19                            | 15                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | IDR                   | 452.698                       | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | TWD                   | 5.345                         | 4                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | DKK                   | 2.173                         | 1                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | INR                   | 165.461                       | 8                               | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 09.2025          |                     | MXN                   | 7.745                         | 4                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | \$                    | 61.401                        | 39.616                          | (623)                                         | (0,02)               |
|            | 07.2025          | BRL                 |                       | 101.229                       | 17.804                          | (744)                                         | (0,03)               |
| FAR        | 07.2025          | CHF                 |                       | 5.481                         | 6.656                           | (230)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | DKK                 |                       | 2.961                         | 465                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   |                       | 777.276                       | 5.340                           | (41)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 |                       | 56.272                        | 5.875                           | (29)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 |                       | 48                            | 37                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | CHF                   | 6.838                         | 5.474                           | 39                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | ¥                     | 9.487                         | 1.361.037                       | (65)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | PEN                   | 700                           | 2.500                           | 5                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | SGD                   | 134                           | 170                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CHF                 | \$                    | 5.451                         | 6.838                           | (39)                                          | 0,00                 |
| GLM        | 08.2025          | SGD                 |                       | 170                           | 134                             | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | DKK                   | 465                           | 2.954                           | 1                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | INR                   | 916                           | 79.246                          | 5                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | ¥                     | 5.340                         | 774.418                         | 41                                            | 0,00                 |
|            | 09.2025          | MXN                 | \$                    | 675                           | 35                              | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 09.2025          | \$                  | BRL                   | 2.915                         | 16.347                          | 35                                            | 0,00                 |
|            | 12.2025          | PEN                 | \$                    | 2.513                         | 700                             | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | IDR                   | 369                           | 6.017.033                       | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | SGD                   | 52                            | 66                              | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | ZAR                   | 965                           | 17.449                          | 16                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | \$                    | 66                            | 52                              | 0                                             | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| JPM        | 08.2025          | THB                    | 1.302                    | \$ 40                            | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 179.972                  | 132                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 331                      | 197                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 1.262                    | 982                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 778                      | DKK 5.138                        | 30                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 40                       | KRW 55.209                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 824                      | PLN 3.096                        | 32                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 109                      | SGD 139                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 241                      | TWD 7.162                        | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 276                      | ZAR 4.939                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 08.2025          | SGD                    | 139                      | \$ 109                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 104.894                  | 3.204                            | 0                                  | (442)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 618                      | INR 53.558                       | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 62.986                   | \$ 45.859                        | 0                                  | (301)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | £                      | 4.784                    | 6.509                            | 7                                  | (54)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 3.031                    | 2.363                            | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 8.402                    | 256                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 45.858                   | CAD 63.036                       | 340                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 10.398                   | € 8.962                          | 122                                | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 272                      | IDR 4.422.628                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          |                        | 416                      | ¥ 59.702                         | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 591                      | PLN 2.214                        | 21                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.869                    | SGD 3.711                        | 44                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 300                      | THB 10.005                       | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2                        | TWD 67                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 62.931                   | \$ 45.858                        | 0                                  | (341)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | SGD                    | 3.702                    | 2.869                            | 0                                  | (45)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 83.084                   | 2.539                            | 0                                  | (349)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF                    | 248                      | 310                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 96                       | 131                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          | ¥                      | 247.632                  | 1.698                            | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 11.139                   | 1.174                            | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 2.930                    | 90                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 315                      | € 269                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.575                    | £ 1.148                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 213                      | ¥ 30.745                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 384                      | NOK 3.874                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK                    | 3.873                    | \$ 384                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.698                    | ¥ 246.721                        | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 307                      | \$ 2                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | \$                     | 1.490                    | IDR 24.280.095                   | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 573                      | SGD 739                          | 7                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.919                    | TWD 174.207                      | 79                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 737                      | \$ 573                           | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 49.696                   | 1.523                            | 0                                  | (204)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 647                      | INR 55.517                       | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2                        | ¥ 306                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 14                       | \$ 16                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 35.923                   | 249                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 40                       | NOK 403                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 08.2025          | NOK                    | 403                      | \$ 40                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 4                        | INR 320                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 249                      | ¥ 35.791                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 138.887                  | \$ 188.055                       | 0                                  | (2.269)                                              | (0,09)                  |
|            | 07.2025          | IDR                    | 1.192.656                | 74                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 72.127                   | 53                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK                    | 3.868                    | 381                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 893                      | 27                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 74                       | IDR 1.192.967                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 139                      | ¥ 20.061                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          |                        | 13                       | KRW 17.477                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 6.832                    | \$ 7.718                         | 0                                  | (301)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 412.765                  | 2.866                            | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 847.625                  | € 722.828                        | 868                                | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 08.2025          | €                      | 722.828                  | \$ 849.475                       | 0                                  | (869)                                                | (0,03)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.866                    | ¥ 411.246                        | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 5.420                         | \$ (38.992)                        | \$ (33.572)                                          | (1,32)                  |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                    | 61.116                   | \$ 76.520                        | \$ 0                               | \$ (259)                                             | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 76.520                   | CHF 60.863                       | 260                                | 260                                                  | 0,01                    |
| BOA        | 07.2025          | CHF                    | 35                       | \$ 43                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        | 190                      | 230                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| CBK        | 07.2025          | CHF 396                | \$ 486                   | \$ 0                             | \$ (11)                            | \$ (11)                                              | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | 61.353                 | 76.636                   | 0                                | (440)                              | (440)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 70.547              | CHF 58.093               | 2.435                            | 0                                  | 2.435                                                | 0,10                    |
|            | 08.2025          | 76.636                 | 61.100                   | 442                              | 0                                  | 442                                                  | 0,02                    |
| MBC        | 07.2025          | CHF 515                | \$ 634                   | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 70.160              | CHF 57.656               | 2.272                            | 0                                  | 2.272                                                | 0,09                    |
| MYI        | 07.2025          | CHF 62                 | \$ 77                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 11.496              | CHF 9.400                | 313                              | 0                                  | 313                                                  | 0,01                    |
| RBC        | 07.2025          | 67.593                 | 55.435                   | 2.049                            | 0                                  | 2.049                                                | 0,08                    |
| SCX        | 07.2025          | CHF 24                 | \$ 29                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 7.771                         | \$ (735)                           | \$ 7.036                                             | 0,28                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 329.563              | \$ 385.879               | \$ 0                             | \$ (980)                           | \$ (980)                                             | (0,04)                  |
|            | 08.2025          | \$ 386.725             | € 329.563                | 977                              | 0                                  | 977                                                  | 0,04                    |
| BOA        | 07.2025          | 399.591                | 351.428                  | 12.933                           | 0                                  | 12.933                                               | 0,51                    |
| BPS        | 07.2025          | € 8                    | \$ 10                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 771                 | € 667                    | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | € 8.089                | \$ 9.257                 | 0                                | (238)                              | (238)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 401.172             | € 353.256                | 13.499                           | 0                                  | 13.499                                               | 0,53                    |
| CBK        | 07.2025          | € 5.549                | \$ 6.491                 | 0                                | (23)                               | (23)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.645               | € 3.150                  | 52                               | 0                                  | 52                                                   | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | € 359.091              | \$ 416.581               | 0                                | (4.938)                            | (4.938)                                              | (0,20)                  |
|            | 08.2025          | \$ 416.581             | € 358.304                | 4.931                            | 0                                  | 4.931                                                | 0,19                    |
| MBC        | 07.2025          | € 201                  | \$ 231                   | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 5.784               | € 5.042                  | 134                              | 0                                  | 134                                                  | 0,01                    |
| WST        | 07.2025          | € 356.094              | \$ 417.573               | 0                                | (427)                              | (427)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 383.894             | € 339.813                | 14.996                           | 0                                  | 14.996                                               | 0,59                    |
|            | 08.2025          | 418.485                | 356.094                  | 427                              | 0                                  | 427                                                  | 0,02                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 47.960                        | \$ (6.611)                         | \$ 41.349                                            | 1,62                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 53.233               | \$ 73.047                | \$ 98                            | \$ 0                               | \$ 98                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 73.057              | £ 53.233                 | 0                                | (98)                               | (98)                                                 | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | £ 276                  | \$ 375                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | 58.208                 | 79.194                   | 0                                | (571)                              | (571)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$ 73.828              | £ 54.679                 | 1.102                            | 0                                  | 1.102                                                | 0,04                    |
|            | 08.2025          | 78.585                 | 57.749                   | 563                              | 0                                  | 563                                                  | 0,02                    |
| CBK        | 07.2025          | £ 26                   | \$ 35                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 44                  | £ 33                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | £ 42                   | \$ 57                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 77.317              | £ 57.392                 | 1.330                            | 0                                  | 1.330                                                | 0,05                    |
| MBC        | 07.2025          | £ 1.027                | \$ 1.392                 | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 992                 | £ 732                    | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | £ 57.207               | \$ 78.442                | 48                               | 0                                  | 48                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 77.426              | £ 57.183                 | 934                              | 0                                  | 934                                                  | 0,04                    |
|            | 08.2025          | 78.452                 | 57.207                   | 0                                | (47)                               | (47)                                                 | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 4.087                         | \$ (736)                           | \$ 3.351                                             | 0,13                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | \$ 598                 | SEK 5.738                | \$ 4                             | \$ 0                               | \$ 4                                                 | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | 2.579                  | 24.790                   | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | SEK 833.997            | \$ 88.035                | 525                              | 0                                  | 525                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025          | \$ 99.302              | SEK 956.567              | 1.068                            | 0                                  | 1.068                                                | 0,04                    |
| CBK        | 07.2025          | SEK 1.967.527          | \$ 207.586               | 1.139                            | (1)                                | 1.138                                                | 0,05                    |
|            | 07.2025          | \$ 53.501              | SEK 508.005              | 7                                | (204)                              | (197)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | 206.703                | 1.954.884                | 0                                | (1.144)                            | (1.144)                                              | (0,04)                  |
| FAR        | 07.2025          | 260.961                | 2.499.533                | 1.308                            | 0                                  | 1.308                                                | 0,05                    |
| GLM        | 07.2025          | 49.822                 | 479.200                  | 459                              | 0                                  | 459                                                  | 0,02                    |
| MBC        | 07.2025          | SEK 3.654              | \$ 385                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 417                 | SEK 3.989                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | SEK 884.069            | \$ 93.553                | 790                              | 0                                  | 790                                                  | 0,03                    |
|            | 07.2025          | \$ 43.816              | SEK 421.083              | 367                              | 0                                  | 367                                                  | 0,02                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| RYL                              | 07.2025          | \$ 2.404               | SEK 22.965               | \$ 13                            | \$ (7)                             | \$ 6                                                 | 0,00                    |
| SCX                              | 07.2025          | 640                    | 6.108                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025          | 260.961                | 2.507.518                | 2.146                            | 0                                  | 2.146                                                | 0,08                    |
|                                  |                  |                        |                          | \$ 7.852                         | \$ (1.356)                         | \$ 6.496                                             | 0,26                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 24.435                                            | 0,96                    |
| Summe Anlagen                    |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 2.641.332                                         | 103,79                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ (96.418)                                          | (3,79)                  |
| Nettovermögen                    |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 2.544.914                                         | 100,00                  |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.  
(b) Wertpapier per Emissionstermin.  
(c) Nullkuponwertpapier.  
(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.  
(e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.  
(f) Mit dem Fonds verbunden.  
(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.  
(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,05 %):

| Emittentenbeschreibung | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum  | Kosten   | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|---------|------------------|------------|----------|-----------|-------------------------|
| AT&T, Inc.             | 4,850 % | 25.05.2047       | 23.09.2021 | \$ 1.317 | \$ 1.054  | 0,04                    |

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 116.044 USD (31. Dezember 2024: 9.203 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 530 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 70.726 USD) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 78 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 610 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 38.215 USD (31. Dezember 2024: 32.985 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 13.110 USD (31. Dezember 2024: 17.597 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 2.516.551                                                    | \$ 19.497                                                    | \$ 2.536.048 |
| Investmentfonds               | 34.593                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 34.593       |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 33.000                                                          | 0                                                            | 33.000       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 426                                                                         | 37.265                                                          | 0                                                            | 37.691       |
| Summen                        | \$ 35.019                                                                   | \$ 2.586.816                                                    | \$ 19.497                                                    | \$ 2.641.332 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 2.113.825                                                    | \$ 7.399                                                     | \$ 2.121.224 |
| Investmentfonds               | 33.012                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 33.012       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 2.369                                                                       | (18.261)                                                        | 0                                                            | (15.892)     |
| Summen                        | \$ 35.381                                                                   | \$ 2.095.564                                                    | \$ 7.399                                                     | \$ 2.138.344 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus |                      |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|-----------------------|----------------------|
|                                    |            |                  |                    |              | Pensionsgeschäften    | % des Nettovermögens |
| BOS                                | 3,900 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (1.346)   | \$ (1.347)            | (0,05)               |
|                                    | 4,250      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (8.543)      | (8.551)               | (0,34)               |
|                                    | 4,270      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (2.721)      | (2.723)               | (0,11)               |
|                                    | 4,280      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (644)        | (645)                 | (0,02)               |
|                                    | 4,290      | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (3.970)      | (3.974)               | (0,16)               |
| BRC                                | 4,300      | 18.06.2025       | 01.08.2025         | (484)        | (484)                 | (0,02)               |
|                                    | 4,500      | 26.06.2025       | 03.07.2025         | (5.103)      | (5.106)               | (0,20)               |
|                                    | (0,250)    | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (1.765)    | (2.072)               | (0,08)               |
|                                    | 1,650      | 17.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (203)        | (239)                 | (0,01)               |
|                                    | 1,700      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | (163)        | (192)                 | (0,01)               |
| JPS                                | 3,800      | 23.05.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | £ (934)      | (1.285)               | (0,05)               |
|                                    | 4,420      | 04.06.2025       | 02.07.2025         | \$ (2.199)   | (2.207)               | (0,09)               |
|                                    | 4,440      | 18.06.2025       | 16.07.2025         | (83.401)     | (83.534)              | (3,28)               |
|                                    | 4,460      | 23.06.2025       | 14.07.2025         | (767)        | (768)                 | (0,03)               |
|                                    | 4,500      | 27.06.2025       | 03.07.2025         | (1.379)      | (1.380)               | (0,05)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (114.507)          | (4,50)               |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                |                                    |                                 |
|------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (2)                           | \$ 0                               | \$ (2)                          | \$ (1)                           | \$ 0                               | \$ (1)                          |
| BOA        | 12.901                           | (12.300)                           | 601                             | 59                               | 0                                  | 59                              |
| BPS        | (224)                            | 260                                | 36                              | (2.055)                          | 1.990                              | (65)                            |
| BRC        | (12.599)                         | 11.230                             | (1.369)                         | (7.904)                          | 5.777                              | (2.127)                         |
| CBK        | 282                              | (350)                              | (68)                            | (263)                            | 260                                | (3)                             |
| DUB        | 8                                | 0                                  | 8                               | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| FAR        | 2.051                            | (3.220)                            | (1.169)                         | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| GLM        | 414                              | (480)                              | (66)                            | (147)                            | 0                                  | (147)                           |
| GST        | (1)                              | 0                                  | (1)                             | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| JPM        | 928                              | (1.120)                            | (192)                           | (69)                             | 10                                 | (59)                            |
| MBC        | 1.817                            | (1.350)                            | 467                             | (10.619)                         | 9.470                              | (1.149)                         |
| MYC        | (50)                             | 0                                  | (50)                            | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| MYI        | 1.473                            | (1.300)                            | 173                             | 2                                | 0                                  | 2                               |
| RBC        | 2.048                            | (1.690)                            | 358                             | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| RYL        | 6                                | 0                                  | 6                               | (43)                             | 0                                  | (43)                            |
| SCX        | (121)                            | 70                                 | (51)                            | 2.428                            | (1.320)                            | 1.108                           |
| SSB        | (1.334)                          | 1.550                              | 216                             | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |
| UAG        | 2.144                            | (15.290)                           | (13.146)                        | (3)                              | 90                                 | 87                              |
| WST        | 14.694                           | 0                                  | 14.694                          | k. A.                            | k. A.                              | k. A.                           |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 70,66             | 75,00             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 19,91             | 18,05             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,14              | 0,08              |
| Investmentfonds                                                        | 1,24              | 1,45              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 1,18              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,37              | 0,17              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,23              | 0,26              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,62              | 0,67              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 3,65              | 4,32              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\*Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------|-------------------|-------------------|
| Australien            | 1,88              | 0,91              |
| Österreich            | 0,22              | 0,34              |
| Belgien               | 0,88              | 1,43              |
| Brasilien             | 0,18              | 0,08              |
| Kanada                | 2,89              | 2,06              |
| Kaimaninseln          | 0,01              | 0,02              |
| Chile                 | 0,29              | 0,50              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kolumbien                                                                              | 0,26              | 0,21              |
| Tschechische Republik                                                                  | 0,30              | 0,09              |
| Dänemark                                                                               | 1,14              | 0,96              |
| Finnland                                                                               | 0,39              | 0,46              |
| Frankreich                                                                             | 5,95              | 7,74              |
| Deutschland                                                                            | 4,87              | 3,58              |
| Guernsey, Kanalinseln                                                                  | 0,26              | 0,20              |
| Hongkong                                                                               | 0,17              | 0,35              |
| Ungarn                                                                                 | 0,28              | k. A.             |
| Indien                                                                                 | 0,24              | 0,28              |
| Indonesien                                                                             | 0,03              | 0,04              |
| International                                                                          | 0,00              | k. A.             |
| Irland                                                                                 | 0,94              | 1,24              |
| Italien                                                                                | 1,57              | 1,31              |
| Japan                                                                                  | 2,99              | 3,23              |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 0,17              | k. A.             |
| Luxemburg                                                                              | 1,56              | 1,48              |
| Mauritius                                                                              | 0,20              | 0,10              |
| Mexiko                                                                                 | 0,58              | 0,73              |
| Multinational                                                                          | 0,01              | k. A.             |
| Niederlande                                                                            | 9,88              | 8,87              |
| Neuseeland                                                                             | 0,08              | 0,08              |
| Norwegen                                                                               | 0,46              | 0,35              |
| Peru                                                                                   | 0,33              | 0,08              |
| Polen                                                                                  | 0,09              | k. A.             |
| Rumänien                                                                               | 0,31              | 0,27              |
| Serbien                                                                                | 0,01              | 0,11              |
| Singapur                                                                               | 0,78              | 0,59              |
| Slowenien                                                                              | 0,22              | k. A.             |
| Südafrika                                                                              | 0,11              | 0,13              |
| Südkorea                                                                               | 0,78              | 1,67              |
| Spanien                                                                                | 2,12              | 1,73              |
| Supranational                                                                          | 1,66              | 2,53              |
| Schweden                                                                               | 0,66              | 0,49              |
| Schweiz                                                                                | 0,91              | 1,45              |
| Thailand                                                                               | 0,08              | k. A.             |
| Vereinigte Arabische Emirate                                                           | 0,15              | 0,18              |
| Großbritannien                                                                         | 11,80             | 11,03             |
| USA                                                                                    | 40,96             | 43,36             |
| Investmentfonds                                                                        | 1,36              | 1,56              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 1,30              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,32              | (0,09)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,01              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,20              | 0,21              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes                                             | 0,00              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (1,32)            | 0,71              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 2,29              | (1,58)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (3,79)            | (1,07)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

Halbjahresbericht | 30. Juni 2025 609

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|

| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,017 % fällig am 20.11.2063                                                  | £ 2.127        | 2.915                    | 0,18                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                            |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 15.07.2028 (d)           | \$ 73.093      | \$ 72.216                | 4,34                              |
| 5,398 % fällig am 20.01.2066                                                  | 1.818          | 2.497                    | 0,15                              | Ginnie Mae                                              |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 15.02.2042               | 568            | 441                      | 0,03                              |
| 5,798 % fällig am 20.10.2064                                                  | 846            | 1.160                    | 0,07                              | 3,500 % fällig am 20.06.2052                            | \$ 31.289      | 28.563                   | 1,72                              | 0,750 % fällig am 15.02.2045               | 681            | 498                      | 0,03                              |
| <b>Twin Bridges PLC</b>                                                       |                |                          |                                   | 5,102 % fällig am 20.08.2072 -                          |                |                          |                                   | 0,875 % fällig am 15.01.2029 (d)           | 63.389         | 62.420                   | 3,75                              |
| 4,898 % fällig am 12.09.2055                                                  | 2.090          | 2.864                    | 0,17                              | 20.04.2073                                              | 6.937          | 6.958                    | 0,42                              | 0,875 % fällig am 15.02.2047               | 797            | 578                      | 0,03                              |
|                                                                               |                | 111.756                  | 6,72                              | 5,146 % fällig am 20.08.2066                            | 18             | 18                       | 0,00                              | 1,125 % fällig am 15.01.2033               | 7.753          | 7.412                    | 0,45                              |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                       |                |                          |                                   | 5,202 % fällig am 20.10.2072                            | 4.937          | 4.957                    | 0,30                              | 1,250 % fällig am 15.04.2028 (d)           | 93.144         | 92.987                   | 5,59                              |
| <b>United Kingdom Gilt</b>                                                    |                |                          |                                   | 5,302 % fällig am 20.03.2073                            | 5.672          | 5.696                    | 0,34                              | 1,375 % fällig am 15.02.2044               | 1.239          | 1.041                    | 0,06                              |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (b)                                              | 5.979          | 8.086                    | 0,49                              | 5,402 % fällig am 20.05.2073                            | 3.110          | 3.159                    | 0,19                              | 1,625 % fällig am 15.02.2044               | 67.135         | 67.982                   | 4,09                              |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (b)                                              | 12.236         | 16.606                   | 1,00                              | 5,461 % fällig am 20.08.2068                            | 947            | 952                      | 0,06                              | 1,625 % fällig am 15.10.2027 (d)           | 90.014         | 91.147                   | 5,48                              |
| 0,125 % fällig am 22.03.2029 (b)                                              | 19.301         | 25.935                   | 1,56                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                 |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 15.10.2029 (d)           | 49.475         | 49.847                   | 3,00                              |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (b)                                              | 63.687         | 89.078                   | 5,35                              | 4,500 % fällig am 01.08.2052 -                          |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 15.04.2030               | 77.168         | 78.165                   | 4,70                              |
| 4,125 % fällig am 22.07.2029                                                  | 9.200          | 12.726                   | 0,76                              | 01.09.2052                                              | 895            | 858                      | 0,05                              | 1,750 % fällig am 15.01.2034               | 15.131         | 15.007                   | 0,90                              |
| 4,250 % fällig am 07.12.2027                                                  | 17.000         | 23.624                   | 1,42                              | 6,000 % fällig am 01.03.2054                            | 23.341         | 23.751                   | 1,43                              | 2,125 % fällig am 15.04.2029 (d)           | 70.311         | 72.219                   | 4,34                              |
| 4,375 % fällig am 07.03.2030                                                  | 57.900         | 80.764                   | 4,86                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>            |                |                          |                                   | 2,125 % fällig am 15.02.2040               | 148            | 147                      | 0,01                              |
| 4,500 % fällig am 07.06.2028                                                  | 8.100          | 11.312                   | 0,68                              | 4,000 % fällig am 01.08.2055                            | 30.500         | 28.358                   | 1,70                              | 2,125 % fällig am 15.02.2054               | 3.344          | 3.063                    | 0,18                              |
| 4,750 % fällig am 22.10.2043                                                  | 10.000         | 13.104                   | 0,79                              | 4,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 15.10.2028               | 48.697         | 50.523                   | 3,04                              |
|                                                                               |                | 281.235                  | 16,91                             | 01.08.2055                                              | 53.600         | 51.252                   | 3,08                              | 2,375 % fällig am 15.02.2055 (d)           | 8.031          | 7.771                    | 0,47                              |
| Summe Großbritannien                                                          |                | 399.040                  | 23,99                             | 5,000 % fällig am 01.08.2055                            | 17.600         | 17.239                   | 1,03                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                                                               |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 01.08.2055                            | 18.800         | 19.088                   | 1,15                              | <b>Summe USA</b>                           |                | 1.259.778                | 75,74                             |
|                                                                               |                |                          |                                   |                                                         |                | 190.849                  | 11,47                             |                                            |                | 1.451.878                | 87,28                             |
| <b>USA</b>                                                                    |                |                          |                                   | <b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>                            |                |                          |                                   | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>      |                | <b>\$ 2.656.508</b>      | <b>159,70</b>                     |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                       |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)</b> |                |                          |                                   |                                            |                |                          |                                   |
| <b>Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.04.2026 (d)                        | 56.300         | 55.678                   | 3,35                              | <b>AKTIEN</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,334 % fällig am 25.10.2034                                                  | \$ 82          | 95                       | 0,01                              | 0,125 % fällig am 15.07.2026 (d)                        | 75.332         | 74.688                   | 4,49                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.10.2026 (d)                        | 62.096         | 61.389                   | 3,69                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>   |                |                          |                                   |
| 5,384 % fällig am 25.10.2033                                                  | 586            | 598                      | 0,03                              | 0,125 % fällig am 15.04.2027                            | 42.148         | 41.271                   | 2,48                              | <b>PIMCO Select Funds plc -</b>            |                |                          |                                   |
|                                                                               |                | 693                      | 0,04                              | 0,125 % fällig am 15.01.2030 (d)                        | 55.978         | 52.844                   | 3,18                              | <b>PIMCO US Dollar Short-Term Floating</b> |                |                          |                                   |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                         |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.07.2030                            | 6.631          | 6.231                    | 0,37                              | <b>NAV Fund (c)</b>                        | 80.833         | 806                      | 0,05                              |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>                            |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.01.2031                            | 29.942         | 27.753                   | 1,67                              | <b>Summe Investmentfonds</b>               |                | \$ 806                   | 0,05                              |
| 4,912 % fällig am 19.04.2035                                                  | 176            | 173                      | 0,01                              | 0,125 % fällig am 15.07.2031                            | 5.122          | 4.715                    | 0,28                              |                                            |                |                          |                                   |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>                          |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.01.2032                            | 926            | 839                      | 0,05                              |                                            |                |                          |                                   |
| 5,014 % fällig am 25.07.2045                                                  | 328            | 323                      | 0,02                              | 0,250 % fällig am 15.07.2029 (d)                        | 53.922         | 51.795                   | 3,11                              |                                            |                |                          |                                   |
| 5,074 % fällig am 25.07.2045                                                  | 61             | 62                       | 0,00                              | 0,250 % fällig am 15.02.2050                            | 499            | 290                      | 0,02                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                                                               |                | 558                      | 0,03                              | 0,375 % fällig am 15.01.2027 (d)                        | 63.738         | 62.874                   | 3,78                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                                                               |                |                          |                                   | 0,375 % fällig am 15.07.2027 (d)                        | 55.598         | 54.853                   | 3,30                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                                                               |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 15.01.2028 (d)                        | 73.212         | 71.862                   | 4,32                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                                                               |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.01.2026                            | 12.190         | 12.124                   | 0,73                              |                                            |                |                          |                                   |
|                                                                               |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.07.2032                            | 7.618          | 7.108                    | 0,43                              |                                            |                |                          |                                   |

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## FUTURES

| Beschreibung                                           | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month EURIBOR December Futures                       | Short | 12.2025     | 400                  | \$ (436)                                 | (0,03)               |
| 3-Month EURIBOR December Futures                       | Long  | 12.2026     | 400                  | 337                                      | 0,02                 |
| 3-Month EURIBOR September Futures                      | Short | 09.2025     | 413                  | (40)                                     | 0,00                 |
| 3-Month EURIBOR September Futures                      | Long  | 09.2026     | 413                  | 208                                      | 0,01                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures    | Short | 09.2025     | 114                  | (78)                                     | 0,00                 |
| Euro-Bobl September Futures                            | Long  | 09.2025     | 25                   | (16)                                     | 0,00                 |
| Euro-BTP September Futures                             | Long  | 09.2025     | 329                  | 148                                      | 0,01                 |
| Euro-Bund September Futures                            | Long  | 09.2025     | 239                  | (289)                                    | (0,02)               |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures               | Short | 09.2025     | 230                  | 607                                      | 0,04                 |
| Euro-OAT September Futures                             | Short | 09.2025     | 429                  | 495                                      | 0,03                 |
| Euro-Schatz September Futures                          | Short | 09.2025     | 190                  | 37                                       | 0,00                 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures        | Short | 09.2025     | 4                    | (11)                                     | 0,00                 |
| Short Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09.2025     | 359                  | 71                                       | 0,00                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 138                  | 114                                      | 0,01                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures            | Short | 09.2025     | 1.301                | (1.275)                                  | (0,08)               |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures           | Long  | 09.2025     | 924                  | 1.905                                    | 0,12                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures          | Short | 09.2025     | 365                  | (734)                                    | (0,04)               |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures         | Short | 09.2025     | 278                  | (1.094)                                  | (0,07)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures   | Short | 09.2025     | 59                   | (167)                                    | (0,01)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures             | Long  | 09.2025     | 5                    | 11                                       | 0,00                 |
|                                                        |       |             |                      | \$ (207)                                 | (0,01)               |

## OPTIONSKAUF

## FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|--------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,938      | 15.12.2025    | 327                  | \$ 163 | \$ 14     | 0,00                 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures                        | € 97,813      | 12.12.2025    | 327                  | \$ (218) | \$ (62)   | (0,01)               |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                      |          | \$ (255)  | (0,02)               |

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 34.700    | \$ 131                                          | 0,01                    |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2027       | 37.762      | 20                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 16.06.2029       | ¥ 1.952.000 | 70                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,237           | 21.11.2053       | \$ 8.700    | 2.415                                           | 0,15                    |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,865           | 13.02.2054       | 13.500      | 2.247                                           | 0,13                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,085           | 13.02.2034       | 5.200       | (182)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2055       | 1.100       | (1)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,400           | 23.02.2033       | 2.700       | (27)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,620           | 30.11.2029       | 56.188      | (522)                                           | (0,03)                  |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,701           | 15.11.2034       | 41.200      | 138                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,100           | 15.11.2052       | 24.350      | (520)                                           | (0,03)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,250           | 20.12.2025       | 68.000      | (401)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,760           | 18.01.2026       | 39.200      | (6)                                             | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 1,830           | 17.09.2027       | € 13.800    | 51                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 1,895           | 08.10.2027       | 16.800      | 39                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,000           | 17.09.2027       | 66.800      | 200                                             | 0,01                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,112           | 02.09.2027       | 7.800       | (21)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,120           | 03.09.2027       | 16.300      | (48)                                            | 0,00                    |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2035       | 71.410      | 11                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2055       | 32.020      | 2.334                                           | 0,14                    |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 1,375           | 15.02.2040       | 1.600       | (110)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 1,529           | 15.05.2027       | 28.200      | 66                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 1,946           | 15.03.2048       | 800         | (83)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,000           | 15.04.2026       | 16.300      | (55)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,000           | 15.02.2027       | 15.900      | (57)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,034           | 15.09.2034       | 1.100       | 5                                               | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,049           | 15.08.2034       | 5.000       | (38)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,359           | 15.08.2030       | 1.500       | 17                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 2,400           | 15.02.2044       | 3.900       | 205                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 2,590           | 15.12.2052       | 1.700       | 176                                             | 0,01                    |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 2,700           | 15.04.2053       | 5.500       | 869                                             | 0,05                    |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 2,763           | 15.09.2053       | 2.400       | 418                                             | 0,02                    |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,975           | 15.08.2027       | 19.700      | (284)                                           | (0,02)                  |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 3,000           | 15.05.2027       | 5.400       | 36                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 3,130           | 15.05.2027       | 100         | 1                                               | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 1,954           | 03.06.2029       | \$ 4.700    | (234)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 1,998           | 25.07.2029       | 4.300       | (214)                                           | (0,01)                  |
| Erhalt                                         | CPURNSA                           | 2,311           | 24.02.2031       | 6.600       | 303                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,335           | 05.02.2028       | 6.110       | (340)                                           | (0,02)                  |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,353           | 09.05.2028       | 960         | (52)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,364           | 10.05.2028       | 60          | (3)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,379           | 09.07.2028       | 1.900       | (102)                                           | (0,01)                  |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,380           | 15.10.2025       | 3.500       | (17)                                            | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                           | 2,419           | 05.03.2026       | 400         | 22                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | CPURNSA                           | 2,813           | 14.05.2026       | 1.600       | 86                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                             | 3,346           | 15.05.2030       | £ 550       | (42)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                             | 3,466           | 15.09.2034       | 2.000       | 40                                              | 0,00                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                             | 3,500           | 15.08.2034       | 4.800       | 95                                              | 0,01                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                             | 4,040           | 15.04.2029       | 4.400       | 142                                             | 0,01                    |
| Erhalt                                         | UKRPI                             | 4,615           | 15.02.2027       | 3.700       | 0                                               | 0,00                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                   |                 |                  |             | \$ 6.778                                        | 0,41                    |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## OPTIONSKAUF

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                                     | 3,650 %       | 04.12.2025    | 188.200                   | \$ 424 | \$ 603    | 0,03                    |

## VERKAUFSOPTIONEN

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung      | Anfänglicher<br>Index | Variabler Zinssatz                                         | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Cap - OTC CPALEMU | \$100,151             | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035    | 1.500                     | \$ (69) | \$ (41)   | 0,00                    |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert  | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|------------|------------|-------------------------|
| BRC        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,440 %       | 25.01.2027    | 4.400                     | \$ (39)    | \$ (43)    | 0,00                    |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,440         | 25.01.2027    | 4.400                     | (39)       | (27)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,740         | 08.09.2025    | 4.900                     | (113)      | (95)       | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,740         | 08.09.2025    | 4.900                     | (113)      | (32)       | 0,00                    |
| GLM        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,350         | 07.01.2027    | 18.600                    | (169)      | (167)      | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,350         | 07.01.2027    | 18.600                    | (169)      | (131)      | (0,01)                  |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,500         | 14.01.2027    | 26.700                    | (245)      | (293)      | (0,02)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,500         | 14.01.2027    | 26.700                    | (245)      | (155)      | (0,01)                  |
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 6-Month GBP-SONIA       | Erhalt                                      | 3,150         | 04.12.2025    | 188.200                   | (139)      | (165)      | (0,01)                  |
| MYI        | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                                     | 4,000         | 15.08.2025    | 50.200                    | (367)      | (46)       | 0,00                    |
|            |                                       |                         |                                             |               |               |                           | \$ (1.638) | \$ (1.154) | (0,07)                  |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| GST        | CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500 %                        | 17.10.2057       | \$ 11                     | \$ (1)                                       | \$ 1                                            | \$ 0      | 0,00                    |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                          | 17.08.2061       | 1.400                     | (3)                                          | 10                                              | 7         | 0,00                    |
|            | CMBX.NA.AAA.9 Index  | 0,500                          | 17.09.2058       | 642                       | 0                                            | 1                                               | 1         | 0,00                    |
|            |                      |                                |                  |                           | \$ (4)                                       | \$ 12                                           | \$ 8      | 0,00                    |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | \$ 5.854                 | \$ 812                           | \$ (6)                             | \$ (6)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 4.155                    | 4.750                            | (128)                              | (128)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 43.358                   | AUD 66.746                       | 385                                | 385                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 7.705                    | NZD 12.803                       | 67                                 | 67                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | AUD                    | 66.746                   | \$ 43.384                        | 0                                  | (386)                                                | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | CNH                    | 15.658                   | 2.185                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 12.803                   | 7.713                            | 0                                  | (67)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 966                      | € 823                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | AUD                    | 473                      | \$ 308                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 455.561                  | 517.995                          | 0                                  | (16.766)                                             | (1,01)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 1.083.703                | 795                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.016                    | IDR 16.570.067                   | 5                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 437                      | SGD 560                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 559                      | \$ 437                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 290                      | 9                                | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | €                      | 324                      | 373                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 4.225                    | 440                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 1.068                    | 32                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 53.927                   | 1.660                            | 0                                  | (197)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 1.050                    | BRL 5.845                        | 21                                 | 21                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.960                    | IDR 31.981.248                   | 9                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 150                      | THB 4.913                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu zahlende | Zu erhaltende<br>Währung | Zu erhaltende | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |      |
|------------|------------------|------------------------|-------------|--------------------------|---------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|------|
| BRC        | 07.2025          | \$                     | 596         | TWD                      | 17.747        | \$                               | 14                                 | \$                                                   | 14                      | 0,00 |
|            | 08.2025          | CNH                    | 30.836      | \$                       | 4.315         | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | TWD                    | 153.880     |                          | 4.925         | 0                                | (423)                              | (423)                                                | (0,02)                  |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.187       | INR                      | 103.180       | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          |                        | 174         | TWD                      | 5.682         | 24                               | 0                                  | 24                                                   | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | AUD                    | 274         | \$                       | 179           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | €                      | 17.797      |                          | 20.211        | 0                                | (681)                              | (681)                                                | (0,04)                  |      |
|            | 07.2025          | ILS                    | 9.236       |                          | 2.653         | 0                                | (90)                               | (90)                                                 | (0,01)                  |      |
|            | 07.2025          | KRW                    | 157.545     |                          | 115           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | NOK                    | 606         |                          | 60            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | TRY                    | 798         |                          | 20            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.681       | €                        | 3.215         | 93                               | 0                                  | 93                                                   | 0,01                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 370.781     | £                        | 272.511       | 2655                             | 0                                  | 2.655                                                | 0,16                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 1.316       | ILS                      | 4.441         | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 12          | KRW                      | 16.481        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 57          | PLN                      | 215           | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |      |
| CBK        | 07.2025          |                        | 109         | TRY                      | 4.422         | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 1.124       | ZAR                      | 20.317        | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | £                      | 272.511     | \$                       | 370.831       | 0                                | (2.659)                            | (2.659)                                              | (0,16)                  |      |
|            | 09.2025          | PEN                    | 247         |                          | 68            | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | CNY                    | 5.793       |                          | 808           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | DKK                    | 251.235     |                          | 38.271        | 0                                | (1.258)                            | (1.258)                                              | (0,08)                  |      |
|            | 07.2025          | €                      | 19.660      |                          | 22.804        | 0                                | (274)                              | (274)                                                | (0,02)                  |      |
|            | 07.2025          | £                      | 5.826       |                          | 7.807         | 0                                | (177)                              | (177)                                                | (0,01)                  |      |
|            | 07.2025          | KRW                    | 9.983.378   |                          | 7.282         | 0                                | (99)                               | (99)                                                 | (0,01)                  |      |
|            | 07.2025          | THB                    | 55.908      |                          | 1.681         | 0                                | (40)                               | (40)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | TWD                    | 94.230      |                          | 2.896         | 0                                | (348)                              | (348)                                                | (0,02)                  |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 14.120      | BRL                      | 83.875        | 1249                             | 0                                  | 1.249                                                | 0,08                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 1.578       | IDR                      | 25.698.944    | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 12.179      | SEK                      | 116.128       | 39                               | (33)                               | 6                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 921         | TWD                      | 27.310        | 19                               | 0                                  | 19                                                   | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | CNH                    | 1.864       | \$                       | 259           | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |      |
| DUB        | 08.2025          | SEK                    | 57.229      |                          | 6.051         | 34                               | 0                                  | 34                                                   | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | TWD                    | 101.462     |                          | 3.113         | 0                                | (413)                              | (413)                                                | (0,02)                  |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 8.889       | INR                      | 766.125       | 29                               | (6)                                | 23                                                   | 0,00                    |      |
|            | 09.2025          | MXN                    | 4.573       | \$                       | 238           | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 12.2025          | PEN                    | 538         |                          | 145           | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | ILS                    | 4.485       |                          | 1.294         | 0                                | (38)                               | (38)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | KRW                    | 177.271     |                          | 130           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | SGD                    | 58          |                          | 45            | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 7.742       | DKK                      | 49.304        | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 552.051     | €                        | 475.865       | 6544                             | 0                                  | 6.544                                                | 0,39                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 131         | IDR                      | 2.127.617     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 546         | TWD                      | 16.219        | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | DKK                    | 49.184      | \$                       | 7.742         | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | €                      | 474.822     |                          | 552.051       | 0                                | (6.535)                            | (6.535)                                              | (0,39)                  |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 4.120       | INR                      | 355.519       | 17                               | (1)                                | 16                                                   | 0,00                    |      |
|            | FAR              | 09.2025                | MXN         | 59                       | \$            | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0                       | 0,00 |
| 07.2025    |                  | AUD                    | 65.999      |                          | 42.583        | 0                                | (670)                              | (670)                                                | (0,04)                  |      |
| 07.2025    |                  | BRL                    | 94.438      |                          | 17.031        | 0                                | (272)                              | (272)                                                | (0,02)                  |      |
| 07.2025    |                  | CHF                    | 3.462       |                          | 4.204         | 0                                | (145)                              | (145)                                                | (0,01)                  |      |
| 07.2025    |                  | CNH                    | 2.978       |                          | 414           | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | ¥                      | 8.384.687   |                          | 58.447        | 400                              | 0                                  | 400                                                  | 0,02                    |      |
| 07.2025    |                  | SEK                    | 67.833      |                          | 7.082         | 0                                | (35)                               | (35)                                                 | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | SGD                    | 172         |                          | 134           | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  | \$                     | 4.555       | CHF                      | 3.646         | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  |                        | 22.752      | DKK                      | 144.791       | 29                               | 0                                  | 29                                                   | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  |                        | 32.896      | ¥                        | 4.788.409     | 255                              | 0                                  | 255                                                  | 0,02                    |      |
| 07.2025    |                  |                        | 2.339       | PLN                      | 8.625         | 47                               | 0                                  | 47                                                   | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  |                        | 352         | SGD                      | 448           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    |                  | CHF                    | 3.631       | \$                       | 4.555         | 0                                | (26)                               | (26)                                                 | 0,00                    |      |
| 08.2025    |                  | CNH                    | 9.162       |                          | 1.280         | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |      |
| 08.2025    |                  | DKK                    | 144.437     |                          | 22.752        | 0                                | (29)                               | (29)                                                 | 0,00                    |      |
| GLM        | 08.2025          | ¥                      | 4.770.800   |                          | 32.896        | 0                                | (254)                              | (254)                                                | (0,01)                  |      |
|            | 08.2025          | SGD                    | 447         |                          | 352           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.969       | INR                      | 170.272       | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                    |      |
|            | 09.2025          |                        | 15.572      | BRL                      | 87.418        | 204                              | 0                                  | 204                                                  | 0,01                    |      |
|            | 09.2025          |                        | 2.552       | MXN                      | 49.687        | 57                               | 0                                  | 57                                                   | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | TWD                    | 10.243      | \$                       | 315           | 0                                | (38)                               | (38)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 374         | IDR                      | 6.095.894     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          |                        | 137         | SGD                      | 174           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 08.2025          | SGD                    | 174         | \$                       | 137           | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | CHF                    | 189         |                          | 231           | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | CNH                    | 5.642       |                          | 782           | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | KRW                    | 842.668     |                          | 616           | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | SGD                    | 3.852       |                          | 2.998         | 0                                | (26)                               | (26)                                                 | 0,00                    |      |
|            | 07.2025          | TWD                    | 54.586      |                          | 1.679         | 0                                | (201)                              | (201)                                                | (0,01)                  |      |
|            | 07.2025          | \$                     | 754         | BRL                      | 4.410         | 54                               | 0                                  | 54                                                   | 0,00                    |      |
|            | JPM              | 07.2025                |             | 4.823                    | PLN           | 17.863                           | 118                                | 0                                                    | 118                     | 0,01 |
| 07.2025    |                  |                        | 286         | SGD                      | 367           | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |      |
| 07.2025    |                  |                        | 322         | ZAR                      | 5.761         | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |      |
| 08.2025    |                  | CNH                    | 14.627      | \$                       | 2.039         | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |      |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat |         | Zu zahlende<br>Währung |        | Zu erhaltende<br>Währung |        | Nicht realisierte<br>Wertzunahme |             | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) |        | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|---------|------------------------|--------|--------------------------|--------|----------------------------------|-------------|------------------------------------|--------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| MBC        | 08.2025          | SGD     | 366                    | \$     | 286                      | \$     | 0                                | \$          | (2)                                | \$     | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD     | 53.361                 |        | 1.637                    |        | 0                                |             | (217)                              |        | (217)                                                | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$      | 1.327                  | INR    | 115.078                  |        | 11                               |             | 0                                  |        | 11                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          |         | 61                     | TWD    | 2.013                    |        | 9                                |             | 0                                  |        | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD     | 21.059                 | \$     | 15.333                   |        | 0                                |             | (101)                              |        | (101)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH     | 2.705                  |        | 375                      |        | 0                                |             | (3)                                |        | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €       | 13.884                 |        | 16.030                   |        | 0                                |             | (268)                              |        | (268)                                                | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | £       | 1.217                  |        | 1.649                    |        | 0                                |             | (18)                               |        | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥       | 382.972                |        | 2.666                    |        | 14                               |             | 0                                  |        | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD     | 9.253                  |        | 7.212                    |        | 0                                |             | (52)                               |        | (52)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB     | 28.065                 |        | 848                      |        | 0                                |             | (16)                               |        | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD     | 26.108                 |        | 801                      |        | 0                                |             | (98)                               |        | (98)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$      | 15.326                 | CAD    | 21.067                   |        | 113                              |             | 0                                  |        | 113                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |         | 1.988                  | €      | 1.707                    |        | 16                               |             | 0                                  |        | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 1.039                  | £      | 770                      |        | 16                               |             | 0                                  |        | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 389                    | IDR    | 6.318.230                |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 440                    | PLN    | 1.649                    |        | 16                               |             | 0                                  |        | 16                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 7.555                  | SGD    | 9.770                    |        | 116                              |             | 0                                  |        | 116                                                  | 0,01                    |
|            | 07.2025          |         | 43                     | TWD    | 1.291                    |        | 1                                |             | 0                                  |        | 1                                                    | 0,00                    |
|            | MYI              | 08.2025 | CAD                    | 21.031 | \$                       | 15.326 |                                  | 0           |                                    | (114)  |                                                      | (114)                   |
| 08.2025    |                  | CNH     | 14.465                 |        | 2.006                    |        | 0                                |             | (21)                               |        | (21)                                                 | 0,00                    |
| 08.2025    |                  | SGD     | 9.747                  |        | 7.555                    |        | 0                                |             | (117)                              |        | (117)                                                | (0,01)                  |
| 08.2025    |                  | TWD     | 71.751                 |        | 2.227                    |        | 0                                |             | (266)                              |        | (266)                                                | (0,02)                  |
| 07.2025    |                  | €       | 1.009                  |        | 1.182                    |        | 0                                |             | (3)                                |        | (3)                                                  | 0,00                    |
| 07.2025    |                  | £       | 46                     |        | 63                       |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
| 07.2025    |                  | ¥       | 189.408                |        | 1.311                    |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
| 07.2025    |                  | \$      | 1.346                  | £      | 981                      |        | 0                                |             | (1)                                |        | (1)                                                  | 0,00                    |
| 07.2025    |                  |         | 10.461                 | ¥      | 1.525.536                |        | 100                              |             | 0                                  |        | 100                                                  | 0,01                    |
| 07.2025    |                  |         | 569                    | NOK    | 5.737                    |        | 0                                |             | (2)                                |        | (2)                                                  | 0,00                    |
| 07.2025    |                  |         | 12                     | PLN    | 45                       |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
| 08.2025    |                  | CNH     | 9.338                  | \$     | 1.304                    |        | 0                                |             | (4)                                |        | (4)                                                  | 0,00                    |
| 08.2025    |                  | ¥       | 1.519.928              |        | 10.461                   |        | 0                                |             | (100)                              |        | (100)                                                | (0,01)                  |
| 08.2025    |                  | NOK     | 5.736                  |        | 569                      |        | 2                                |             | 0                                  |        | 2                                                    | 0,00                    |
| 07.2025    |                  | \$      | 1.994                  | SEK    | 19.135                   |        | 14                               |             | 0                                  |        | 14                                                   | 0,00                    |
| RYL<br>SCX | 07.2025          | ILS     | 68                     | \$     | 20                       |        | 0                                |             | (1)                                |        | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD     | 4.144                  |        | 142                      |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$      | 811                    | CNY    | 5.806                    |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 1.740                  | IDR    | 28.350.084               |        | 6                                |             | 0                                  |        | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 13                     | ¥      | 1.893                    |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 1.509                  | SGD    | 1.946                    |        | 19                               |             | 0                                  |        | 19                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 1.632                  | TWD    | 48.501                   |        | 37                               |             | 0                                  |        | 37                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH     | 20.445                 | \$     | 2.860                    |        | 0                                |             | (5)                                |        | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNY     | 5.791                  |        | 811                      |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥       | 1.886                  |        | 13                       |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD     | 1.941                  |        | 1.509                    |        | 0                                |             | (19)                               |        | (19)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD     | 14.576                 |        | 447                      |        | 0                                |             | (60)                               |        | (60)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$      | 1.389                  | INR    | 119.286                  |        | 0                                |             | (2)                                |        | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €       | 872                    | \$     | 1.004                    |        | 0                                |             | (20)                               |        | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$      | 1.533                  | ¥      | 221.302                  |        | 0                                |             | (1)                                |        | (1)                                                  | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          |         | 59                     | NOK    | 597                      |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥       | 220.490                | \$     | 1.533                    |        | 1                                |             | 0                                  |        | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NOK     | 597                    |        | 59                       |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$      | 8                      | INR    | 687                      |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £       | 266.238                | \$     | 360.491                  |        | 0                                |             | (4.349)                            |        | (4.349)                                              | (0,26)                  |
|            | 07.2025          | ILS     | 679                    |        | 189                      |        | 0                                |             | (12)                               |        | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥       | 123.586                |        | 854                      |        | 0                                |             | (2)                                |        | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW     | 157.220                |        | 116                      |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NOK     | 5.728                  |        | 564                      |        | 0                                |             | (2)                                |        | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK     | 63.169                 |        | 6.574                    |        | 0                                |             | (54)                               |        | (54)                                                 | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          | THB     | 4.456                  |        | 134                      |        | 0                                |             | (3)                                |        | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$      | 116                    | KRW    | 157.296                  |        | 0                                |             | 0                                  |        | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €       | 16.740                 | \$     | 18.912                   |        | 0                                |             | (740)                              |        | (740)                                                | (0,04)                  |
|            | 07.2025          | NZD     | 12.803                 |        | 7.635                    |        | 0                                |             | (137)                              |        | (137)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$      | 55.127                 | €      | 47.011                   |        | 56                               |             | 0                                  |        | 56                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |         | 17.657                 | ¥      | 2.542.835                |        | 0                                |             | (53)                               |        | (53)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | €       | 47.011                 | \$     | 55.247                   |        | 0                                |             | (56)                               |        | (56)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥       | 2.533.477              |        | 17.657                   |        | 53                               |             | 0                                  |        | 53                                                   | 0,00                    |
|            |                  |         |                        |        |                          |        | \$ 13.085                        | \$ (39.346) | \$ (26.261)                        | (1,58) |                                                      |                         |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                    | 24.789                   | \$ 31.037                        | \$ (105)                           | \$ (105)                                             | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 31.037                   | CHF 24.687                       | 105                                | 105                                                  | 0,01                    |
| BOA        | 07.2025          | CHF                    | 530                      | \$ 654                           | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        | 166                      | 203                              | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        | 181                      | 222                              | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 617                      | CHF 507                          | 19                                 | 19                                                   | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| FAR        | 07.2025          | CHF 24.707          | \$ 30.861             | \$ 0                          | \$ (177)                        | \$ (177)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 29.899           | CHF 24.621            | 1.032                         | 0                               | 1.032                                          | 0,06                 |
|            | 08.2025          | 30.861              | 24.605                | 178                           | 0                               | 178                                            | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025          | CHF 227             | \$ 284                | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 30.356           | CHF 24.945            | 981                           | 0                               | 981                                            | 0,06                 |
| RBC        | 07.2025          | 28.521              | 23.391                | 865                           | 0                               | 865                                            | 0,05                 |
| SCX        | 07.2025          | 4                   | 3                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 3.180                      | \$ (307)                        | \$ 2.873                                       | 0,17                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 213.314           | \$ 249.765            | \$ 0                          | \$ (633)                        | \$ (633)                                       | (0,04)               |
|            | 07.2025          | \$ 231.820          | € 204.027             | 7.677                         | 0                               | 7.677                                          | 0,46                 |
|            | 08.2025          | 250.312             | 213.314               | 632                           | 0                               | 632                                            | 0,04                 |
| BOA        | 07.2025          | 244.137             | 214.711               | 7.901                         | 0                               | 7.901                                          | 0,47                 |
| BPS        | 07.2025          | 4.553               | 3.999                 | 142                           | 0                               | 142                                            | 0,01                 |
| BRC        | 07.2025          | € 2.410             | \$ 2.759              | 0                             | (70)                            | (70)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 245.097          | € 215.818             | 8.241                         | 0                               | 8.241                                          | 0,50                 |
| CBK        | 07.2025          | € 6.352             | \$ 7.329              | 0                             | (127)                           | (127)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 2.208            | € 1.915               | 40                            | 0                               | 40                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 211.534           | \$ 245.400            | 0                             | (2.909)                         | (2.909)                                        | (0,17)               |
|            | 08.2025          | \$ 245.400          | € 211.070             | 2.905                         | 0                               | 2.905                                          | 0,17                 |
| MBC        | 07.2025          | € 14.947            | \$ 17.324             | 0                             | (222)                           | (222)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 6.339            | € 5.432               | 38                            | 0                               | 38                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 27.576                     | \$ (3.961)                      | \$ 23.615                                      | 1,42                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 46.443            | \$ 63.730             | \$ 86                         | \$ 0                            | \$ 86                                          | 0,01                 |
|            | 08.2025          | \$ 63.738           | £ 46.443              | 0                             | (86)                            | (86)                                           | (0,01)               |
| BOA        | 07.2025          | £ 29                | \$ 39                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 51.188              | 69.631                | 0                             | (515)                           | (515)                                          | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$ 64.446           | £ 47.731              | 962                           | 0                               | 962                                            | 0,06                 |
|            | 08.2025          | 67.881              | 49.883                | 487                           | 0                               | 487                                            | 0,03                 |
| CBK        | 07.2025          | £ 601               | \$ 816                | 0                             | (7)                             | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 418              | £ 312                 | 9                             | 0                               | 9                                              | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | 67.431              | 50.053                | 1.160                         | 0                               | 1.160                                          | 0,07                 |
| MBC        | 07.2025          | £ 445               | \$ 604                | 0                             | (6)                             | (6)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 74               | £ 55                  | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £ 49.441            | \$ 67.793             | 42                            | 0                               | 42                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 67.725           | £ 50.018              | 817                           | 0                               | 817                                            | 0,05                 |
|            | 08.2025          | 67.802              | 49.441                | 0                             | (41)                            | (41)                                           | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | £ 22                | \$ 30                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 3.564                      | \$ (655)                        | \$ 2.909                                       | 0,18                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD 76.831          | \$ 60.001             | \$ 0                          | \$ (323)                        | \$ (323)                                       | (0,02)               |
|            | 07.2025          | \$ 123.829          | SGD 159.571           | 1.458                         | 0                               | 1.458                                          | 0,09                 |
|            | 08.2025          | 60.001              | 76.652                | 332                           | 0                               | 332                                            | 0,02                 |
| CBK        | 07.2025          | SGD 1.302           | \$ 1.013              | 0                             | (9)                             | (9)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 10.037           | SGD 12.882            | 78                            | 0                               | 78                                             | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | SGD 188.320         | \$ 147.649            | 0                             | (210)                           | (210)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 173.664          | SGD 223.458           | 1.783                         | 0                               | 1.783                                          | 0,11                 |
|            | 08.2025          | 147.649             | 187.871               | 227                           | 0                               | 227                                            | 0,01                 |
| GLM        | 07.2025          | SGD 82.482          | \$ 64.707             | 0                             | (53)                            | (53)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 64.707           | SGD 82.284            | 59                            | 0                               | 59                                             | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | SGD 192.693         | \$ 149.011            | 0                             | (2.281)                         | (2.281)                                        | (0,14)               |
|            | 07.2025          | \$ 120.317          | SGD 154.352           | 872                           | 0                               | 872                                            | 0,05                 |
|            | 08.2025          | 148.328             | 191.377               | 2.307                         | 0                               | 2.307                                          | 0,14                 |
| RYL        | 07.2025          | SGD 1.152           | \$ 898                | 0                             | (7)                             | (7)                                            | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | 32.626              | 25.296                | 0                             | (321)                           | (321)                                          | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$ 25.296           | SGD 32.552            | 326                           | 0                               | 326                                            | 0,02                 |
| SOG        | 07.2025          | 81.082              | 104.440               | 918                           | 0                               | 918                                            | 0,06                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 8.360                      | \$ (3.204)                      | \$ 5.156                                       | 0,31                 |

|                                  |  |  |  |  |  |                |         |
|----------------------------------|--|--|--|--|--|----------------|---------|
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |  |  |  |  |  | \$ 7.708       | 0,46    |
| Summe Anlagen                    |  |  |  |  |  | \$ 2.671.545   | 160,60  |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |  |  |  |  |  | \$ (1.008.118) | (60,60) |
| Nettovermögen                    |  |  |  |  |  | \$ 1.663.427   | 100,00  |

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 873.250 USD (31. Dezember 2024: 548.091 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 1.630 USD (31. Dezember 2024: 691 USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 13.650 USD (31. Dezember 2024: 16.665 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 13.250 USD (31. Dezember 2024: 8.190 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 2.648.291                                                    | \$ 8.217                                                     | \$ 2.656.508 |
| Investmentfonds               | 806                                                                         | 0                                                               | 0                                                            | 806          |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 997                                                                         | 13.234                                                          | 0                                                            | 14.231       |
| Summen                        | \$ 1.803                                                                    | \$ 2.661.525                                                    | \$ 8.217                                                     | \$ 2.671.545 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 1.835.105                                                    | \$ 0                                                         | \$ 1.835.105 |
| Investmentfonds               | 16.937                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 16.937       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 1.123                                                                       | (4.666)                                                         | 0                                                            | (3.543)      |
| Summen                        | \$ 18.060                                                                   | \$ 1.830.439                                                    | \$ 0                                                         | \$ 1.848.499 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:**

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BOM                                | 4,450 %    | 09.06.2025       | 17.07.2025         | \$ (234.598) | \$ (235.235)                                | (14,14)                 |
| BOS                                | 4,200      | 24.06.2025       | 02.07.2025         | (689)        | (689)                                       | (0,04)                  |
|                                    | 4,430      | 16.06.2025       | 14.07.2025         | (2.413)      | (2.417)                                     | (0,15)                  |
| BRC                                | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (857)      | (1.007)                                     | (0,06)                  |
| CIB                                | 4,440      | 06.06.2025       | 18.07.2025         | \$ (568.644) | (570.397)                                   | (34,29)                 |
| DEU                                | 4,480      | 25.06.2025       | 02.07.2025         | (11.361)     | (11.370)                                    | (0,68)                  |
| JPS                                | 4,350      | 23.06.2025       | 07.07.2025         | (7.047)      | (7.054)                                     | (0,43)                  |
|                                    | 4,460      | 24.06.2025       | 01.07.2025         | (5.319)      | (5.323)                                     | (0,32)                  |
| STR                                | 4,490      | 30.06.2025       | 01.07.2025         | (27.666)     | (27.670)                                    | (1,66)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                    |              | \$ (861.162)                                | (51,77)                 |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 7.534                            | \$ (6.800)                            | \$ 734                          | \$ (1.005)                          | \$ 800                                | \$ (205)                        |
| BOA        | (7.415)                             | 6.990                                 | (425)                           | (1.906)                             | 1.210                                 | (696)                           |
| BPS        | (413)                               | 470                                   | 57                              | (265)                               | 280                                   | 15                              |
| BRC        | 8.240                               | (8.060)                               | 180                             | (45)                                | (30)                                  | (75)                            |
| CBK        | (1.286)                             | 1.330                                 | 44                              | (175)                               | 0                                     | (175)                           |
| DUB        | (6)                                 | 0                                     | (6)                             | (1.690)                             | 1.500                                 | (190)                           |
| FAR        | 2.426                               | (2.110)                               | 316                             | 780                                 | (650)                                 | 130                             |



| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| GLM        | \$ (818)                            | \$ (200)                              | \$ (1.018)                      | \$ (414)                            | \$ 300                                | \$ (114)                        |
| GST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (311)                               | 310                                   | (1)                             |
| JPM        | 878                                 | (1.030)                               | (152)                           | 27                                  | 0                                     | 27                              |
| MBC        | 907                                 | (460)                                 | 447                             | 567                                 | (360)                                 | 207                             |
| MYC        | 438                                 | (360)                                 | 78                              | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| MYI        | (54)                                | 160                                   | 106                             | 35                                  | 160                                   | 195                             |
| RBC        | 865                                 | (560)                                 | 305                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| RYL        | 7                                   | 0                                     | 7                               | (168)                               | 0                                     | (168)                           |
| SAL        | 8                                   | 0                                     | 8                               | 1                                   | 0                                     | 1                               |
| SCX        | (20)                                | 0                                     | (20)                            | (4.005)                             | 3.350                                 | (655)                           |
| SOG        | 898                                 | (930)                                 | (32)                            | (22)                                | 0                                     | (22)                            |
| SSB        | (3.531)                             | 3.690                                 | 159                             | 2                                   | (10)                                  | (8)                             |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (381)                               | 280                                   | (101)                           |
| UAG        | (73)                                | 0                                     | (73)                            | 65                                  | 0                                     | 65                              |
| WST        | (877)                               | 610                                   | (267)                           | 1.653                               | (1.530)                               | 123                             |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 76,84             | 73,92             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 11,36             | 12,39             |
| Investmentfonds                                                        | 0,03              | 0,80              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,13              | 0,24              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,34              | 0,39              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,87              | 0,60              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 9,43              | 11,66             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\*Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                      | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                                 | 2,68              | 0,85              |
| Kanada                                                     | 0,62              | 0,61              |
| Kaimaninseln                                               | 0,12              | 0,03              |
| Dänemark                                                   | 2,39              | 3,17              |
| Frankreich                                                 | 8,43              | 8,01              |
| Deutschland                                                | 5,33              | 6,31              |
| Ungarn                                                     | 0,13              | k. A.             |
| Irland                                                     | 5,03              | 4,09              |
| Italien                                                    | 9,11              | 6,46              |
| Japan                                                      | 4,12              | 5,27              |
| Luxemburg                                                  | 4,07              | 3,36              |
| Mexiko                                                     | 0,01              | 0,08              |
| Niederlande                                                | 0,83              | 0,76              |
| Neuseeland                                                 | 0,45              | 0,56              |
| Peru                                                       | 0,01              | 0,02              |
| Rumänien                                                   | 0,21              | 0,09              |
| Saudi-Arabien                                              | 0,54              | k. A.             |
| Spanien                                                    | 2,21              | 0,84              |
| Supranational                                              | 1,74              | 1,98              |
| Schweden                                                   | 0,35              | 0,99              |
| Schweiz                                                    | 0,05              | 0,07              |
| Großbritannien                                             | 23,99             | 17,12             |
| USA                                                        | 67,28             | 90,14             |
| Investmentfonds                                            | 0,05              | 1,39              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                   |                   |
| Futures                                                    | (0,01)            | 0,25              |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte              | (0,01)            | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                        |                   |                   |
| Zinsswaps                                                  | 0,41              | 0,05              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                 |                   |                   |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | 0,03              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Inflation-Capped Options                                   | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswapoptionen                                           | (0,07)            | (0,10)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf     | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                     | (1,58)            | 1,01              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                        | 2,08              | (1,51)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                | (60,60)           | (51,90)           |
| Nettovermögen                                              | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                                                     |                |                          |                          |       |
| <b>AUSTRALIEN</b>                                                            |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Canadian Imperial Bank of Commerce<br>4,495 % fällig am 20.12.2027 AUD       | 8.200          | \$ 5.443                 | 0,28                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                      |                |                          |                          |       |
| Australia Government International Bond<br>0,250 % fällig am 21.11.2032      | 9.802          | 11.761                   | 0,62                     |       |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027                                                 | 9.454          | 13.464                   | 0,71                     |       |
| 2,000 % fällig am 21.08.2035                                                 | 2.204          | 3.384                    | 0,18                     |       |
| New South Wales Treasury Corp.<br>4,750 % fällig am 20.09.2035               | 7.400          | 4.821                    | 0,25                     |       |
| Queensland Treasury Corp.<br>2,000 % fällig am 22.08.2033                    | 5.400          | 2.915                    | 0,15                     |       |
| Treasury Corp. of Victoria<br>2,250 % fällig am 20.11.2034                   | 16.200         | 8.546                    | 0,45                     |       |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032                                                 | 17.000         | 11.028                   | 0,58                     |       |
|                                                                              |                | 55.919                   | 2,94                     |       |
| Summe Australien                                                             |                | 61.362                   | 3,22                     |       |
| <b>KANADA</b>                                                                |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                      |                |                          |                          |       |
| Canadian Government Real Return Bond<br>0,500 % fällig am 01.12.2050 (c) CAD | 9.681          | 5.401                    | 0,28                     |       |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 (c)                                             | 4.347          | 2.944                    | 0,16                     |       |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (c)                                             | 11.365         | 8.191                    | 0,43                     |       |
| 3,000 % fällig am 01.12.2036 (c)                                             | 4.442          | 3.801                    | 0,20                     |       |
| 4,000 % fällig am 01.12.2031 (c)                                             | 6.258          | 5.417                    | 0,28                     |       |
| Summe Kanada                                                                 |                | 25.754                   | 1,35                     |       |
| <b>KAIMANINSELN</b>                                                          |                |                          |                          |       |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                          |       |
| BlueMountain CLO Ltd.<br>5,598 % fällig am 15.07.2031 \$                     | 1.601          | 1.602                    | 0,08                     |       |
| Catamaran CLO Ltd.<br>5,634 % fällig am 22.04.2030                           | 873            | 875                      | 0,05                     |       |
| Venture CLO Ltd.<br>5,578 % fällig am 07.09.2030                             | 288            | 288                      | 0,01                     |       |
|                                                                              |                | 2.765                    | 0,14                     |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Gaci First Investment Co.<br>5,125 % fällig am 14.02.2053                    | 3.700          | 3.173                    | 0,17                     |       |
| Summe Kaimaninseln                                                           |                | 5.938                    | 0,31                     |       |
| <b>DÄNEMARK</b>                                                              |                |                          |                          |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                      |                |                          |                          |       |
| DLR Kredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.10.2050 DKK                           | 3.120          | 393                      | 0,02                     |       |
| Jyske Realkredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.10.2050                         | 45             | 6                        | 0,00                     |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053                                                 | 11             | 1                        | 0,00                     |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050                                                 | 37             | 5                        | 0,00                     |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047                                                 | 3              | 1                        | 0,00                     |       |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab<br>0,500 % fällig am 01.10.2043         | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 0,500 % fällig am 01.10.2053                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2053                                                 | 3.421          | 430                      | 0,02                     |       |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047                                                 | 14             | 2                        | 0,00                     |       |
| 4,000 % fällig am 01.10.2056                                                 | 39.728         | 6.177                    | 0,33                     |       |
| Nykredit Realkredit A/S<br>0,500 % fällig am 01.10.2053                      | 12             | 1                        | 0,00                     |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2053                                                 | 24             | 3                        | 0,00                     |       |
| 1,000 % fällig am 01.10.2056                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 1,500 % fällig am 01.10.2052                                                 | 2.955          | 378                      | 0,02                     |       |
| 2,000 % fällig am 01.10.2053                                                 | 0              | 0                        | 0,00                     |       |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047                                                 | 3              | 0                        | 0,00                     |       |
| 3,000 % fällig am 01.10.2053                                                 | 11.299         | 1.670                    | 0,09                     |       |
| 3,500 % fällig am 01.04.2053                                                 | 53.871         | 8.241                    | 0,43                     |       |
| 4,000 % fällig am 01.10.2056                                                 | 354.659        | 55.330                   | 2,91                     |       |
| <b>FRANKREICH</b>                                                            |                |                          |                          |       |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Auto ABS French Loans<br>2,421 % fällig am 24.07.2036 €                      | 6.136          | 7.208                    | 0,38                     |       |
| Bavarian Sky S.A.<br>0,000 % fällig am 20.08.2032 (a)                        | 6.200          | 7.279                    | 0,38                     |       |
| BPCE Consumer Loans FCT<br>2,629 % fällig am 31.10.2042                      | 6.300          | 7.415                    | 0,39                     |       |
| Noria DE<br>2,479 % fällig am 25.02.2043                                     | 7.500          | 8.806                    | 0,46                     |       |
|                                                                              |                | 30.708                   | 1,61                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                      |                |                          |                          |       |
| France Government International Bond<br>0,100 % fällig am 01.03.2026 (c)(e)  | 16.332         | 19.057                   | 1,00                     |       |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028 (c)(e)                                          | 59.234         | 68.187                   | 3,58                     |       |
| 0,100 % fällig am 01.03.2032 (c)                                             | 3.110          | 3.422                    | 0,18                     |       |
| 0,550 % fällig am 01.03.2039 (c)                                             | 9.620          | 9.948                    | 0,52                     |       |
| 0,700 % fällig am 25.07.2030 (c)                                             | 16.577         | 19.433                   | 1,02                     |       |
| 0,950 % fällig am 25.07.2043 (c)                                             | 14.777         | 15.481                   | 0,82                     |       |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (c)                                             | 4.189          | 5.088                    | 0,27                     |       |
| 1,850 % fällig am 25.07.2027 (c)                                             | 14.492         | 17.547                   | 0,92                     |       |
|                                                                              |                | 158.163                  | 8,31                     |       |
| Summe Frankreich                                                             |                | 188.871                  | 9,92                     |       |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                                           |                |                          |                          |       |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Cars Alliance Auto Loans Germany<br>2,431 % fällig am 18.01.2036             | 6.282          | 7.381                    | 0,39                     |       |
| RevoCar S.A., Compartement<br>2,411 % fällig am 25.03.2038                   | 9.127          | 10.722                   | 0,56                     |       |
| Revocar UG<br>2,436 % fällig am 21.02.2037                                   | 5.048          | 5.932                    | 0,31                     |       |
|                                                                              |                | 24.035                   | 1,26                     |       |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>0,000 % fällig am 31.03.2027 (b)          | 10.600         | 12.030                   | 0,63                     |       |
| 0,375 % fällig am 23.04.2030                                                 | 21.200         | 22.644                   | 1,19                     |       |
| 2,500 % fällig am 09.10.2030                                                 | 4.300          | 5.067                    | 0,27                     |       |
| 2,625 % fällig am 10.01.2034                                                 | 14.600         | 16.942                   | 0,89                     |       |
| 3,125 % fällig am 10.10.2028                                                 | 28.300         | 34.213                   | 1,80                     |       |
| Landwirtschaftliche Rentenbank<br>0,875 % fällig am 15.12.2026 £             | 7.300          | 9.576                    | 0,50                     |       |
|                                                                              |                | 100.472                  | 5,28                     |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                      |                |                          |                          |       |
| Bundesrepublik Deutschland<br>0,100 % fällig am 15.04.2033 (c) €             | 3.802          | 4.269                    | 0,22                     |       |
| 0,100 % fällig am 15.04.2046 (c)                                             | 10.003         | 9.625                    | 0,51                     |       |
| 2,600 % fällig am 15.08.2033                                                 | 800            | 948                      | 0,05                     |       |
|                                                                              |                | 14.842                   | 0,78                     |       |
| Summe Deutschland                                                            |                | 139.349                  | 7,32                     |       |
| <b>UNGARN</b>                                                                |                |                          |                          |       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                      |                |                          |                          |       |
| Hungary Government International Bond<br>4,500 % fällig am 16.06.2034        | 3.000          | 3.554                    | 0,19                     |       |
| <b>IRLAND</b>                                                                |                |                          |                          |       |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Adagio CLO DAC<br>3,203 % fällig am 10.10.2031                               | 6.979          | 8.204                    | 0,43                     |       |
| Arcano Euro CLO DAC<br>0,000 % fällig am 25.07.2039 (a)                      | 1.500          | 1.761                    | 0,09                     |       |
| <b>ESPAÑA</b>                                                                |                |                          |                          |       |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Ares European CLO DAC<br>3,059 % fällig am 15.10.2031 €                      | 1.088          | \$ 1.276                 | 0,07                     |       |
| 3,086 % fällig am 20.04.2032                                                 | 553            | 649                      | 0,03                     |       |
| Avoca CLO DAC<br>3,075 % fällig am 12.01.2031                                | 1.314          | 1.543                    | 0,08                     |       |
| Bain Capital Euro CLO DAC<br>3,016 % fällig am 20.04.2032                    | 46             | 54                       | 0,00                     |       |
| Black Diamond CLO DAC<br>3,123 % fällig am 15.05.2032                        | 4.134          | 4.852                    | 0,26                     |       |
| Blackrock European CLO DAC<br>2,875 % fällig am 15.12.2032                   | 1.473          | 1.730                    | 0,09                     |       |
| 3,243 % fällig am 17.07.2034                                                 | 500            | 586                      | 0,03                     |       |
| BNPP AM Euro CLO DAC<br>3,056 % fällig am 22.07.2032                         | 3.146          | 3.683                    | 0,19                     |       |
| Cairn CLO DAC<br>3,059 % fällig am 15.10.2031                                | 3.278          | 3.842                    | 0,20                     |       |
| Carlyle Euro CLO DAC<br>2,979 % fällig am 15.01.2031                         | 2.345          | 2.753                    | 0,15                     |       |
| 3,033 % fällig am 15.08.2032                                                 | 5.198          | 6.076                    | 0,32                     |       |
| Contego CLO DAC<br>2,823 % fällig am 23.01.2030                              | 1.094          | 1.282                    | 0,07                     |       |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC<br>2,605 % fällig am 15.09.2031                   | 1.881          | 2.208                    | 0,12                     |       |
| 3,134 % fällig am 29.07.2034                                                 | 4.300          | 5.029                    | 0,26                     |       |
| 3,141 % fällig am 20.08.2034                                                 | 1.925          | 2.259                    | 0,12                     |       |
| CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC<br>2,983 % fällig am 15.08.2033       | 1.864          | 2.182                    | 0,11                     |       |
| Dryden Euro CLO DAC<br>2,939 % fällig am 15.04.2033                          | 3.169          | 3.718                    | 0,20                     |       |
| 3,003 % fällig am 15.05.2034                                                 | 1.800          | 2.111                    | 0,11                     |       |
| Euro-Galaxy CLO DAC<br>2,811 % fällig am 24.04.2034                          | 5.580          | 6.536                    | 0,34                     |       |
| Harvest CLO DAC<br>1,040 % fällig am 15.07.2031                              | 744            | 847                      | 0,04                     |       |
| 2,916 % fällig am 20.10.2031                                                 | 1.576          | 1.850                    | 0,10                     |       |
| 3,039 % fällig am 15.07.2031                                                 | 5.503          | 6.464                    | 0,34                     |       |
| 3,129 % fällig am 15.01.2032                                                 | 3.476          | 4.079                    | 0,21                     |       |
| Henley CLO DAC<br>3,148 % fällig am 25.04.2034                               | 2.300          | 2.697                    | 0,14                     |       |
| Invesco Euro CLO DAC<br>3,299 % fällig am 15.01.2034                         | 1.300          | 1.523                    | 0,08                     |       |
| Jubilee CLO DAC<br>2,929 % fällig am 15.04.2031                              | 1.653          | 1.935                    | 0,10                     |       |
| Madison Park Euro Funding DAC<br>3,079 % fällig am 15.07.2032                | 7.281          | 8.524                    | 0,45                     |       |
| Oak Hill European Credit Partners DAC<br>2,976 % fällig am 20.10.2031        | 933            | 1.094                    | 0,06                     |       |
| OCP Euro CLO DAC<br>3,116 % fällig am 22.09.2034                             | 5.407          | 6.346                    | 0,33                     |       |
| 3,156 % fällig am 20.04.2035                                                 | 2.000          | 2.337                    | 0,12                     |       |
| Palmer Square European CLO DAC<br>3,209 % fällig am 15.04.2035               | 1.700          | 1.995                    | 0,11                     |       |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>2,999 % fällig am 15.10.2031      | 1.411          | 1.653                    | 0,09                     |       |
| 3,113 % fällig am 15.08.2033                                                 | 740            | 868                      | 0,05                     |       |
| 3,133 % fällig am 15.05.2034                                                 | 1.415          | 1.659                    | 0,09                     |       |
| Sculptor European CLO DAC<br>3,329 % fällig am 15.10.2034                    | 6.100          | 7.145                    | 0,38                     |       |
| 3,361 % fällig am 27.04.2038                                                 | 5.700          | 6.701                    | 0,35                     |       |
| Toro European CLO DAC<br>2,953 % fällig am 15.02.2034                        | 10.159         | 11.888                   | 0,62                     |       |
|                                                                              |                | 131.939                  | 6,93                     |       |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                        |                |                          |                          |       |
| Dilosk RMBS DAC<br>3,049 % fällig am 20.10.2062                              | 3.710          | 4.373                    | 0,23                     |       |
| Summe Irland                                                                 |                | 136.312                  | 7,16                     |       |
| <b>ITALIEN</b>                                                               |                |                          |                          |       |
| <b>FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                          |       |
| Marzio Finance SRL<br>3,019 % fällig am 28.02.2048                           | 2.115          | 2.496                    | 0,13                     |       |
| Red & Black Auto Italy SRL<br>2,929 % fällig am 28.07.2034                   | 2.899          | 3.423                    | 0,18                     |       |
|                                                                              |                | 5.919                    | 0,31                     |       |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   | <b>SAUDI-ARABIEN</b>                       |                |                          |                                   | <b>Stratton BTL Mortgage Funding PLC</b>                                   |                |                          |                                   |
| Mundys SpA                                |                |                          |                                   | Saudi Arabia Government International Bond |                |                          |                                   | 5,028 % fällig am 20.01.2054                                               | £              | 1.656                    | \$ 2.271 0,12                     |
| 4,500 % fällig am 24.01.2030              | €              | 1.100                    | \$ 1.344 0,07                     | 5,125 % fällig am 13.01.2028               | \$             | 12.100                   | \$ 12.305 0,65                    | Tower Bridge Funding PLC                                                   |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 13.01.2031               |                | 2.400                    | 2.491 0,13                        | 4,959 % fällig am 20.12.2063                                               |                | 1.188                    | 1.629 0,09                        |
|                                           |                |                          |                                   | Summe Saudi-Arabien                        |                | 14.796                   | 0,78                              | 5,017 % fällig am 20.11.2063                                               |                | 952                      | 1.305 0,07                        |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | <b>SPANIEN</b>                             |                |                          |                                   | 5,398 % fällig am 20.01.2066                                               |                | 3.635                    | 4.994 0,26                        |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA             |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>    |                |                          |                                   | Twin Bridges PLC                                                           |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 30.04.2029              | \$             | 2.300                    | 2.408 0,13                        | Auto ABS Spanish Loans                     |                |                          |                                   | 4,898 % fällig am 12.09.2055                                               |                | 4.597                    | 6.300 0,33                        |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro         |                |                          |                                   | 2,779 % fällig am 28.09.2038               | €              | 5.773                    | 6.798 0,35                        |                                                                            |                | 109.263                  | 5,74                              |
| 0,100 % fällig am 15.05.2033 (c)          | €              | 8.322                    | 8.817 0,46                        | Autonoria Spain                            |                |                          |                                   | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                    |                |                          |                                   |
| 0,400 % fällig am 15.05.2030 (c)          |                | 16.090                   | 18.390 0,97                       | 2,589 % fällig am 30.09.2041               |                | 3.518                    | 4.140 0,22                        | United Kingdom Gilt                                                        |                |                          |                                   |
| 1,300 % fällig am                         |                | 43.552                   | 51.896 2,73                       |                                            |                | 10.938                   | 0,57                              | 0,125 % fällig am 10.08.2028 (c)                                           |                | 39.012                   | 52.944 2,78                       |
| 15.05.2028 (c)(e)                         |                | 10.864                   | 12.748 0,67                       | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 10.08.2031 (c)                                           |                | 14.786                   | 19.404 1,02                       |
| 1,800 % fällig am 15.05.2036 (c)          |                | 35.881                   | 44.058 2,31                       | Spain Government International Bond        |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 22.03.2039 (c)                                           |                | 3.929                    | 4.275 0,23                        |
| 2,400 % fällig am                         |                | 3.759                    | 4.559 0,24                        | 0,700 % fällig am                          |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 10.08.2041 (c)                                           |                | 13.661                   | 14.092 0,74                       |
| 15.05.2039 (c)(e)                         |                | 23.200                   | 28.848 1,51                       | 30.11.2033 (c)                             | 18.463         | 20.865                   | 1,10                              | 0,125 % fällig am 22.03.2044 (c)                                           |                | 9.174                    | 8.762 0,46                        |
| 2,550 % fällig am 15.05.2056 (c)          |                | 7.000                    | 8.242 0,43                        | 0,850 % fällig am 30.07.2037               | 400            | 351                      | 0,02                              | 0,125 % fällig am 22.03.2046 (c)                                           |                | 6.237                    | 5.669 0,30                        |
| 4,100 % fällig am 01.02.2029 (e)          |                | 179.966                  | 9,45                              | 1,000 % fällig am                          |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 22.03.2051 (c)                                           |                | 5.317                    | 4.362 0,23                        |
| 4,300 % fällig am 01.10.2054              |                | 187.229                  | 9,83                              | 30.11.2030 (c)                             | 2.886          | 3.420                    | 0,18                              | 0,125 % fällig am 22.03.2058 (c)                                           |                | 4.179                    | 3.084 0,16                        |
| Summe Italien                             |                |                          |                                   | 3,100 % fällig am 30.07.2031               | 200            | 240                      | 0,01                              | 0,125 % fällig am 22.11.2065 (c)                                           |                | 10.571                   | 7.039 0,37                        |
| <b>JAPAN</b>                              |                |                          |                                   | 3,150 % fällig am 30.04.2033               | 228            | 272                      | 0,01                              | 0,125 % fällig am 22.03.2068 (c)                                           |                | 14.971                   | 9.716 0,51                        |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | 3,200 % fällig am 31.10.2035               | 100            | 117                      | 0,01                              | 0,125 % fällig am 22.03.2073 (c)                                           |                | 2.868                    | 2.071 0,11                        |
| Japan Government International Bond       |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 31.01.2041               | 500            | 575                      | 0,03                              | 0,250 % fällig am 22.03.2052 (c)                                           |                | 3.001                    | 2.522 0,13                        |
| 0,100 % fällig am 10.03.2026 (c)          | ¥              | 3.744.054                | 26.387 1,39                       | Summe Spanien                              |                | 36.778                   | 1,93                              | 0,375 % fällig am 22.03.2062 (c)                                           |                | 15.886                   | 12.449 0,65                       |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (c)          |                | 4.125.807                | 29.577 1,55                       | <b>SUPRANATIONAL</b>                       |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 22.03.2050 (c)                                           |                | 14.843                   | 13.877 0,73                       |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (c)          |                | 7.133.750                | 51.363 2,70                       | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>    |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 22.10.2061                                               |                | 1.340                    | 479 0,03                          |
| Summe Japan                               |                | 107.327                  | 5,64                              | Europäische Investitionsbank               | 14.200         | 16.724                   | 0,88                              | 0,625 % fällig am 22.03.2040 (c)                                           |                | 28.887                   | 33.196 1,74                       |
| <b>LUXEMBURG</b>                          |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 18.06.2035               | 1.900          | 2.222                    | 0,12                              | 0,625 % fällig am 22.11.2042 (c)                                           |                | 15.985                   | 17.580 0,92                       |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                |                          |                                   | Summe Supranational                        |                | 18.946                   | 1,00                              | 0,625 % fällig am 22.03.2045 (c)                                           |                | 11.155                   | 11.588 0,61                       |
| E-Carat DE                                |                |                          |                                   | <b>SCHWEDEN</b>                            |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 22.10.2050                                               |                | 2.400                    | 1.210 0,06                        |
| 2,321 % fällig am 25.11.2035              | €              | 3.300                    | 3.873 0,20                        | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                    |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 22.11.2033 (c)                                           |                | 10.259                   | 13.521 0,71                       |
| SC Germany S.A., Compartment Consumer     |                |                          |                                   | Sweden Government International Bond       |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 22.03.2034 (c)                                           |                | 17.482                   | 22.841 1,20                       |
| 2,564 % fällig am 14.01.2038              |                | 5.023                    | 5.908 0,31                        | 0,125 % fällig am 01.06.2026 SEK           | 119.922        | 12.368                   | 0,65                              | 0,750 % fällig am 22.11.2047 (c)                                           |                | 14.472                   | 14.987 0,79                       |
| 2,612 % fällig am 15.09.2037              |                | 4.033                    | 4.747 0,25                        | 0,125 % fällig am 01.12.2027               | 17.421         | 1.797                    | 0,09                              | 1,125 % fällig am 22.11.2037 (c)                                           |                | 23.652                   | 30.535 1,60                       |
| Summe Luxemburg                           |                | 14.528                   | 0,76                              | 0,125 % fällig am 01.06.2032               | 59.521         | 6.082                    | 0,32                              | 1,250 % fällig am 22.11.2027 (c)                                           |                | 13.874                   | 19.405 1,02                       |
| <b>MEXIKO</b>                             |                |                          |                                   | Summe Schweden                             |                | 20.247                   | 1,06                              | 1,250 % fällig am 22.11.2032 (c)                                           |                | 42.977                   | 59.586 3,13                       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | <b>GROSSBRITANNIEN</b>                     |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 22.11.2054 (c)                                           |                | 34.083                   | 37.364 1,96                       |
| Mexico Government International Bond      |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                      |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 22.07.2047                                               |                | 3.900                    | 2.776 0,15                        |
| 4,000 % fällig am                         |                |                          |                                   | Alba PLC                                   |                |                          |                                   | 1,875 % fällig am 22.09.2049 (c)                                           |                | 923                      | 1.191 0,06                        |
| 24.08.2034 (c)                            | MXN            | 6.189                    | 305 0,02                          | 4,528 % fällig am 17.03.2039               | £              | 1.250                    | 1.687 0,09                        | 2,000 % fällig am 26.01.2035                                               |                | 3.828                    | 5.590 0,29                        |
| <b>NIEDERLANDE</b>                        |                |                          |                                   | Avon Finance PLC                           |                | 4.573                    | 6.277 0,33                        | 4,000 % fällig am 22.01.2060                                               |                | 198                      | 218 0,01                          |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>   |                |                          |                                   | Brants Bridge PLC                          |                | 1.594                    | 2.189 0,11                        | 4,000 % fällig am 22.10.2063                                               |                | 198                      | 216 0,01                          |
| Globaldrive Auto Receivables BV           |                |                          |                                   | 5,139 % fällig am 14.06.2066               |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 07.12.2055                                               |                | 16.800                   | 19.533 1,03                       |
| 2,327 % fällig am 22.06.2032              | €              | 4.279                    | 5.025 0,26                        | Canada Square Funding PLC                  |                | 6.910                    | 9.488 0,50                        | 4,375 % fällig am 07.03.2030                                               |                | 69.200                   | 96.527 5,07                       |
| <b>NEUSEELAND</b>                         |                |                          |                                   | 5,161 % fällig am 17.01.2059               |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 22.10.2043                                               |                | 13.500                   | 17.690 0,93                       |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | Canterbury Finance PLC                     |                | 2.415                    | 3.314 0,17                        | Summe Großbritannien                                                       |                | 675.562                  | 35,48                             |
| New Zealand Government International Bond |                |                          |                                   | 5,073 % fällig am 16.05.2058               |                |                          |                                   | <b>USA</b>                                                                 |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025              | NZD            | 40.913                   | 45.693 2,40                       | Economic Master Issuer PLC                 |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                    |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 20.09.2030              |                | 31                       | 36 0,00                           | 0,000 % fällig am                          |                |                          |                                   | Accredited Mortgage Loan Trust                                             |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.05.2036              |                | 7.800                    | 4.581 0,24                        | 25.04.2075 (a)                             | 6.800          | 9.323                    | 0,49                              | 4,694 % fällig am 25.09.2036                                               | \$             | 527                      | 525 0,03                          |
| Summe Neuseeland                          |                | 50.310                   | 2,64                              | Hadrian Funding PLC                        |                | 7.200                    | 9.872 0,52                        | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                |                | 880                      | 903 0,05                          |
| <b>PERU</b>                               |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am                          |                |                          |                                   | Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | 20.05.2072 (a)                             |                |                          |                                   | 5,394 % fällig am 25.10.2035                                               |                | 1.678                    | 1.609 0,08                        |
| Peru Government International Bond        |                |                          |                                   | Harbour Plc                                |                | 5.629                    | 7.717 0,40                        | Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust                   |                | 7                        | 7 0,00                            |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029              | PEN            | 1.200                    | 355 0,02                          | Hops Hill PLC                              |                | 3.800                    | 5.211 0,27                        | Asset-Backed Funding Certificates Trust                                    |                | 5.036                    | 4.642 0,24                        |
| <b>RUMÄNIEN</b>                           |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am                          |                |                          |                                   | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust                       |                | 97                       | 97 0,01                           |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | 21.06.2056 (a)                             |                |                          |                                   | Carrington Mortgage Loan Trust                                             |                | 10.146                   | 9.364 0,49                        |
| Romania Government International Bond     |                |                          |                                   | London Wall Mortgage Capital PLC           |                | 1.527                    | 2.094 0,11                        | 4,684 % fällig am 25.04.2036                                               |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 24.09.2031              | €              | 3.100                    | 3.597 0,19                        | 5,037 % fällig am 15.05.2052               |                |                          |                                   | Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates       |                | 430                      | 419 0,02                          |
| <b>RUSSLAND</b>                           |                |                          |                                   | Polaris PLC                                |                | 2.037                    | 2.792 0,15                        | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                        |                | 296                      | 288 0,02                          |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | 5,024 % fällig am 23.10.2059               |                | 5.471                    | 7.503 0,39                        | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                          |                | 3.724                    | 3.639 0,19                        |
| 5,125 % fällig am 24.09.2031              | €              | 3.100                    | 3.597 0,19                        | RMAC PLC                                   |                | 3.673                    | 5.052 0,27                        | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                       |                | 1                        | 1 0,00                            |
| <b>USA</b>                                |                |                          |                                   | Rochester Financing PLC                    |                | 3.966                    | 5.432 0,29                        | 4,562 % fällig am 25.01.2032                                               |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                   |                |                          |                                   | Silverstone Master Issuer PLC              |                | 7.200                    | 9.875 0,52                        | Ellington Loan Acquisition Trust                                           |                | 538                      | 527 0,03                          |
| 5,125 % fällig am 24.09.2031              | €              | 3.100                    | 3.597 0,19                        | 4,798 % fällig am 21.01.2070               |                | 3.600                    | 4.938 0,26                        |                                                                            |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|
| Encore Credit Receivables Trust                                    |                |                          |                                        |
| 5,334 % fällig am 25.01.2036                                       | \$ 1.318       | \$ 1.291                 | 0,07                                   |
| First Franklin Mortgage Loan Trust                                 |                |                          |                                        |
| 4,744 % fällig am 25.07.2036                                       | 653            | 638                      | 0,03                                   |
| 5,304 % fällig am 25.09.2035                                       | 341            | 339                      | 0,02                                   |
| Home Equity Asset Trust                                            |                |                          |                                        |
| 5,289 % fällig am 25.08.2034                                       | 34             | 34                       | 0,00                                   |
| Lehman XS Trust                                                    |                |                          |                                        |
| 6,734 % fällig am 25.12.2037                                       | 1.305          | 1.273                    | 0,07                                   |
| Massachusetts Educational Financing Authority                      |                |                          |                                        |
| 5,575 % fällig am 25.04.2038                                       | 19             | 19                       | 0,00                                   |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                             |                |                          |                                        |
| 5,094 % fällig am 25.01.2035                                       | 1.055          | 1.022                    | 0,05                                   |
| New Century Home Equity Loan Trust                                 |                |                          |                                        |
| 5,154 % fällig am 25.10.2035                                       | 341            | 335                      | 0,02                                   |
| 5,199 % fällig am 25.02.2035                                       | 1.645          | 1.593                    | 0,08                                   |
| Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust               |                |                          |                                        |
| 4,869 % fällig am 25.03.2036                                       | 223            | 223                      | 0,01                                   |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                        |
| 5,229 % fällig am 25.07.2035                                       | 1              | 1                        | 0,00                                   |
| Saxon Asset Securities Trust                                       |                |                          |                                        |
| 1,814 % fällig am 25.05.2035                                       | 2.157          | 2.087                    | 0,11                                   |
| 4,744 % fällig am 25.09.2037                                       | 580            | 558                      | 0,03                                   |
|                                                                    |                | 31.434                   | 1,65                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                                   |                |                          |                                        |
| Lehman Brothers Holdings, Inc.                                     |                |                          |                                        |
| 0,000 % fällig am 05.03.2010 ^                                     | € 950          | 5                        | 0,00                                   |
| 0,000 % fällig am 05.04.2011 ^                                     | 10             | 0                        | 0,00                                   |
|                                                                    |                | 5                        | 0,00                                   |
| NON-AGENCY-MBS                                                     |                |                          |                                        |
| Banc of America Funding Trust                                      |                |                          |                                        |
| 4,521 % fällig am 20.01.2047                                       | \$ 842         | 727                      | 0,04                                   |
| Bear Stearns ALT-A Trust                                           |                |                          |                                        |
| 4,905 % fällig am 25.09.2035                                       | 49             | 28                       | 0,00                                   |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                |                |                          |                                        |
| 4,783 % fällig am 25.09.2037                                       | 167            | 154                      | 0,01                                   |
| 5,830 % fällig am 25.09.2035                                       | 1              | 1                        | 0,00                                   |
| Countrywide Alternative Loan Trust                                 |                |                          |                                        |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037                                       | 698            | 587                      | 0,03                                   |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                        |                |                          |                                        |
| 2,241 % fällig am 30.11.2037                                       | 901            | 824                      | 0,04                                   |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust              |                |                          |                                        |
| 5,012 % fällig am 19.10.2045                                       | 2.228          | 2.043                    | 0,11                                   |
| GreenPoint Mortgage Funding Trust                                  |                |                          |                                        |
| 4,874 % fällig am 25.06.2045                                       | 38             | 35                       | 0,00                                   |
| GSR Mortgage Loan Trust                                            |                |                          |                                        |
| 5,293 % fällig am 25.09.2035                                       | 34             | 33                       | 0,00                                   |
| Impac CMB Trust                                                    |                |                          |                                        |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                                       | 816            | 788                      | 0,04                                   |
| JPMorgan Mortgage Trust                                            |                |                          |                                        |
| 5,823 % fällig am 25.07.2035                                       | 123            | 119                      | 0,01                                   |
| Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust       |                |                          |                                        |
| 5,137 % fällig am 20.10.2029                                       | 5              | 5                        | 0,00                                   |
| 5,286 % fällig am 15.08.2032                                       | 71             | 70                       | 0,00                                   |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                             |                |                          |                                        |
| 5,124 % fällig am 25.08.2036                                       | 2.407          | 2.399                    | 0,13                                   |
| OBX Trust                                                          |                |                          |                                        |
| 5,084 % fällig am 25.06.2057                                       | 105            | 103                      | 0,01                                   |

| BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|
| Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                        |
| 6,234 % fällig am 25.04.2035                                            | \$ 820         | \$ 811                   | 0,04                                   |
| Sequoia Mortgage Trust                                                  |                |                          |                                        |
| 5,132 % fällig am 19.10.2026                                            | 3              | 2                        | 0,00                                   |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                          |                |                          |                                        |
| 4,335 % fällig am 25.08.2047                                            | 1.275          | 1.192                    | 0,06                                   |
| 5,409 % fällig am 25.09.2034                                            | 221            | 212                      | 0,01                                   |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                   |                |                          |                                        |
| 4,784 % fällig am 25.03.2035                                            | 158            | 142                      | 0,01                                   |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                           |                |                          |                                        |
| 4,974 % fällig am 25.12.2045                                            | 14             | 14                       | 0,00                                   |
|                                                                         |                | 10.289                   | 0,54                                   |
| US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                                                   |                |                          |                                        |
| Fannie Mae                                                              |                |                          |                                        |
| 5,697 % fällig am 01.09.2044 - 01.10.2044                               | 14             | 15                       | 0,00                                   |
| 6,633 % fällig am 01.12.2030                                            | 0              | 1                        | 0,00                                   |
| Freddie Mac                                                             |                |                          |                                        |
| 4,694 % fällig am 25.08.2031                                            | 2              | 2                        | 0,00                                   |
| 4,700 % fällig am 25.09.2031                                            | 3              | 3                        | 0,00                                   |
| 5,018 % fällig am 15.12.2037                                            | 97             | 97                       | 0,01                                   |
| 5,599 % fällig am 25.10.2044                                            | 163            | 149                      | 0,01                                   |
| 6,564 % fällig am 01.07.2036                                            | 32             | 33                       | 0,00                                   |
| 6,901 % fällig am 01.10.2036                                            | 11             | 11                       | 0,00                                   |
| 7,195 % fällig am 01.09.2036                                            | 11             | 11                       | 0,00                                   |
| Ginnie Mae                                                              |                |                          |                                        |
| 3,500 % fällig am 20.06.2052                                            | 43.027         | 39.279                   | 2,06                                   |
| 4,875 % fällig am 20.04.2030 - 20.05.2030                               | 2              | 1                        | 0,00                                   |
| 5,000 % fällig am 20.05.2030 - 20.06.2030                               | 1              | 2                        | 0,00                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

| Beschreibung                                           | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month EURIBOR September Futures                      | Long  | 09.2026     | 813                  | \$ 409                                    | 0,02                 |
| Australia Government 3-Year Note September Futures     | Short | 09.2025     | 205                  | (52)                                      | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures    | Long  | 09.2025     | 34                   | 21                                        | 0,00                 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures       | Long  | 09.2025     | 16                   | 13                                        | 0,00                 |
| Euro-Bobl September Futures                            | Short | 09.2025     | 46                   | 29                                        | 0,00                 |
| Euro-BTP September Futures                             | Long  | 09.2025     | 177                  | 55                                        | 0,00                 |
| Euro-Bund September Futures                            | Short | 09.2025     | 155                  | 146                                       | 0,01                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures               | Short | 09.2025     | 71                   | 187                                       | 0,01                 |
| Euro-OAT September Futures                             | Short | 09.2025     | 10                   | 12                                        | 0,00                 |
| Euro-Schatz September Futures                          | Short | 09.2025     | 1.132                | 219                                       | 0,01                 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures        | Long  | 09.2025     | 4                    | 11                                        | 0,00                 |
| Short Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 162                  | (46)                                      | 0,00                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures            | Short | 09.2025     | 704                  | (553)                                     | (0,03)               |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 628                  | 742                                       | 0,04                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures           | Short | 09.2025     | 1.036                | (1.948)                                   | (0,10)               |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures          | Short | 09.2025     | 105                  | (195)                                     | (0,01)               |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures         | Long  | 09.2025     | 96                   | 270                                       | 0,01                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures   | Short | 09.2025     | 55                   | (156)                                     | (0,01)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures             | Short | 09.2025     | 114                  | (253)                                     | (0,01)               |
|                                                        |       |             |                      | \$ (1.368)                                | (0,07)               |

### OPTIONSKAUF

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|--------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,938      | 15.12.2025    | 551                  | \$ 275 | \$ 24     | 0,00                 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                            | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------|-----------|----------------------|
| Put - ICE Euribor December 2025 Futures | € 97,813      | 12.12.2025    | 551                  | \$ (368) | \$ (105)  | (0,01)               |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

\$ (1.449) (0,08)

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|-------------|-------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 15.000    | \$ 76                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2027       | 9.111       | (6)                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2055       | 10.700      | 456                                       | 0,02                 |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 16.06.2029       | ¥ 5.177.000 | 191                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,237           | 21.11.2053       | \$ 22.000   | 6.109                                     | 0,32                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,865           | 13.02.2054       | \$ 13.500   | 2.223                                     | 0,12                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,620           | 30.11.2029       | 152.340     | (1.414)                                   | (0,07)               |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,701           | 15.11.2034       | 64.400      | 216                                       | 0,01                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,900           | 15.02.2035       | 5.504       | (100)                                     | (0,01)               |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,100           | 15.11.2052       | 38.750      | (827)                                     | (0,04)               |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,700           | 15.02.2026       | 42.950      | (17)                                      | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR               | 1,830           | 17.09.2027       | € 26.300    | 96                                        | 0,01                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,000           | 17.09.2027       | 138.000     | 50                                        | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,112           | 02.09.2027       | 14.800      | (40)                                      | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,120           | 03.09.2027       | 31.200      | (91)                                      | (0,01)               |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2035       | 151.540     | 210                                       | 0,01                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2055       | 50.810      | 3.374                                     | 0,18                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                           | 1,529           | 15.05.2027       | 14.400      | 37                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                           | 2,359           | 15.08.2030       | 25.700      | 113                                       | 0,01                 |
| Zahlung                                     | CPTFEMU                           | 2,680           | 15.04.2053       | 4.400       | 638                                       | 0,03                 |
| Erhalt                                      | CPTFEMU                           | 2,720           | 15.06.2032       | 61.100      | (1.916)                                   | (0,10)               |
| Zahlung                                     | CPURNSA                           | 1,760           | 04.11.2029       | \$ 23.300   | (4.037)                                   | (0,21)               |
| Zahlung                                     | CPURNSA                           | 1,883           | 20.11.2029       | 300         | (49)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                     | CPURNSA                           | 1,954           | 03.06.2029       | 6.200       | (958)                                     | (0,05)               |
| Zahlung                                     | CPURNSA                           | 1,998           | 25.07.2029       | 1.800       | (266)                                     | (0,01)               |
| Zahlung                                     | CPURNSA                           | 2,364           | 10.05.2028       | 800         | (86)                                      | (0,01)               |
| Zahlung                                     | CPURNSA                           | 2,370           | 06.06.2028       | 12.900      | (1.393)                                   | (0,07)               |
| Zahlung                                     | CPURNSA                           | 2,379           | 09.07.2028       | 700         | (74)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                      | CPURNSA                           | 2,573           | 26.08.2028       | 2.200       | 174                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | CPURNSA                           | 2,645           | 10.09.2028       | 3.600       | 255                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                      | CPURNSA                           | 2,690           | 01.06.2026       | 2.300       | 227                                       | 0,01                 |



| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler<br>Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------|----------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Zahlung                                        | CPURNSA                    | 2,820 %         | 05.02.2026       | \$ 3.900   | \$ (12)                                         | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                    | 2,842           | 13.02.2026       | 4.100      | (11)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                                        | CPURNSA                    | 3,043           | 21.02.2026       | 10.700     | (7)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                      | 3,500           | 15.08.2034       | £ 25.400   | 770                                             | 0,04                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                      | 4,040           | 15.04.2029       | 11.500     | 371                                             | 0,02                    |
| Zahlung                                        | UKRPI                      | 4,143           | 15.10.2032       | 7.800      | 13                                              | 0,00                    |
| Erhalt                                         | UKRPI                      | 4,615           | 15.02.2027       | 15.600     | 576                                             | 0,03                    |
|                                                |                            |                 |                  |            | \$ 4.871                                        | 0,26                    |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                            |                 |                  |            | \$ 4.871                                        | 0,26                    |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------|--------------------|--------------------|---------------------------|--------|-----------|-------------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 6-Month GBP-SONIA          | Zahlung                              | 3,650 %            | 04.12.2025         | 218.300                   | \$ 492 | \$ 699    | 0,04                    |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung      | Anfänglicher<br>Index | Variabler Zinssatz                                         | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|-------------------------|
| GLM        | Cap - OTC CPALEMU | \$100,151             | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035    | 7.800                     | \$ (356) | \$ (213)  | (0,01)                  |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert  | % des<br>Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------|--------------------|---------------|---------------------------|------------|------------|-------------------------|
| BRC        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,440 %            | 25.01.2027    | 7.400                     | \$ (66)    | \$ (73)    | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,440              | 25.01.2027    | 7.400                     | (66)       | (46)       | 0,00                    |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,740              | 08.09.2025    | 8.000                     | (185)      | (155)      | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,740              | 08.09.2025    | 8.000                     | (185)      | (53)       | 0,00                    |
| GLM        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,350              | 07.01.2027    | 24.700                    | (225)      | (222)      | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,350              | 07.01.2027    | 24.700                    | (225)      | (174)      | (0,01)                  |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,465              | 04.12.2025    | 17.700                    | (213)      | (191)      | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,465              | 04.12.2025    | 17.700                    | (213)      | (11)       | 0,00                    |
| MYC        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                               | 2,500              | 14.01.2027    | 50.400                    | (461)      | (553)      | (0,03)                  |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap   | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                              | 2,500              | 14.01.2027    | 50.400                    | (462)      | (292)      | (0,02)                  |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 6-Month GBP-SONIA       | Erhalt                               | 3,150              | 04.12.2025    | 218.300                   | (161)      | (191)      | (0,01)                  |
|            | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap   | 6-Month GBP-SONIA       | Zahlung                              | 4,000              | 15.08.2025    | 63.500                    | (464)      | (58)       | 0,00                    |
|            |                                       |                         |                                      |                    |               |                           | \$ (2.926) | \$ (2.019) | (0,11)                  |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|------------|----------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-------------------------|
| GST        | CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500 %                        | 17.10.2057       | \$ 222                    | \$ (12)                                      | \$ 12                                           | \$ 0      | 0,00                    |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                          | 17.08.2061       | 2.500                     | (5)                                          | 18                                              | 13        | 0,00                    |
|            |                      |                                |                  |                           |                                              | \$ (17)                                         | \$ 30     | 0,00                    |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

## DEISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende |           | Zu erhaltende |            | Nicht realisierte |         | Nicht realisierte |         | Nicht realisierte           |                      |        |
|------------|------------------|-------------|-----------|---------------|------------|-------------------|---------|-------------------|---------|-----------------------------|----------------------|--------|
|            |                  | Währung     |           | Währung       |            | Wertzunahme       |         | (Wertabnahme)     |         | Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |        |
| AZD        | 07.2025          | CAD         | 12        | \$            | 9          | \$                | 0       | \$                | 0       | \$                          | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | CNH         | 10.645    |               | 1.478      |                   | 0       |                   | (10)    |                             | (10)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | €           | 8.830     |               | 10.339     |                   | 0       |                   | (26)    |                             | (26)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$          | 72.067    | AUD           | 110.940    | 638               | 0       |                   | 638     |                             | 638                  | 0,03   |
|            | 07.2025          |             | 109       | €             | 96         |                   | 4       |                   | 0       |                             | 4                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 50.746    | NZD           | 84.324     | 443               | 0       |                   | 443     |                             | 443                  | 0,02   |
|            | 08.2025          | AUD         | 110.940   | \$            | 72.109     |                   | 0       | (642)             |         | (642)                       |                      | (0,03) |
|            | 08.2025          | CNH         | 28.460    |               | 3.971      |                   | 0       |                   | (17)    |                             | (17)                 | 0,00   |
|            | 08.2025          | NZD         | 84.324    |               | 50.802     |                   | 0       | (443)             |         | (443)                       |                      | (0,02) |
|            | 08.2025          | \$          | 9         | CAD           | 12         |                   | 0       |                   | 0       |                             | 0                    | 0,00   |
|            | 08.2025          |             | 10.362    | €             | 8.830      |                   | 26      |                   | 0       |                             | 26                   | 0,00   |
|            | BOA              | 07.2025     | AUD       | 1.033         | \$         | 673               |         | 0                 |         | (4)                         |                      | (4)    |
| 07.2025    |                  | DKK         | 8.406     |               | 1.280      |                   | 0       |                   | (43)    |                             | (43)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | €           | 460.539   |               | 523.656    |                   | 0       | (16.949)          |         | (16.949)                    |                      | (0,89) |
| 07.2025    |                  | KRW         | 1.881.729 |               | 1.380      |                   | 0       |                   | (11)    |                             | (11)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | SEK         | 32.580    |               | 3.396      |                   | 0       |                   | (23)    |                             | (23)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | \$          | 1.219     | IDR           | 19.884.080 | 6                 | 0       |                   | 6       |                             | 6                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |             | 515       | SGD           | 659        |                   | 3       |                   | 0       |                             | 3                    | 0,00   |
| 08.2025    |                  | CNH         | 7.261     | \$            | 1.015      |                   | 0       |                   | (3)     |                             | (3)                  | 0,00   |
| 08.2025    |                  | SGD         | 657       |               | 515        |                   | 0       |                   | (3)     |                             | (3)                  | 0,00   |
| 08.2025    |                  | TWD         | 456       |               | 14         |                   | 0       |                   | (2)     |                             | (2)                  | 0,00   |
| 07.2025    |                  | BRL         | 200       |               | 35         |                   | 0       |                   | (2)     |                             | (2)                  | 0,00   |
| BPS        |                  | 07.2025     | £         | 599           |            | 808               |         | 0                 |         | (13)                        |                      | (13)   |
|            | 07.2025          | KRW         | 15.046    |               | 11         |                   | 0       |                   | 0       |                             | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | NOK         | 2.925     |               | 289        |                   | 0       |                   | 0       |                             | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | SEK         | 4.100     |               | 427        |                   | 0       |                   | (3)     |                             | (3)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          | THB         | 1.445     |               | 44         |                   | 0       |                   | (1)     |                             | (1)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD         | 90.282    |               | 2.778      |                   | 0       | (330)             |         | (330)                       |                      | (0,02) |
|            | 07.2025          | \$          | 1.220     | BRL           | 6.791      | 24                | 0       |                   | 24      |                             | 24                   | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 108       | €             | 94         |                   | 2       |                   | 0       |                             | 2                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 2.558     | IDR           | 41.728.880 | 12                | 0       |                   | 12      |                             | 12                   | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 4.014     | ¥             | 577.900    |                   | 0       | (13)              |         | (13)                        |                      | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 3.529     | SEK           | 33.810     | 19                | 0       |                   | 19      |                             | 19                   | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 180       | THB           | 5.896      | 2                 | 0       |                   | 2       |                             | 2                    | 0,00   |
| BRC        | 07.2025          |             | 689       | TWD           | 20.513     | 16                | 0       |                   | 16      |                             | 16                   | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH         | 15.772    | \$            | 2.208      |                   | 0       |                   | (2)     |                             | (2)                  | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD         | 74.894    |               | 2.298      |                   | 0       | (306)             |         | (306)                       |                      | (0,02) |
|            | 08.2025          | \$          | 1.448     | INR           | 125.817    | 16                | 0       |                   | 16      |                             | 16                   | 0,00   |
|            | 08.2025          |             | 3.953     | TWD           | 114.963    | 43                | 0       |                   | 43      |                             | 43                   | 0,00   |
|            | 07.2025          | AUD         | 253       | \$            | 163        |                   | 0       |                   | (2)     |                             | (2)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          | £           | 1.850     |               | 2.498      |                   | 0       | (37)              |         | (37)                        |                      | 0,00   |
|            | 07.2025          | ILS         | 13.330    |               | 3.829      |                   | 0       | (130)             |         | (130)                       |                      | (0,01) |
|            | 07.2025          | KRW         | 209.901   |               | 154        |                   | 0       |                   | (2)     |                             | (2)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          | NOK         | 2.259     |               | 222        |                   | 0       |                   | (1)     |                             | (1)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          | PLN         | 638       |               | 170        |                   | 0       |                   | (6)     |                             | (6)                  | 0,00   |
|            | CBK              | 07.2025     | \$        | 1.035         | €          | 911               | 35      | 0                 |         | 35                          |                      | 35     |
| 07.2025    |                  |             | 323.455   | £             | 237.728    | 2.316             | 0       |                   | 2.316   |                             | 2.316                | 0,12   |
| 07.2025    |                  |             | 1.899     | ILS           | 6.410      | 5                 | 0       |                   | 5       |                             | 5                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |             | 36        | KRW           | 49.571     | 1                 | 0       |                   | 1       |                             | 1                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |             | 1.776     | ZAR           | 32.099     | 28                | 0       |                   | 28      |                             | 28                   | 0,00   |
| 08.2025    |                  | £           | 237.728   | \$            | 323.499    | 0                 | (2.319) |                   | (2.319) |                             | (2.319)              | (0,12) |
| 09.2025    |                  | PEN         | 5.220     |               | 1.429      | 0                 | (39)    |                   | (39)    |                             | (39)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | CAD         | 25        |               | 18         | 0                 | 0       |                   | 0       |                             | 0                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  | DKK         | 493.592   |               | 75.176     | 0                 | (2.484) |                   | (2.484) |                             | (2.484)              | (0,13) |
| 07.2025    |                  | £           | 6.558     |               | 8.788      | 0                 | (199)   |                   | (199)   |                             | (199)                | (0,01) |
| 07.2025    |                  | ¥           | 290.700   |               | 2.042      | 29                | 0       |                   | 29      |                             | 29                   | 0,00   |
| DUB        |                  | 07.2025     | KRW       | 12.806.732    |            | 9.345             | 0       | (124)             |         | (124)                       |                      | (124)  |
|            | 07.2025          | SEK         | 10.800    |               | 1.138      | 4                 | 0       |                   | 4       |                             | 4                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | THB         | 75.624    |               | 2.274      | 0                 | (55)    |                   | (55)    |                             | (55)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          | TWD         | 156.624   |               | 4.814      | 0                 | (578)   |                   | (578)   |                             | (578)                | (0,03) |
|            | 07.2025          | \$          | 2.297     | CNY           | 16.467     | 2                 | 0       |                   | 2       |                             | 2                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 1.764     | IDR           | 28.719.442 | 5                 | 0       |                   | 5       |                             | 5                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 31.649    | SEK           | 301.179    | 69                | (116)   |                   | (47)    |                             | (47)                 | 0,00   |
|            | 07.2025          |             | 1.185     | TWD           | 35.113     | 24                | 0       |                   | 24      |                             | 24                   | 0,00   |
|            | 08.2025          | CNH         | 3.389     | \$            | 471        | 0                 | (3)     |                   | (3)     |                             | (3)                  | 0,00   |
|            | 08.2025          | SEK         | 198.675   |               | 21.007     | 116               | 0       |                   | 116     |                             | 116                  | 0,01   |
|            | 08.2025          | TWD         | 171.654   |               | 5.267      | 0                 | (699)   |                   | (699)   |                             | (699)                | (0,04) |
|            | FAR              | 08.2025     | \$        | 10.839        | INR        | 934.214           | 35      | (7)               |         | 28                          |                      | 28     |
| 09.2025    |                  | MXN         | 5.334     | \$            | 278        | 0                 | (2)     |                   | (2)     |                             | (2)                  | 0,00   |
| 12.2025    |                  | PEN         | 1.508     |               | 407        | 0                 | (16)    |                   | (16)    |                             | (16)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | AUD         | 493       |               | 317        | 0                 | (6)     |                   | (6)     |                             | (6)                  | 0,00   |
| 07.2025    |                  | ILS         | 6.473     |               | 1.868      | 0                 | (55)    |                   | (55)    |                             | (55)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | KRW         | 218.179   |               | 160        | 0                 | (1)     |                   | (1)     |                             | (1)                  | 0,00   |
| 07.2025    |                  | SGD         | 68        |               | 53         | 0                 | (1)     |                   | (1)     |                             | (1)                  | 0,00   |
| 07.2025    |                  | \$          | 33.425    | DKK           | 212.859    | 66                | 0       |                   | 66      |                             | 66                   | 0,00   |
| 07.2025    |                  |             | 535.790   | €             | 461.848    | 6.351             | 0       |                   | 6.351   |                             | 6.351                | 0,33   |
| 07.2025    |                  |             | 150       | IDR           | 2.444.491  | 0                 | 0       |                   | 0       |                             | 0                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |             | 254       | TWD           | 7.563      | 6                 | 0       |                   | 6       |                             | 6                    | 0,00   |
| 08.2025    |                  | DKK         | 212.342   | \$            | 33.425     | 0                 | (66)    |                   | (66)    |                             | (66)                 | 0,00   |
| 08.2025    | €                | 460.836     |           | 535.790       | 0          | (6.343)           |         | (6.343)           |         | (6.343)                     | (0,33)               |        |
| 08.2025    | \$               | 5.024       | INR       | 433.520       | 21         | (2)               |         | 19                |         | 19                          | 0,00                 |        |
| 09.2025    | MXN              | 78          | \$        | 4             | 0          | 0                 |         | 0                 |         | 0                           | 0,00                 |        |
| 07.2025    | AUD              | 109.161     |           | 70.430        | 0          | (1.108)           |         | (1.108)           |         | (1.108)                     | (0,06)               |        |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung |            | Zu erhaltende<br>Währung |            | Nicht realisierte<br>Wertzunahme |     | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) |       | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) |       | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|------------|--------------------------|------------|----------------------------------|-----|------------------------------------|-------|------------------------------------------------------|-------|-------------------------|
| GLM        | 07.2025          | CHF                    | 3.946      | \$                       | 4.792      | \$                               | 0   | \$                                 | (165) | \$                                                   | (165) | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH                    | 5.415      |                          | 754        |                                  | 0   |                                    | (3)   |                                                      | (3)   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 13.756.613 |                          | 95.893     |                                  | 655 |                                    | 0     |                                                      | 655   | 0,03                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 171        |                          | 133        |                                  | 0   |                                    | (1)   |                                                      | (1)   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 16.220     | BRL                      | 92.736     |                                  | 771 |                                    | 0     |                                                      | 771   | 0,04                    |
|            | 07.2025          |                        | 5.189      | CHF                      | 4.154      |                                  | 30  |                                    | 0     |                                                      | 30    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 45.461     | DKK                      | 289.311    |                                  | 58  |                                    | 0     |                                                      | 58    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 55.026     | ¥                        | 8.009.554  |                                  | 425 |                                    | 0     |                                                      | 425   | 0,02                    |
|            | 07.2025          |                        | 4.678      | PLN                      | 17.254     |                                  | 94  |                                    | 0     |                                                      | 94    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 414        | SGD                      | 528        |                                  | 1   |                                    | 0     |                                                      | 1     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 4.137      | \$                       | 5.189      |                                  | 0   |                                    | (30)  |                                                      | (30)  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 16.647     |                          | 2.326      |                                  | 0   |                                    | (6)   |                                                      | (6)   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 288.602    |                          | 45.461     |                                  | 0   |                                    | (58)  |                                                      | (58)  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 7.980.099  |                          | 55.026     |                                  | 0   |                                    | (425) |                                                      | (425) | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | SGD                    | 526        |                          | 414        |                                  | 0   |                                    | (1)   |                                                      | (1)   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.401      | INR                      | 207.630    |                                  | 14  |                                    | 0     |                                                      | 14    | 0,00                    |
|            | 09.2025          |                        | 3.360      | MXN                      | 65.417     |                                  | 75  |                                    | 0     |                                                      | 75    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 99.515     | \$                       | 18.053     |                                  | 0   |                                    | (181) |                                                      | (181) | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | TWD                    | 15.569     |                          | 479        |                                  | 0   |                                    | (57)  |                                                      | (57)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 418        | IDR                      | 6.812.385  |                                  | 1   |                                    | 0     |                                                      | 1     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 161        | SGD                      | 205        |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 75         | TWD                      | 2.434      |                                  | 9   |                                    | 0     |                                                      | 9     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 204        | \$                       | 161        |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 122        | TWD                      | 3.996      |                                  | 17  |                                    | 0     |                                                      | 17    | 0,00                    |
| JPM        | 10.2025          |                        | 18.053     | BRL                      | 101.793    |                                  | 173 |                                    | 0     |                                                      | 173   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | CHF                    | 213        | \$                       | 260        |                                  | 0   |                                    | (8)   |                                                      | (8)   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 10.260     |                          | 1.422      |                                  | 0   |                                    | (12)  |                                                      | (12)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 31.042     |                          | 41.819     |                                  | 0   |                                    | (719) |                                                      | (719) | (0,04)                  |
|            | 07.2025          | KRW                    | 1.201.925  |                          | 878        |                                  | 0   |                                    | (10)  |                                                      | (10)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 6.856      |                          | 1.826      |                                  | 0   |                                    | (71)  |                                                      | (71)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 4.541      |                          | 3.535      |                                  | 0   |                                    | (30)  |                                                      | (30)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 91.385     |                          | 2.810      |                                  | 0   |                                    | (336) |                                                      | (336) | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 8.419      | PLN                      | 31.118     |                                  | 189 |                                    | 0     |                                                      | 189   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 337        | SGD                      | 431        |                                  | 2   |                                    | 0     |                                                      | 2     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 509        | ZAR                      | 9.101      |                                  | 2   |                                    | 0     |                                                      | 2     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 26.611     | \$                       | 3.710      |                                  | 0   |                                    | (19)  |                                                      | (19)  | 0,00                    |
| MBC        | 08.2025          | SGD                    | 430        |                          | 337        |                                  | 0   |                                    | (2)   |                                                      | (2)   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 89.095     |                          | 2.734      |                                  | 0   |                                    | (363) |                                                      | (363) | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.618      | INR                      | 140.326    |                                  | 14  |                                    | 0     |                                                      | 14    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.933      | TWD                      | 57.254     |                                  | 57  |                                    | 0     |                                                      | 57    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 57.672     | \$                       | 41.990     |                                  | 0   |                                    | (276) |                                                      | (276) | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH                    | 4.918      |                          | 683        |                                  | 0   |                                    | (5)   |                                                      | (5)   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 628.335    |                          | 4.373      |                                  | 23  |                                    | 0     |                                                      | 23    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 4.902      |                          | 1.309      |                                  | 0   |                                    | (47)  |                                                      | (47)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 10.909     |                          | 8.504      |                                  | 0   |                                    | (62)  |                                                      | (62)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 37.962     |                          | 1.147      |                                  | 0   |                                    | (22)  |                                                      | (22)  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 43.823     |                          | 1.345      |                                  | 0   |                                    | (164) |                                                      | (164) | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 41.989     | CAD                      | 57.718     |                                  | 311 |                                    | 0     |                                                      | 311   | 0,02                    |
| MYI        | 07.2025          |                        | 17.685     | €                        | 15.145     |                                  | 93  |                                    | 0     |                                                      | 93    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 9.707      | £                        | 7.164      |                                  | 110 |                                    | 0     |                                                      | 110   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 437        | IDR                      | 7.098.523  |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 8.890      | SGD                      | 11.496     |                                  | 136 |                                    | 0     |                                                      | 136   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 50         | TWD                      | 1.492      |                                  | 1   |                                    | 0     |                                                      | 1     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 57.621     | \$                       | 41.989     |                                  | 0   |                                    | (312) |                                                      | (312) | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | CNH                    | 13.618     |                          | 1.894      |                                  | 0   |                                    | (15)  |                                                      | (15)  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 11.470     |                          | 8.890      |                                  | 0   |                                    | (138) |                                                      | (138) | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | TWD                    | 66.983     |                          | 2.067      |                                  | 0   |                                    | (261) |                                                      | (261) | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 753.738    |                          | 5.220      |                                  | 2   |                                    | 0     |                                                      | 2     | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 739        | €                        | 631        |                                  | 2   |                                    | 0     |                                                      | 2     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 464        | £                        | 338        |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
| RYL<br>SCX | 07.2025          |                        | 17.382     | ¥                        | 2.535.044  |                                  | 168 |                                    | 0     |                                                      | 168   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 575        | NOK                      | 5.800      |                                  | 0   |                                    | (2)   |                                                      | (2)   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 24         | PLN                      | 90         |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 16.968     | \$                       | 2.370      |                                  | 0   |                                    | (8)   |                                                      | (8)   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 2.525.725  |                          | 17.382     |                                  | 0   |                                    | (168) |                                                      | (168) | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | NOK                    | 5.799      |                          | 575        |                                  | 2   |                                    | 0     |                                                      | 2     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 3.069      | ¥                        | 441.350    |                                  | 0   |                                    | (2)   |                                                      | (2)   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 3.419      | SEK                      | 32.810     |                                  | 24  |                                    | 0     |                                                      | 24    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNY                    | 16.505     | \$                       | 2.304      |                                  | 1   |                                    | 0     |                                                      | 1     | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 98         |                          | 28         |                                  | 0   |                                    | (1)   |                                                      | (1)   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 83.915     |                          | 581        |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 4.736      |                          | 163        |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | \$                     | 24.621     | £                        | 18.098     |                                  | 179 |                                    | 0     |                                                      | 179   | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.944      | IDR                      | 31.682.195 |                                  | 7   |                                    | 0     |                                                      | 7     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.775      | SGD                      | 2.290      |                                  | 23  |                                    | 0     |                                                      | 23    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 408        | TWD                      | 12.125     |                                  | 9   |                                    | 0     |                                                      | 9     | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 29.233     | \$                       | 4.092      |                                  | 0   |                                    | (4)   |                                                      | (4)   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 2.285      |                          | 1.775      |                                  | 0   |                                    | (23)  |                                                      | (23)  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 24.583     |                          | 753        |                                  | 0   |                                    | (101) |                                                      | (101) | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 2.304      | CNY                      | 16.460     |                                  | 1   |                                    | 0     |                                                      | 1     | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.694      | INR                      | 145.458    |                                  | 0   |                                    | (2)   |                                                      | (2)   | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 581        | ¥                        | 83.606     |                                  | 0   |                                    | 0     |                                                      | 0     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 292        | €                        | 253        |                                  | 6   |                                    | 0     |                                                      | 6     | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.564      | ¥                        | 370.171    |                                  | 0   |                                    | (2)   |                                                      | (2)   | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| SSB        | 07.2025          | \$                  | 60                    | NOK                           | 604                             | \$ 0                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 368.812               | \$                            | 2.564                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 604                   |                               | 60                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 10                    | INR                           | 838                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 468.258               | \$                            | 634.030                         | (7.647)                                        | (0,40)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 5.337                 | €                             | 4.602                           | 65                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 336.379               | £                             | 245.318                         | (208)                                          | (0,01)               |
| UAG        | 08.2025          | £                   | 245.318               | \$                            | 336.422                         | 203                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 980                   |                               | 273                             | (18)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 202.765               |                               | 1.401                           | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 186.335               |                               | 137                             | 0                                              | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | NOK                 | 1.219                 |                               | 120                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 320.196               |                               | 33.323                          | (274)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | THB                 | 6.028                 |                               | 181                             | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 137                   | KRW                           | 186.425                         | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 1.468                 | CNH                           | 10.522                          | 6                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 13.233                | \$                            | 15.418                          | (115)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | NZD                 | 84.324                |                               | 50.290                          | (899)                                          | (0,05)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 29.535                | ¥                             | 4.253.391                       | (89)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 4.237.737             | \$                            | 29.535                          | 89                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 12.826                | €                             | 10.914                          | 13                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 14.430                     | \$ (46.616)                     | \$ (32.186)                                    | (1,69)               |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend und Investor CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

divisenterminkontrakte aus.

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                 | 23.344                | \$                            | 29.227                          | \$ (99)                                        | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 29.227                | CHF                           | 23.247                          | 99                                             | 0,01                 |
| BOA        | 07.2025          | CHF                 | 4                     | \$                            | 5                               | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | \$                  | 30                    | CHF                           | 24                              | 1                                              | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | CHF                 | 435                   | \$                            | 534                             | (12)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 7                     | CHF                           | 6                               | 0                                              | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | CHF                 | 23.209                | \$                            | 28.990                          | (166)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 27.798                | CHF                           | 22.891                          | 960                                            | 0,05                 |
|            | 08.2025          |                     | 28.990                |                               | 23.113                          | 167                                            | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025          | CHF                 | 1                     | \$                            | 1                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 27.776                | CHF                           | 22.826                          | 899                                            | 0,05                 |
| MYI        | 07.2025          | CHF                 | 43                    | \$                            | 52                              | (1)                                            | 0,00                 |
| RBC        | 07.2025          | \$                  | 27.133                | CHF                           | 22.252                          | 822                                            | 0,04                 |
|            |                  |                     |                       | \$                            | 2.948                           | \$ (278)                                       | \$ 2.670             |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                | 0,14                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                 | 1.439                 | \$                            | 935                             | \$ (8)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 141                   |                               | 194                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 551                   |                               | 332                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 3.420                 | €                             | 3.010                           | 113                                            | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 935                   | AUD                           | 1.439                           | 8                                              | 0,00                 |
| BOA        | 08.2025          |                     | 194                   | £                             | 141                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 332                   | NZD                           | 551                             | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 16.250                | €                             | 14.291                          | 526                                            | 0,03                 |
|            | 07.2025          |                     | 260                   | CAD                           | 359                             | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 101                   | SEK                           | 968                             | 1                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | €                   | 118                   | \$                            | 135                             | (3)                                            | (0,00)               |
|            | 07.2025          | £                   | 17.151                |                               | 23.336                          | (167)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 3.460                 | €                             | 3.058                           | 129                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 6.179                 | £                             | 4.581                           | 98                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 24                    | ¥                             | 3.472                           | 0                                              | 0,00                 |
| CBK        | 08.2025          |                     | 23.339                | £                             | 17.151                          | 167                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 8                     | \$                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 66                    | CAD                           | 92                              | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 0                     | DKK                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 386                   | £                             | 288                             | 9                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          |                     | 78                    | SEK                           | 751                             | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 351                   | \$                            | 55                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 20.738                |                               | 24.058                          | (285)                                          | (0,02)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 137                   | AUD                           | 213                             | 2                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 55                    | DKK                           | 350                             | 0                                              | 0,00                 |
| FAR        | 08.2025          |                     | 24.058                | €                             | 20.692                          | 285                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 477                   | \$                            | 75                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 158.982               |                               | 1.092                           | (8)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 686                   | AUD                           | 1.064                           | 11                                             | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| IND        | 07.2025          | \$                     | 1.361                    | ¥ 195.185                        | \$ 0                               | \$ (9)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 502                      | SEK 4.805                        | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 75                       | DKK 475                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.092                    | ¥ 158.397                        | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SEK                    | 6.532                    | \$ 690                           | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 690                      | SEK 6.518                        | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          |                        | 125                      | DKK 827                          | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          |                        | 274                      | NZD 460                          | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 2.430                    | \$ 1.768                         | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 381                      | 517                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 104                      | AUD 162                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.241                    | CAD 1.704                        | 8                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 569                      | € 496                            | 13                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 194                      | £ 141                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 466                      | ¥ 67.131                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 55                       | NZD 92                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.768                    | CAD 2.426                        | 13                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 53.462                   | \$ 367                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 52                       | ¥ 7.473                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 08.2025          |                        | 367                      | 53.265                           | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 596                      | \$ 4                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 08.2025          | \$                     | 4                        | ¥ 593                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 88.238                   | \$ 611                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 08.2025          | \$                     | 611                      | ¥ 87.914                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 199                      | CAD 275                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          |                        | 17.146                   | £ 12.663                         | 207                                | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 195                      | ¥ 28.236                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 1.631                         | \$ (512)                           | \$ 1.119                                             | 0,06                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Bilanzierung und Bilanzierung der folgenden Bilanzkontenkonten aus: |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |
|---------------------------------------------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| Kontrahent                                                          | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
| AZD                                                                 | 07.2025          | € 221.607              | \$ 259.475               | \$ 0                             | \$ (658)                           | \$ (658)                                             | (0,03)                  |
|                                                                     | 07.2025          | \$ 268.485             | € 236.296                | 8.892                            | 0                                  | 8.892                                                | 0,47                    |
|                                                                     | 08.2025          | 260.043                | 221.607                  | 657                              | 0                                  | 657                                                  | 0,03                    |
| BOA                                                                 | 07.2025          | 277.093                | 243.695                  | 8.969                            | 0                                  | 8.969                                                | 0,47                    |
|                                                                     | 07.2025          | € 1.123                | \$ 1.297                 | 0                                | (21)                               | (21)                                                 | 0,00                    |
| BRC                                                                 | 07.2025          | 7.438                  | 8.514                    | 0                                | (218)                              | (218)                                                | (0,01)                  |
|                                                                     | 07.2025          | \$ 276.832             | € 243.767                | 9.315                            | 0                                  | 9.315                                                | 0,49                    |
| CBK                                                                 | 07.2025          | € 4.001                | \$ 4.594                 | 0                                | (102)                              | (102)                                                | (0,01)                  |
|                                                                     | 07.2025          | \$ 265                 | € 230                    | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| DUB                                                                 | 07.2025          | € 221.825              | \$ 257.340               | 0                                | (3.051)                            | (3.051)                                              | (0,16)                  |
|                                                                     | 08.2025          | \$ 257.340             | € 221.339                | 3.047                            | 0                                  | 3.047                                                | 0,16                    |
| MBC                                                                 | 07.2025          | € 70.620               | \$ 81.930                | 0                                | (968)                              | (968)                                                | (0,05)                  |
|                                                                     | 07.2025          | \$ 19                  | € 17                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|                                                                     |                  |                        |                          | \$ 30.885                        | \$ (5.018)                         | \$ 25.867                                            | 1,36                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| zusammenfassend die folgenden Devisenterminkontrakte aus: |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                         |        |     |      |
|-----------------------------------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|--------|-----|------|
| Kontrahent                                                | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |        |     |      |
| AZD                                                       | 07.2025          | £                      | 10.403                   | \$                               | 14.275                             | \$                                                   | 19                      | 0,00   |     |      |
|                                                           | 08.2025          | \$                     | 14.277                   | £                                | 10.403                             | (19)                                                 | (19)                    | 0,00   |     |      |
| BOA                                                       | 07.2025          | £                      | 9                        | \$                               | 12                                 | 0                                                    | 0                       | 0,00   |     |      |
|                                                           | 07.2025          |                        | 11.661                   |                                  | 15.865                             | (114)                                                | (114)                   | (0,01) |     |      |
| BRC                                                       | 07.2025          | \$                     | 15.128                   | £                                | 11.204                             | 0                                                    | 226                     | 0,01   |     |      |
|                                                           | 08.2025          |                        | 15.702                   |                                  | 11.539                             | 0                                                    | 112                     | 0,01   |     |      |
| CBK                                                       | 07.2025          | £                      | 264                      | \$                               | 357                                | (4)                                                  | (4)                     | 0,00   |     |      |
|                                                           | 07.2025          |                        | 42                       |                                  | 57                                 | (1)                                                  | (1)                     | 0,00   |     |      |
| JPM                                                       | 07.2025          | \$                     | 15.526                   | £                                | 11.525                             | 0                                                    | 267                     | 0,01   |     |      |
|                                                           | 07.2025          | £                      | 478                      | \$                               | 648                                | (7)                                                  | (7)                     | 0,00   |     |      |
| MBC                                                       | 07.2025          |                        | 11.417                   |                                  | 15.655                             | 0                                                    | 10                      | 0,00   |     |      |
|                                                           | 07.2025          | \$                     | 15.676                   | £                                | 11.577                             | 0                                                    | 189                     | 0,01   |     |      |
| SSB                                                       | 08.2025          |                        | 15.657                   |                                  | 11.417                             | (9)                                                  | (9)                     | 0,00   |     |      |
|                                                           | 07.2025          | £                      | 33                       | \$                               | 45                                 | (1)                                                  | (1)                     | 0,00   |     |      |
|                                                           |                  |                        |                          | \$                               | 823                                | \$                                                   | (155)                   | \$     | 668 | 0,03 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Real Return Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA                              | 07.2025          | SGD                 | \$ 55.980             | \$ 43.717                     | \$ 0                            | \$ (235)                                      | (0,01)               |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 43.717                | SGD 55.849                    | 242                             | 242                                           | 0,01                 |
| CBK                              | 07.2025          | SGD                 | 3.447                 | \$ 2.686                      | 0                               | (21)                                          | 0,00                 |
| DUB                              | 07.2025          | \$                  | 55.482                | SGD 71.475                    | 636                             | 636                                           | 0,04                 |
| FAR                              | 07.2025          | SGD                 | 120.727               | \$ 94.660                     | 0                               | (128)                                         | (0,01)               |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 109.728               | SGD 141.175                   | 1.115                           | 1.115                                         | 0,06                 |
|                                  | 08.2025          |                     | 94.660                | 120.439                       | 139                             | 139                                           | 0,01                 |
| GLM                              | 07.2025          | SGD                 | 52.781                | \$ 41.407                     | 0                               | (34)                                          | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 41.407                | SGD 52.654                    | 38                              | 38                                            | 0,00                 |
| JPM                              | 07.2025          | SGD                 | 56.279                | \$ 43.954                     | 0                               | (234)                                         | (0,01)               |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 117.602               | SGD 151.062                   | 1.003                           | 1.003                                         | 0,05                 |
|                                  | 08.2025          |                     | 43.954                | 56.149                        | 241                             | 241                                           | 0,01                 |
| MBC                              | 07.2025          | SGD                 | 139.463               | \$ 107.844                    | 0                               | (1.656)                                       | (0,09)               |
|                                  | 07.2025          | \$                  | 85.437                | SGD 109.605                   | 619                             | 619                                           | 0,03                 |
|                                  | 08.2025          |                     | 107.844               | 139.143                       | 1.678                           | 1.678                                         | 0,09                 |
| SCX                              | 07.2025          | SGD                 | 23.721                | \$ 18.392                     | 0                               | (234)                                         | (0,01)               |
|                                  | 08.2025          | \$                  | 18.392                | SGD 23.668                    | 237                             | 237                                           | 0,01                 |
| SSB                              | 07.2025          |                     | 2.598                 | 3.314                         | 4                               | 4                                             | 0,00                 |
|                                  |                  |                     |                       | \$ 5.952                      | \$ (2.542)                      | \$ 3.410                                      | 0,18                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 28                                         | 0,00                 |
| Summe Anlagen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 3.283.951                                  | 172,48               |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ (1.379.982)                                | (72,48)              |
| Nettovermögen                    |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ 1.903.969                                  | 100,00               |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert 1.171.654 USD (31. Dezember 2024: 1.156.662 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 37.051 USD) als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 6.361 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.250 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 20.316 USD (31. Dezember 2024: 26.093 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 20.790 USD (31. Dezember 2024: 10.960 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 3.228.921                                                    | \$ 0                                                         | \$ 3.228.921 |
| Investmentfonds               | 51.580                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 51.580       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 391                                                                         | 3.059                                                           | 0                                                            | 3.450        |
| Summen                        | \$ 51.971                                                                   | \$ 3.231.980                                                    | \$ 0                                                         | \$ 3.283.951 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 3.368.570                                                    | \$ 0                                                         | \$ 3.368.570 |
| Investmentfonds               | 23.521                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 23.521       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (1.158)                                                                     | 5.608                                                           | 0                                                            | 4.450        |
| Summen                        | \$ 22.363                                                                   | \$ 3.374.178                                                    | \$ 0                                                         | \$ 3.396.541 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BOM                                       | 4,450 %    | 09.06.2025       | 17.07.2025       | \$ (171.875) | \$ (172.343)                                | (9,05)                  |
|                                           | 4,450      | 25.06.2025       | 17.07.2025       | (38.000)     | (38.028)                                    | (2,00)                  |
| BRC                                       | 2,040      | 11.06.2025       | 05.09.2025       | € (12.090)   | (14.208)                                    | (0,74)                  |
| BSN                                       | 4,440      | 18.06.2025       | 17.07.2025       | \$ (207.324) | (207.656)                                   | (10,91)                 |
|                                           | 4,450      | 09.06.2025       | 14.07.2025       | (311.711)    | (312.558)                                   | (16,42)                 |
|                                           | 4,450      | 25.06.2025       | 14.07.2025       | (36.498)     | (36.525)                                    | (1,92)                  |
| CEW                                       | 2,040      | 11.06.2025       | 05.09.2025       | € (56.160)   | (65.997)                                    | (3,47)                  |
| CIB                                       | 4,440      | 06.06.2025       | 18.07.2025       | \$ (152.830) | (153.301)                                   | (8,05)                  |
| DEU                                       | 4,480      | 25.06.2025       | 02.07.2025       | (37.295)     | (37.323)                                    | (1,96)                  |
| JPS                                       | 4,450      | 25.06.2025       | 08.07.2025       | (9.588)      | (9.595)                                     | (0,50)                  |
| MEI                                       | 2,060      | 11.06.2025       | 05.09.2025       | € (41.408)   | (48.662)                                    | (2,55)                  |
|                                           | 2,080      | 25.06.2025       | 05.09.2025       | (36.491)     | (42.850)                                    | (2,25)                  |
| SCX                                       | 2,080      | 11.06.2025       | 11.07.2025       | (21.510)     | (25.278)                                    | (1,33)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                  |              | <b>\$ (1.164.324)</b>                       | <b>(61,15)</b>          |

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 8.977                            | \$ (8.100)                            | \$ 877                          | \$ 1.314                            | \$ (1.330)                            | \$ (16)                         |
| BOA        | (7.527)                             | 7.210                                 | (317)                           | (83)                                | 0                                     | (83)                            |
| BPS        | (554)                               | 570                                   | 16                              | (1.106)                             | 450                                   | (656)                           |
| BRC        | 9.068                               | (8.830)                               | 238                             | 4.942                               | (4.430)                               | 512                             |
| CBK        | (4.122)                             | 4.010                                 | (112)                           | (267)                               | (180)                                 | (447)                           |
| CIB        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (2)                                 | 0                                     | (2)                             |
| DUB        | 604                                 | (620)                                 | (16)                            | (4.955)                             | 4.370                                 | (585)                           |
| FAR        | 2.418                               | (2.440)                               | (22)                            | 1.532                               | (1.280)                               | 252                             |
| GLM        | (1.690)                             | (320)                                 | (2.010)                         | (566)                               | 390                                   | (176)                           |
| GST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | 190                                 | 650                                   | 840                             |
| IND        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | 948                                 | (800)                                 | 148                             |
| JPM        | (20)                                | 180                                   | 160                             | 232                                 | (270)                                 | (38)                            |
| MBC        | (47)                                | 0                                     | (47)                            | (6.249)                             | 5.100                                 | (1.149)                         |
| MYC        | 508                                 | (560)                                 | (52)                            | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| MYI        | (65)                                | 80                                    | 15                              | 286                                 | 0                                     | 286                             |
| RBC        | 822                                 | (530)                                 | 292                             | (53)                                | 0                                     | (53)                            |
| RYL        | 24                                  | 0                                     | 24                              | (181)                               | 0                                     | (181)                           |
| SAL        | 13                                  | 0                                     | 13                              | 1                                   | 0                                     | 1                               |
| SCX        | 92                                  | 0                                     | 92                              | 5.134                               | (4.070)                               | 1.064                           |
| SOG        | 6                                   | 0                                     | 6                               | (38)                                | 0                                     | (38)                            |
| SSB        | (7.184)                             | 7.530                                 | 346                             | 2                                   | (10)                                  | (8)                             |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | 716                                 | (980)                                 | (264)                           |
| UAG        | (294)                               | 320                                   | 26                              | 20                                  | 0                                     | 20                              |
| WST        | (1.001)                             | 890                                   | (111)                           | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.



**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| <b>Analyse des Gesamtvermögens</b>                                     | <b>30. Juni 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|------------------------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 71,04                    | 60,64                    |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 13,57                    | 11,86                    |
| Investmentfonds                                                        | 1,35                     | 0,51                     |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,07                     | 0,14                     |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,42                     | 0,34                     |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,50                     | 0,66                     |
| Sonstige Aktiva                                                        | 12,05                    | 25,85                    |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>            | <b>100,00</b>            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| <b>Anlagen zum Marktwert</b>                               | <b>30. Juni 2025 (%)</b> | <b>31. Dez. 2024 (%)</b> |
|------------------------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Australien                                                 | 3,22                     | 1,26                     |
| Kanada                                                     | 1,35                     | 1,94                     |
| Kaimaninseln                                               | 0,31                     | 0,25                     |
| Dänemark                                                   | 4,17                     | 3,53                     |
| Frankreich                                                 | 9,92                     | 9,24                     |
| Deutschland                                                | 7,32                     | 8,33                     |
| Ungarn                                                     | 0,19                     | k. A.                    |
| Irland                                                     | 7,16                     | 6,66                     |
| Italien                                                    | 9,83                     | 11,41                    |
| Japan                                                      | 5,64                     | 4,93                     |
| Luxemburg                                                  | 0,76                     | 0,84                     |
| Mexiko                                                     | 0,02                     | 0,08                     |
| Niederlande                                                | 0,26                     | 0,26                     |
| Neuseeland                                                 | 2,64                     | 2,19                     |
| Peru                                                       | 0,02                     | 0,02                     |
| Rumänien                                                   | 0,19                     | k. A.                    |
| Saudi-Arabien                                              | 0,78                     | k. A.                    |
| Spanien                                                    | 1,93                     | 1,61                     |
| Supranational                                              | 1,00                     | 0,78                     |
| Schweden                                                   | 1,06                     | 1,41                     |
| Großbritannien                                             | 35,48                    | 25,44                    |
| USA                                                        | 76,34                    | 80,98                    |
| Investmentfonds                                            | 2,71                     | 1,13                     |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                          |                          |
| Futures                                                    | (0,07)                   | 0,10                     |
| Optionskauf                                                |                          |                          |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00                     | k. A.                    |
| Verkaufsoptionen                                           |                          |                          |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01)                   | k. A.                    |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                        |                          |                          |
| Zinsswaps                                                  | 0,26                     | 0,02                     |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                 |                          |                          |
| Optionskauf                                                |                          |                          |
| Zinsswapoptionen                                           | 0,04                     | k. A.                    |
| Verkaufsoptionen                                           |                          |                          |
| Inflation-Capped Options                                   | (0,01)                   | (0,01)                   |
| Zinsswapoptionen                                           | (0,11)                   | (0,09)                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf     | 0,00                     | 0,04                     |
| Devisenterminkontrakte                                     | (1,69)                   | 1,43                     |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                        | 1,77                     | (1,28)                   |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                | (72,48)                  | (62,50)                  |
| <b>Nettovermögen</b>                                       | <b>100,00</b>            | <b>100,00</b>            |

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                      |                |                          |                                   | Windstream Services LLC                       |                |                          |                                   |                                                                 |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>            |                |                          |                                   | 9,177 % fällig am 01.10.2031                  | \$ 50.000      | \$ 50.313                | 0,05                              | 6,490 % fällig am 13.09.2029                                    | \$ 7.300       | \$ 7.719                 | 0,01                              |
| Alice France S.A.                                    |                |                          |                                   |                                               |                | 1.598.501                | 1,61                              | 6,496 % fällig am 13.09.2027                                    | 26.700         | 27.298                   | 0,03                              |
| 5,279 % fällig am 02.02.2026                         | € 6.583        | \$ 6.826                 | 0,01                              | <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>       |                |                          |                                   | 7,385 % fällig am 02.11.2028                                    | 21.400         | 22.720                   | 0,02                              |
| 7,779 % fällig am 15.08.2028                         | 25.252         | 26.747                   | 0,03                              | <b>BANKEN UND FINANZEN</b>                    |                |                          |                                   | 7,437 % fällig am 02.11.2033                                    | 77.380         | 87.851                   | 0,09                              |
| 9,756 % fällig am 15.08.2028                         | \$ 155.366     | 141.167                  | 0,14                              | ABN AMRO Bank NV                              |                |                          |                                   | Bayou Re Ltd.                                                   |                |                          |                                   |
| American Airlines, Inc.                              |                |                          |                                   | 6,339 % fällig am 18.09.2027                  | 3.200          | 3.270                    | 0,00                              | 12,794 % fällig am 30.04.2031                                   | 3.000          | 3.162                    | 0,00                              |
| 6,522 % fällig am 20.04.2028                         | 16.205         | 16.123                   | 0,02                              | 6,575 % fällig am 13.10.2026                  | 113.000        | 113.591                  | 0,11                              | 22,808 % fällig am 30.04.2031                                   | 3.500          | 3.765                    | 0,00                              |
| Avolon TLB Borrower U.S. LLC                         |                |                          |                                   | AGFC Capital Trust                            |                |                          |                                   | BGC Group, Inc.                                                 |                |                          |                                   |
| 6,071 % fällig am 24.06.2030                         | 4.061          | 4.069                    | 0,00                              | 6,268 % fällig am 15.01.2067                  | 23.000         | 16.079                   | 0,02                              | 6,600 % fällig am 10.06.2029                                    | 41.800         | 43.339                   | 0,04                              |
| Carnival Corp.                                       |                |                          |                                   | Alamo Re Ltd.                                 |                |                          |                                   | Blue Ridge Re Ltd.                                              |                |                          |                                   |
| 6,312 % fällig am 18.10.2028                         | 9.739          | 9.759                    | 0,01                              | 12,058 % fällig am 07.06.2027                 | 17.400         | 18.157                   | 0,02                              | 9,544 % fällig am 08.01.2031                                    | 11.486         | 11.677                   | 0,01                              |
| Charter Communications Operating LLC                 |                |                          |                                   | 15,544 % fällig am 08.06.2026                 | 18.000         | 18.702                   | 0,02                              | BNP Paribas Issuance BV                                         |                |                          |                                   |
| 6,548 % fällig am 15.12.2031                         | 32.429         | 32.516                   | 0,03                              | Ambac Assurance Corp.                         |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 09.04.2029                                    | 10             | 1.714.903                | 1,73                              |
| Clover Holdings SPV LLC                              |                |                          |                                   | 5,100 % (i)                                   | 0              | 0                        | 0,00                              | BNP Paribas S.A.                                                |                |                          |                                   |
| 15,000 % fällig am 09.12.2027                        | 465            | 464                      | 0,00                              | American Assets Trust LP                      |                |                          |                                   | 1,904 % fällig am 30.09.2028                                    | 2.300          | 2.171                    | 0,00                              |
| DirectTV Financing LLC                               |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 01.02.2031                  | 3.800          | 3.405                    | 0,00                              | 3,583 % fällig am 15.01.2031                                    | € 13.800       | 16.491                   | 0,02                              |
| 9,541 % fällig am 02.08.2027                         | 1.264          | 1.270                    | 0,00                              | 6,150 % fällig am 01.10.2034                  | 16.200         | 16.200                   | 0,02                              | 5,497 % fällig am 20.05.2030                                    | \$ 39.700      | 40.777                   | 0,04                              |
| Envision Healthcare Corp.                            |                |                          |                                   | Americold Realty Operating Partnership LP     |                |                          |                                   | 5,786 % fällig am 13.01.2033                                    | 60.800         | 63.287                   | 0,06                              |
| 12,235 % fällig am 03.11.2028                        | 63.333         | 65.233                   | 0,07                              | 5,600 % fällig am 15.05.2032                  | 15.500         | 15.583                   | 0,02                              | Bonanza RE Ltd.                                                 |                |                          |                                   |
| Finastra USA, Inc.                                   |                |                          |                                   | Armor Holdco, Inc.                            |                |                          |                                   | 4,294 % fällig am 08.01.2026                                    | 1.300          | 1.100                    | 0,00                              |
| 0,500 % - 11,573 %                                   |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 15.11.2029                  | 800            | 767                      | 0,00                              | BPCE S.A.                                                       |                |                          |                                   |
| fällig am 13.09.2029                                 | 2.979          | 2.998                    | 0,00                              | Armor RE Ltd.                                 |                |                          |                                   | 1,652 % fällig am 06.10.2026                                    | 1.027          | 1.019                    | 0,00                              |
| 0,500 % - 11,573 %                                   |                |                          |                                   | 12,808 % fällig am 07.01.2032                 | 2.700          | 2.705                    | 0,00                              | 2,277 % fällig am 20.01.2032                                    | 7.500          | 6.493                    | 0,01                              |
| fällig am 13.09.2029                                 | 28.362         | 28.539                   | 0,03                              | 14,558 % fällig am 07.05.2031                 | 6.800          | 7.048                    | 0,01                              | 5,876 % fällig am 14.01.2031                                    | 33.750         | 35.020                   | 0,04                              |
| Flutter Financing BV                                 |                |                          |                                   | Army Hawaii Family Housing Trust Certificates |                |                          |                                   | 5,936 % fällig am 30.05.2035                                    | 73.000         | 74.841                   | 0,08                              |
| 6,046 % fällig am 30.11.2030                         | 9.949          | 9.937                    | 0,01                              | 4,826 % fällig am 15.06.2050                  | 100.120        | 72.025                   | 0,07                              | 6,293 % fällig am 14.01.2036                                    | 68.000         | 71.445                   | 0,07                              |
| Forward Air Corp.                                    |                |                          |                                   | Arthur J Gallagher & Co.                      |                |                          |                                   | 6,612 % fällig am 19.10.2027                                    | 208.250        | 213.240                  | 0,22                              |
| 8,780 % fällig am 19.12.2030                         | 119            | 119                      | 0,00                              | 4,600 % fällig am 15.12.2027                  | 7.000          | 7.055                    | 0,01                              | 6,714 % fällig am 19.10.2029                                    | 192.850        | 204.298                  | 0,21                              |
| iHeartCommunications, Inc.                           |                |                          |                                   | 4,850 % fällig am 15.12.2029                  | 4.900          | 4.975                    | 0,01                              | 7,003 % fällig am 19.10.2034                                    | 152.500        | 167.617                  | 0,17                              |
| 10,216 % fällig am 01.05.2029                        | 252.461        | 206.492                  | 0,21                              | Athene Global Funding                         |                |                          |                                   | Brown & Brown, Inc.                                             |                |                          |                                   |
| Lealand Finance Co. BV                               |                |                          |                                   | 3,046 % fällig am 23.02.2027                  | € 98.000       | 115.621                  | 0,12                              | 4,600 % fällig am 23.12.2026                                    | 5.500          | 5.528                    | 0,01                              |
| Lealand Finance Co. BV (5,441 % bar und 3,000 % PIK) |                |                          |                                   | Avolon Holdings Funding Ltd.                  |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 23.06.2028                                    | 6.000          | 6.052                    | 0,01                              |
| 3,000 % - 5,441 %                                    |                |                          |                                   | 2,528 % fällig am 18.11.2027                  | \$ 165.597     | 157.483                  | 0,16                              | CaixaBank S.A.                                                  |                |                          |                                   |
| fällig am 31.12.2027 (d)                             | 7.399          | 3.884                    | 0,00                              | Baldwin Re Ltd.                               |                |                          |                                   | 6,208 % fällig am 18.01.2029                                    | 69.950         | 72.721                   | 0,07                              |
| MPH Acquisition Holdings LLC                         |                |                          |                                   | 6,334 % fällig am 07.07.2028                  | 1.800          | 1.800                    | 0,00                              | 6,684 % fällig am 13.09.2027                                    | 27.300         | 27.965                   | 0,03                              |
| 8,030 % fällig am 31.12.2030                         | 8.180          | 8.073                    | 0,01                              | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA           |                |                          |                                   | 6,840 % fällig am 13.09.2034                                    | 7.700          | 8.462                    | 0,01                              |
| Numericable Group S.A.                               |                |                          |                                   | 1,875 % fällig am 09.01.2026                  | € 33.400       | 39.060                   | 0,04                              | Cape Lookout Re Ltd.                                            |                |                          |                                   |
| 5,186 % fällig am 31.07.2025                         | € 7.780        | 8.035                    | 0,01                              | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.          |                |                          |                                   | 11,194 % fällig am 13.03.2032                                   | 21.900         | 21.992                   | 0,02                              |
| 9,250 % fällig am 31.07.2025                         | \$ 5.586       | 4.874                    | 0,01                              | 5,381 % fällig am 13.03.2029                  | \$ 84.800      | 87.380                   | 0,09                              | 12,996 % fällig am 05.04.2027                                   | 4.900          | 4.970                    | 0,01                              |
| OCS Group Holdings Ltd.                              |                |                          |                                   | 6,033 % fällig am 13.03.2035                  | 54.300         | 56.645                   | 0,06                              | Charles River Re Ltd.                                           |                |                          |                                   |
| 9,961 % fällig am 28.11.2031                         | £ 12.300       | 16.826                   | 0,02                              | 6,138 % fällig am 14.09.2028                  | 17.000         | 17.593                   | 0,02                              | 11,044 % fällig am 10.05.2031                                   | 1.400          | 1.425                    | 0,00                              |
| Pantheon Senior Debt Secondaries                     |                |                          |                                   | Banco Espirito Santo S.A.                     |                |                          |                                   | CI Financial Corp.                                              |                |                          |                                   |
| 6,317 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^                | € 16.200       | 4.469                    | 0,00                              | 7,500 % fällig am 30.05.2029                                    | 39.800         | 42.013                   | 0,04                              |
| 26.03.2026 (i)                                       | \$ 31.300      | 31.300                   | 0,03                              | 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^                | 8.100          | 2.234                    | 0,00                              | CIFI Holdings Group Co. Ltd.                                    |                |                          |                                   |
| Poseidon Bidco SASU                                  |                |                          |                                   | Banco Santander S.A.                          |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 12.04.2027 ^                                  | 2.000          | 187                      | 0,00                              |
| 6,980 % fällig am 13.03.2030                         | € 42.400       | 34.093                   | 0,03                              | 3,250 % fällig am 02.04.2029                  | 40.400         | 48.041                   | 0,05                              | 4,450 % fällig am 17.08.2026 ^                                  | 1.700          | 157                      | 0,00                              |
| Project Alfa                                         |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 11.04.2027                  | \$ 2.800       | 2.794                    | 0,00                              | 4,800 % fällig am 17.05.2028 ^                                  | 700            | 66                       | 0,00                              |
| 4,256 % fällig am                                    |                |                          |                                   | 5,538 % fällig am 14.03.2030                  | 123.300        | 127.176                  | 0,13                              | 5,250 % fällig am 13.05.2026 ^                                  | 1.100          | 115                      | 0,00                              |
| 27.02.2026 (i)                                       | 17.861         | 20.966                   | 0,02                              | 5,552 % fällig am 14.03.2028                  | 87.800         | 89.239                   | 0,09                              | 5,950 % fällig am 20.10.2025 ^                                  | 1.300          | 136                      | 0,00                              |
| Project Hudson                                       |                |                          |                                   | 5,565 % fällig am 17.01.2030                  | 89.800         | 93.260                   | 0,09                              | 6,000 % fällig am 16.07.2025 ^                                  | 2.000          | 205                      | 0,00                              |
| 7,730 % fällig am 29.05.2026                         | \$ 39.200      | 39.769                   | 0,04                              | 5,776 % fällig am 14.03.2028                  |                |                          |                                   | 6,450 % fällig am 07.11.2024 ^                                  | 3.300          | 355                      | 0,00                              |
| Republic of Panama                                   |                |                          |                                   | (m)                                           | 37.600         | 37.828                   | 0,04                              | Citadel Securities Global Holdings LLC                          |                |                          |                                   |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027                         | € 74.800       | 88.439                   | 0,09                              | 6,033 % fällig am 17.01.2035                  | 5.100          | 5.375                    | 0,01                              | 5,500 % fällig am 18.06.2030                                    | 20.800         | 21.054                   | 0,02                              |
| 4,804 % fällig am 01.04.2027                         | 233.400        | 275.254                  | 0,28                              | 6,527 % fällig am 07.11.2027                  | 41.800         | 42.915                   | 0,04                              | Clue Opco LLC                                                   |                |                          |                                   |
| SCUR-Alpha 1503 GmbH                                 |                |                          |                                   | 6,607 % fällig am 07.11.2028                  | 26.200         | 27.954                   | 0,03                              | 9,500 % fällig am 15.10.2031                                    | 700            | 743                      | 0,00                              |
| 7,656 % - 7,686 %                                    |                |                          |                                   | Bank of America Corp.                         |                |                          |                                   | CNO Global Funding                                              |                |                          |                                   |
| fällig am 29.03.2030                                 | 62.100         | 71.905                   | 0,07                              | 4,827 % fällig am 22.07.2026                  | 3.300          | 3.300                    | 0,00                              | 4,875 % fällig am 10.12.2027                                    | 14.500         | 14.620                   | 0,02                              |
| 9,780 % fällig am 29.03.2030                         | \$ 111.167     | 105.269                  | 0,11                              | 5,202 % fällig am 25.04.2029                  | 46.500         | 47.529                   | 0,05                              | 4,950 % fällig am 09.09.2029                                    | 11.100         | 11.221                   | 0,01                              |
| Subcalidora                                          |                |                          |                                   | Bank of Montreal                              |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 04.06.2027                                    | 36.800         | 37.812                   | 0,04                              |
| 7,730 % fällig am 14.08.2029                         | € 51.900       | 61.227                   | 0,06                              | 4,567 % fällig am 10.09.2027                  | 40.170         | 40.274                   | 0,04                              | Commerzbank AG                                                  |                |                          |                                   |
| Syniverse Holdings, Inc.                             |                |                          |                                   | 5,274 % fällig am 10.09.2027                  | 63.500         | 63.702                   | 0,06                              | 4,000 % fällig am 16.07.2032                                    | € 14.400       | 17.364                   | 0,02                              |
| 11,296 % fällig am 13.05.2027                        | \$ 38.703      | 36.848                   | 0,04                              | Bank of Nova Scotia                           |                |                          |                                   | Constellation Pharmaceuticals, Inc.                             |                |                          |                                   |
| Thames Water Utilities Ltd.                          |                |                          |                                   | 4,404 % fällig am 08.09.2028                  | 64.500         | 64.627                   | 0,07                              | 5,550 % fällig am                                               |                |                          |                                   |
| 0,300 % - 5,234 %                                    |                |                          |                                   | 5,391 % fällig am 08.09.2028                  | 61.100         | 61.380                   | 0,06                              | 01.07.2033 (i)                                                  | \$ 30.709      | 31.180                   | 0,03                              |
| fällig am 28.11.2025                                 | £ 36.267       | 36.404                   | 0,04                              | Banque Federative du Credit Mutuel S.A.       |                |                          |                                   | Cooperative Rabobank UA                                         |                |                          |                                   |
| TransDigm, Inc.                                      |                |                          |                                   | 5,194 % fällig am 16.02.2028                  | 37.500         | 38.214                   | 0,04                              | 6,500 % (i)                                                     | € 133.421      | 178.740                  | 0,18                              |
| 6,796 % fällig am 28.02.2031                         | \$ 82.340      | 82.580                   | 0,08                              | 5,440 % fällig am 16.02.2028                  | 33.000         | 33.168                   | 0,03                              | Corebridge Global Funding                                       |                |                          |                                   |
| 7,046 % fällig am 22.03.2030                         | 31.771         | 31.921                   | 0,03                              | Barclays PLC                                  |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 03.12.2029                                    | \$ 4.900       | 4.974                    | 0,01                              |
| Turkiye Vakiflar Bankasi T.A.O.                      |                |                          |                                   | 4,837 % fällig am 10.09.2028                  | 51.700         | 52.109                   | 0,05                              | Corestate Capital Holding S.A. (10,000 % bar oder 11,000 % PIK) |                |                          |                                   |
| 5,001 % fällig am 15.12.2028                         | € 10.600       | 12.489                   | 0,01                              | 4,942 % fällig am 10.09.2030                  | 47.300         | 47.666                   | 0,05                              | 10,000 % fällig am                                              |                |                          |                                   |
| U.S. Renal Care, Inc.                                |                |                          |                                   | 4,972 % fällig am 16.05.2029                  | 89.115         | 90.063                   | 0,09                              | 31.12.2026 (d)                                                  | € 1.164        | 1.230                    | 0,00                              |
| 9,441 % fällig am 20.06.2028                         | \$ 24.605      | 23.354                   | 0,02                              | 5,501 % fällig am 09.08.2028                  | 41.084         | 41.910                   | 0,04                              | Corestate Capital Holding S.A. (8,000 % bar oder 9,000 % PIK)   |                |                          |                                   |
| Westmoreland Coal Co.                                |                |                          |                                   | 5,674 % fällig am 12.03.2028                  | 11.200         | 11.416                   | 0,01                              | 8,000 % fällig am                                               |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 15.03.2029                         | 1.530          | 604                      | 0,00                              | 5,690 % fällig am 12.03.2030                  | 23.400         | 24.218                   | 0,02                              | 31.12.2026 (d)                                                  | 7.343          | 3.491                    | 0,00                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,887 % fällig am 12.03.2028                  | 76.800         | 77.418                   | 0,08                              | CoStar Group, Inc.                                              |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 6,224 % fällig am 09.05.2034                  | 23.900         | 25.376                   | 0,03                              | 2,800 % fällig am 15.07.2030                                    | \$ 11.362      | 10.283                   | 0,01                              |
|                                                      |                |                          |                                   |                                               |                |                          |                                   | Country Garden Holdings Co. Ltd.                                |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   |                                               |                |                          |                                   | 2,700 % fällig am 12.07.2026 ^                                  | 8.400          | 661                      | 0,00                              |
|                                                      |                |                          |                                   |                                               |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 22.10.2025 ^                                  | 13.400         | 1.019                    | 0,00                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 3,875 % fällig am 22.10.2030 ^               | \$ 6.400       | \$ 500                   | 0,00                              | 5,125 % fällig am 05.11.2026                | \$ 82.695      | \$ 82.522                | 0,08                              | Incora Top Holdco LLC                  |                |                          |                                   |
| 4,800 % fällig am 06.08.2030 ^               | 1.000          | 77                       | 0,00                              | 5,800 % fällig am 05.03.2027                | 4.114          | 4.148                    | 0,00                              | 6,000 % fällig am 30.01.2033 (I)       | \$ 7.278       | \$ 10.091                | 0,01                              |
| 5,125 % fällig am 17.01.2025 ^               | 1.600          | 124                      | 0,00                              | 5,800 % fällig am 08.03.2029                | 95.849         | 96.083                   | 0,10                              | ING Groep NV                           |                |                          |                                   |
| 5,400 % fällig am 27.05.2025 ^               | 1.600          | 124                      | 0,00                              | 5,810 % fällig am 05.11.2026                | 100.000        | 99.579                   | 0,10                              | 3,500 % fällig am 03.09.2030           | € 76.900       | 91.889                   | 0,09                              |
| 5,625 % fällig am 14.01.2030 ^               | 700            | 54                       | 0,00                              | 5,850 % fällig am 17.05.2027                | 28.800         | 29.031                   | 0,03                              | 3,875 % fällig am 12.08.2029           | 11.600         | 14.041                   | 0,01                              |
| 6,150 % fällig am 17.09.2025 ^               | 1.000          | 76                       | 0,00                              | 5,918 % fällig am 20.03.2028                | 40.000         | 40.414                   | 0,04                              | Integrity RE Ltd.                      |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 ^               | 500            | 40                       | 0,00                              | 6,436 % fällig am 20.03.2028                | 113.700        | 112.104                  | 0,11                              | 12,294 % fällig am 06.06.2027          | \$ 700         | 704                      | 0,00                              |
| 8,000 % fällig am 27.01.2024 ^               | 2.800          | 220                      | 0,00                              | 6,798 % fällig am 07.11.2028                | 10.900         | 11.296                   | 0,01                              | 14,044 % fällig am 06.06.2027          | 500            | 503                      | 0,00                              |
| Cousins Properties LP                        |                |                          |                                   | 6,800 % fällig am 12.05.2028                | 98.330         | 101.653                  | 0,10                              | 16,544 % fällig am 06.06.2028          | 3.100          | 3.127                    | 0,00                              |
| 5,375 % fällig am 15.02.2032 (m)             | 11.100         | 11.225                   | 0,01                              | 6,950 % fällig am 06.03.2026                | 16.220         | 16.379                   | 0,02                              | Integrity Re Ltd.                      |                |                          |                                   |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A. |                |                          |                                   | 6,950 % fällig am 10.06.2026                | 39.585         | 40.133                   | 0,04                              | 21,308 % fällig am 08.06.2026          | 8.300          | 8.665                    | 0,01                              |
| 9,700 % fällig am 05.03.2045                 | PEN 73.400     | 21.604                   | 0,02                              | 7,350 % fällig am 04.11.2027                | 21.204         | 22.028                   | 0,02                              | 27,308 % fällig am 08.06.2026          | 4.000          | 3.975                    | 0,00                              |
| 10,100 % fällig am 15.12.2043                | 33.500         | 10.031                   | 0,01                              | Fortitude Group Holdings LLC                |                |                          |                                   | Integrity RE Ltd.                      |                |                          |                                   |
| Credit Agricole Opportunities Partners       |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.04.2030                | 23.300         | 23.981                   | 0,02                              | 29,794 % fällig am 06.06.2027          | 5.200          | 5.238                    | 0,01                              |
| 6,520 % fällig am 20.03.2028 (I)             | \$ 30.200      | 30.402                   | 0,03                              | GA Global Funding Trust                     |                |                          |                                   | Intesa Sanpaolo SpA                    |                |                          |                                   |
| 6,740 % fällig am 20.03.2030 (I)             | 35.600         | 35.992                   | 0,04                              | 4,400 % fällig am 23.09.2027                | 50.000         | 49.920                   | 0,05                              | 4,000 % fällig am 23.09.2029           | 5.000          | 4.880                    | 0,01                              |
| Credit Agricole S.A.                         |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 09.12.2031                | 23.800         | 23.855                   | 0,02                              | 6,625 % fällig am 20.06.2033           | 8.625          | 9.369                    | 0,01                              |
| 4,631 % fällig am 11.09.2028                 | 24.150         | 24.189                   | 0,02                              | 5,400 % fällig am 13.01.2030                | 25.100         | 25.788                   | 0,03                              | 7,200 % fällig am 28.11.2033           | 65.800         | 73.923                   | 0,07                              |
| 5,606 % fällig am 11.09.2028                 | 59.700         | 60.063                   | 0,06                              | 5,500 % fällig am 01.04.2032                | 41.500         | 42.208                   | 0,04                              | 8,248 % fällig am 21.11.2033           | 4.133          | 4.799                    | 0,01                              |
| 6,316 % fällig am 03.10.2029                 | 23.650         | 24.861                   | 0,03                              | 5,900 % fällig am 13.01.2035                | 36.800         | 37.351                   | 0,04                              | Iridium Capital PLC                    |                |                          |                                   |
| Crown Castle, Inc.                           |                |                          |                                   | Gaci First Investment Co.                   |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 18.06.2029           | € 19.750       | 25.154                   | 0,03                              |
| 4,900 % fällig am 01.09.2029                 | 11.700         | 11.811                   | 0,01                              | 5,250 % fällig am 29.01.2030                | 384.000        | 392.349                  | 0,40                              | JAB Holdings BV                        |                |                          |                                   |
| Danske Bank A/S                              |                |                          |                                   | Galderma Finance Europe BV                  |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 25.04.2034           | 75.100         | 89.820                   | 0,09                              |
| 4,613 % fällig am 02.10.2030                 | 17.000         | 16.936                   | 0,02                              | 3,500 % fällig am 20.03.2030                | € 45.498       | 53.936                   | 0,05                              | 5,000 % fällig am 12.06.2033           | 9.400          | 11.771                   | 0,01                              |
| DaVinciRe Holdings Ltd.                      |                |                          |                                   | Gateway Casinos & Entertainment Ltd.        |                |                          |                                   | Jackson National Life Global Funding   |                |                          |                                   |
| 5,950 % fällig am 15.04.2035                 | 7.800          | 7.854                    | 0,01                              | 5,000 % fällig am 12.03.2038                | CAD 43.576     | 29.339                   | 0,03                              | 4,600 % fällig am 01.10.2029           | \$ 70.950      | 70.869                   | 0,07                              |
| Deloitte LLP                                 |                |                          |                                   | GLP Capital LP                              |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 13.01.2027           | 54.000         | 54.406                   | 0,06                              |
| 5,250 % fällig am 30.01.2030 (I)             | 12.400         | 12.562                   | 0,01                              | 3,250 % fällig am 15.01.2032                | \$ 5.600       | 4.933                    | 0,01                              | 5,315 % fällig am 14.01.2028           | 44.500         | 44.666                   | 0,05                              |
| 5,410 % fällig am 30.01.2032 (I)             | 12.200         | 12.294                   | 0,01                              | 4,000 % fällig am 15.01.2031                | 17.915         | 16.904                   | 0,02                              | 5,550 % fällig am 02.07.2027           | 37.300         | 38.075                   | 0,04                              |
| Deutsche Bank AG                             |                |                          |                                   | 5,300 % fällig am 15.01.2029                | 19.614         | 19.845                   | 0,02                              | JPMorgan Chase & Co.                   |                |                          |                                   |
| 3,547 % fällig am 18.09.2031                 | 23.300         | 21.803                   | 0,02                              | 5,375 % fällig am 15.04.2026                | 12.400         | 12.410                   | 0,01                              | 3,509 % fällig am 23.01.2029           | 3.500          | 3.429                    | 0,00                              |
| 4,999 % fällig am 11.09.2030                 | 48.100         | 48.477                   | 0,05                              | 5,750 % fällig am 01.06.2028                | 900            | 923                      | 0,00                              | 4,005 % fällig am 23.04.2029           | 12.182         | 12.077                   | 0,01                              |
| 5,706 % fällig am 08.02.2028                 | 18.100         | 18.404                   | 0,02                              | 6,750 % fällig am 01.12.2033                | 1.900          | 2.031                    | 0,00                              | 4,323 % fällig am 26.04.2028           | 2.700          | 2.698                    | 0,00                              |
| 6,720 % fällig am 18.01.2029                 | 34.800         | 36.565                   | 0,04                              | Goldman Sachs Group, Inc.                   |                |                          |                                   | 4,979 % fällig am 22.07.2028           | 10.200         | 10.333                   | 0,01                              |
| 6,819 % fällig am 20.11.2029                 | 26.700         | 28.496                   | 0,03                              | 5,049 % fällig am 23.07.2030                | 73.350         | 74.585                   | 0,08                              | 4,995 % fällig am 22.07.2030           | 47.900         | 48.785                   | 0,05                              |
| 7,146 % fällig am 13.07.2027                 | 14.700         | 15.074                   | 0,02                              | 6,484 % fällig am 24.10.2029                | 131.500        | 139.512                  | 0,14                              | 5,280 % fällig am 22.07.2028           | 69.700         | 69.998                   | 0,07                              |
| East Lane Re Ltd.                            |                |                          |                                   | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.         |                |                          |                                   | 5,299 % fällig am 24.07.2029           | 2.000          | 2.054                    | 0,00                              |
| 13,544 % fällig am 31.03.2026                | 14.900         | 15.091                   | 0,02                              | 4,250 % fällig am 03.05.2030                | € 35.800       | 43.875                   | 0,04                              | 5,571 % fällig am 22.04.2028           | 49.700         | 50.739                   | 0,05                              |
| EPR Properties                               |                |                          |                                   | Goodman U.S. Finance Six LLC                |                |                          |                                   | 5,581 % fällig am 22.04.2030           | 5.100          | 5.297                    | 0,01                              |
| 3,750 % fällig am 15.08.2029                 | 2.887          | 2.750                    | 0,00                              | 5,125 % fällig am 07.10.2034                | \$ 26.900      | 26.833                   | 0,03                              | 6,070 % fällig am 22.10.2027           | 40.700         | 41.595                   | 0,04                              |
| 4,500 % fällig am 01.06.2027                 | 5.100          | 5.076                    | 0,01                              | Goodman U.S. Finance Three LLC              |                |                          |                                   | 6,087 % fällig am 23.10.2029           | 64.900         | 68.225                   | 0,07                              |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026                 | 7.623          | 7.615                    | 0,01                              | 3,700 % fällig am 15.03.2028                | 11.640         | 11.414                   | 0,01                              | Kaisa Group Holdings Ltd.              |                |                          |                                   |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028                 | 7.610          | 7.598                    | 0,01                              | Greengrove RE Ltd.                          |                |                          |                                   | 9,375 % fällig am 30.06.2024 ^         | 1.800          | 81                       | 0,00                              |
| Equinix, Inc.                                |                |                          |                                   | 12,044 % fällig am 08.04.2032               | 5.500          | 5.501                    | 0,01                              | 9,750 % fällig am 28.09.2023 ^         | 800            | 36                       | 0,00                              |
| 2,900 % fällig am 18.11.2026                 | 2.400          | 2.353                    | 0,00                              | GTA Finance Co. Pty. Ltd.                   |                |                          |                                   | 10,500 % fällig am 15.01.2025 ^        | 400            | 18                       | 0,00                              |
| Equitable America Global Funding             |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 04.12.2029                | AUD 30.700     | 20.650                   | 0,02                              | 11,250 % fällig am 16.04.2025 ^        | 800            | 36                       | 0,00                              |
| 4,650 % fällig am 09.06.2028                 | 25.890         | 26.048                   | 0,03                              | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                |                          |                                   | 11,500 % fällig am 30.01.2023 ^        | 600            | 27                       | 0,00                              |
| Equitable Financial Life Global Funding      |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 01.07.2034                | \$ 40.000      | 40.027                   | 0,04                              | 11,700 % fällig am 11.11.2025 ^        | 2.600          | 117                      | 0,00                              |
| 4,875 % fällig am 19.11.2027                 | 47.000         | 47.597                   | 0,05                              | Hardwood Funding LLC                        |                |                          |                                   | 11,950 % fällig am 12.11.2023 ^        | 800            | 36                       | 0,00                              |
| Essential Properties LP                      |                |                          |                                   | 4,840 % fällig am 07.06.2028 (I)            | 9.600          | 9.657                    | 0,01                              | KBC Group NV                           |                |                          |                                   |
| 2,950 % fällig am 15.07.2031                 | 4.000          | 3.560                    | 0,00                              | 4,980 % fällig am 07.06.2030 (I)            | 6.200          | 6.262                    | 0,01                              | 5,796 % fällig am 19.01.2029           | 18.350         | 18.953                   | 0,02                              |
| Everglades Re Ltd.                           |                |                          |                                   | Hestia Re Ltd.                              |                |                          |                                   | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. |                |                          |                                   |
| 14,794 % fällig am 13.05.2031                | 25.300         | 26.406                   | 0,03                              | 11,044 % fällig am 13.03.2032               | 1.700          | 1.682                    | 0,00                              | 3,250 % fällig am 12.11.2025           | € 29.747       | 34.692                   | 0,04                              |
| 15,794 % fällig am 13.05.2031                | 25.200         | 26.176                   | 0,03                              | 12,544 % fällig am 13.03.2032               | 1.850          | 1.826                    | 0,00                              | Kizuna RE Pte Ltd.                     |                |                          |                                   |
| 17,044 % fällig am 13.05.2031                | 16.100         | 16.688                   | 0,02                              | Hexagon RE Ltd.                             |                |                          |                                   | 7,044 % fällig am 09.04.2029           | \$ 3.200       | 3.258                    | 0,00                              |
| Extra Space Storage LP                       |                |                          |                                   | 10,394 % fällig am 07.01.2031               | € 10.684       | 12.683                   | 0,01                              | Lineage OP LP                          |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 01.07.2030                 | 47.700         | 49.498                   | 0,05                              | HLD Europe S.C.A.                           |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.07.2030           | 16.200         | 16.305                   | 0,02                              |
| F&G Annuities & Life, Inc.                   |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 02.04.2030                | 28.900         | 34.671                   | 0,04                              | Lion RE DAC                            |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 04.10.2034 (m)             | 15.500         | 15.355                   | 0,02                              | Host Hotels & Resorts LP                    |                |                          |                                   | 6,409 % fällig am 16.07.2025           | € 4.100        | 4.815                    | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 04.06.2029                 | 28.740         | 29.650                   | 0,03                              | 3,375 % fällig am 15.12.2029                | \$ 5.000       | 4.721                    | 0,00                              | Lloyds Banking Group PLC               |                |                          |                                   |
| F&G Global Funding                           |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.04.2035                | 70.100         | 69.424                   | 0,07                              | 3,750 % fällig am 11.01.2027           | \$ 18.761      | 18.605                   | 0,02                              |
| 2,000 % fällig am 20.09.2028                 | 11.900         | 10.935                   | 0,01                              | 5,700 % fällig am                           |                |                          |                                   | 4,976 % fällig am 11.08.2033           | 9.200          | 9.124                    | 0,01                              |
| 5,875 % fällig am 10.06.2027                 | 21.100         | 21.577                   | 0,02                              | 01.07.2034 (m)                              | 7.600          | 7.653                    | 0,01                              | 5,087 % fällig am 26.11.2028           | 41.600         | 42.158                   | 0,04                              |
| 5,875 % fällig am 16.01.2030                 | 29.200         | 30.045                   | 0,03                              | HSBC Holdings PLC                           |                |                          |                                   | 5,434 % fällig am 26.11.2028           | 75.600         | 75.784                   | 0,08                              |
| First American Financial Corp.               |                |                          |                                   | 3,445 % fällig am 25.09.2030                | € 42.600       | 50.613                   | 0,05                              | 5,462 % fällig am 05.01.2028           | 3.300          | 3.346                    | 0,00                              |
| 5,450 % fällig am 30.09.2034                 | 6.500          | 6.371                    | 0,01                              | 4,041 % fällig am 13.03.2028                | \$ 2.100       | 2.083                    | 0,00                              | 5,985 % fällig am 07.08.2027           | 10.000         | 10.154                   | 0,01                              |
| Ford Credit Canada Co.                       |                |                          |                                   | 4,583 % fällig am 19.06.2029                | 9.300          | 9.315                    | 0,01                              | Logicor Financing SARL                 |                |                          |                                   |
| 6,777 % fällig am 15.09.2025                 | CAD 3.700      | 2.727                    | 0,00                              | 5,887 % fällig am 14.08.2027                | 54.600         | 55.389                   | 0,06                              | 4,250 % fällig am 18.07.2029           | € 4.800        | 5.806                    | 0,01                              |
| 7,000 % fällig am 10.02.2026                 | 11.400         | 8.508                    | 0,01                              | Hudson Pacific Properties LP                |                |                          |                                   | Longleaf Pine Re Ltd.                  |                |                          |                                   |
| Ford Motor Credit Co. LLC                    |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 15.01.2030                | 500            | 409                      | 0,00                              | 21,794 % fällig am 27.05.2031          | \$ 4.100       | 4.229                    | 0,00                              |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026                 | \$ 9.684       | 9.431                    | 0,01                              | 3,950 % fällig am 01.11.2027                | 4.445          | 4.265                    | 0,00                              | LPL Holdings, Inc.                     |                |                          |                                   |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028                 | 31.586         | 29.629                   | 0,03                              | 4,650 % fällig am                           |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 03.04.2028           | 24.600         | 24.792                   | 0,03                              |
| 2,900 % fällig am 10.02.2029                 | 3.100          | 2.820                    | 0,00                              | 01.04.2029 (m)                              | 4.517          | 4.062                    | 0,00                              | 5,150 % fällig am 15.06.2030           | 43.900         | 44.462                   | 0,05                              |
| 3,815 % fällig am 02.11.2027                 | 18.474         | 17.840                   | 0,02                              | 5,950 % fällig am                           |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 15.03.2030           | 41.500         | 42.166                   | 0,04                              |
| 4,125 % fällig am 17.08.2027                 | 59.499         | 58.177                   | 0,06                              | 15.02.2028 (m)                              | 14.077         | 13.738                   | 0,01                              | 5,700 % fällig am 20.05.2027           | 17.400         | 17.736                   | 0,02                              |
| 4,271 % fällig am 09.01.2027                 | 34.965         | 34.474                   | 0,04                              | IHG Finance LLC                             |                |                          |                                   | Marex Group PLC                        |                |                          |                                   |
| 4,389 % fällig am 08.01.2026                 | 7.900          | 7.866                    | 0,01                              | 3,625 % fällig am 27.09.2031                | € 85.877       | 101.249                  | 0,10                              | 6,404 % fällig am 04.11.2029           | 36.100         | 37.174                   | 0,04                              |
| 4,542 % fällig am 01.08.2026                 | 23.738         | 23.581                   | 0,02                              | 4,375 % fällig am 28.11.2029                | 23.620         | 29.082                   | 0,03                              | Mizuho Financial Group, Inc.           |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | InCaps Funding Ltd.                         |                |                          |                                   | 5,382 % fällig am 10.07.2030           | 20.000         | 20.583                   | 0,02                              |
|                                              |                |                          |                                   | 6,591 % fällig am 01.06.2033                | \$ 1.654       | 1.638                    | 0,00                              |                                        |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                          |     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  |     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                    |    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------|-----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|-----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------|----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>MMIFS Re Ltd.</b>                                  |     |                |                          |                                   | 4,870 % fällig am 22.06.2037                  | \$  | 11.991         | \$ 11.001                | 0,01                              | <b>Societe Generale S.A.</b>                                    |    |                |                          |                                   |
| 5,548 % fällig am 10.01.2033                          | CAD | 4.500          | \$ 3.305                 | 0,00                              | 4,880 % fällig am 22.03.2037                  |     | 13.706         | 12.643                   | 0,01                              | 2,889 % fällig am 09.06.2032                                    | \$ | 14.300         | \$ 12.621                | 0,01                              |
| <b>Morgan Stanley</b>                                 |     |                |                          |                                   | 4,880 % fällig am 22.12.2036                  |     | 11.575         | 10.534                   | 0,01                              | 6,446 % fällig am 10.01.2029                                    |    | 37.400         | 38.924                   | 0,04                              |
| 0,000 % fällig am 02.04.2032 (I)                      | \$  | 68.500         | 47.550                   | 0,05                              | 4,930 % fällig am 22.12.2035                  |     | 14.865         | 14.753                   | 0,02                              | 6,447 % fällig am 12.01.2027                                    |    | 42.900         | 43.291                   | 0,04                              |
| 2,475 % fällig am 21.01.2028                          |     | 8.100          | 7.865                    | 0,01                              | 4,950 % fällig am 22.09.2037                  |     | 6.337          | 6.083                    | 0,01                              | 6,691 % fällig am 10.01.2034                                    |    | 137.100        | 146.379                  | 0,15                              |
| 3,622 % fällig am 01.04.2031                          |     | 13.200         | 12.661                   | 0,01                              | 4,960 % fällig am 22.03.2037                  |     | 11.580         | 9.785                    | 0,01                              | <b>SRC Sukuk Ltd.</b>                                           |    |                |                          |                                   |
| 3,790 % fällig am 21.03.2030                          | €   | 35.800         | 43.291                   | 0,04                              | 4,966 % fällig am 23.09.2035                  |     | 12.898         | 10.964                   | 0,01                              | 5,000 % fällig am 27.02.2028                                    |    | 140.800        | 142.055                  | 0,14                              |
| 5,042 % fällig am 19.07.2030                          | \$  | 53.400         | 54.319                   | 0,06                              | 4,980 % fällig am 22.03.2038                  |     | 0              | 0                        | 0,00                              | <b>Stellantis Finance U.S., Inc.</b>                            |    |                |                          |                                   |
| 5,123 % fällig am 01.02.2029                          |     | 59.637         | 60.692                   | 0,06                              | 5,010 % fällig am 22.12.2035                  |     | 11.612         | 10.785                   | 0,01                              | 5,350 % fällig am 17.03.2028                                    |    | 33.500         | 33.786                   | 0,03                              |
| 6,138 % fällig am 16.10.2026                          |     | 2.000          | 2.009                    | 0,00                              | 5,030 % fällig am 22.03.2038                  |     | 2.124          | 1.975                    | 0,00                              | 5,750 % fällig am 18.03.2030                                    |    | 64.900         | 65.502                   | 0,07                              |
| <b>Morgan Stanley Bank N.A.</b>                       |     |                |                          |                                   | 5,066 % fällig am 23.09.2035                  |     | 9.044          | 7.823                    | 0,01                              | 6,450 % fällig am 18.03.2035                                    |    | 49.700         | 49.964                   | 0,05                              |
| 5,030 % fällig am 15.10.2027                          |     | 37.900         | 37.933                   | 0,04                              | 5,160 % fällig am 23.03.2035                  |     | 6.457          | 6.069                    | 0,01                              | <b>Suci Second Investment Co.</b>                               |    |                |                          |                                   |
| 5,287 % fällig am 14.07.2028                          |     | 219.600        | 220.316                  | 0,22                              | 5,417 % fällig am 03.07.2033                  |     | 6.810          | 6.300                    | 0,01                              | 4,375 % fällig am 10.09.2027                                    |    | 148.000        | 147.222                  | 0,15                              |
| <b>Mutual of Omaha Cos. Global Funding</b>            |     |                |                          |                                   | 5,480 % fällig am 22.03.2038                  |     | 274            | 274                      | 0,00                              | <b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>                    |    |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 15.10.2029                          |     | 12.200         | 12.314                   | 0,01                              | <b>Prime Property</b>                         |     | 485            | 483                      | 0,00                              | 5,424 % fällig am 09.07.2031                                    |    | 57.500         | 59.693                   | 0,06                              |
| 5,000 % fällig am 01.04.2030                          |     | 23.100         | 23.553                   | 0,02                              | 5,250 % fällig am 30.09.2029 (I)              |     | 18.100         | 18.085                   | 0,02                              | <b>Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.</b>                          |    |                |                          |                                   |
| <b>Nationwide Building Society</b>                    |     |                |                          |                                   | 5,440 % fällig am 30.09.2031 (I)              |     | 18.100         | 18.042                   | 0,02                              | 4,450 % fällig am 10.09.2027                                    |    | 32.000         | 32.138                   | 0,03                              |
| 3,960 % fällig am 18.07.2030                          |     | 168.083        | 164.044                  | 0,17                              | <b>Principal Life Global Funding</b>          |     |                |                          |                                   | 5,377 % fällig am 10.09.2027                                    |    | 20.700         | 20.900                   | 0,02                              |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029                          |     | 24.100         | 23.959                   | 0,02                              | 4,600 % fällig am 19.08.2027                  |     | 10.000         | 10.060                   | 0,01                              | <b>Sunac China Holdings Ltd. (5,000 % bar oder 6,000 % PIK)</b> |    |                |                          |                                   |
| 6,557 % fällig am 18.10.2027                          |     | 107.870        | 110.620                  | 0,11                              | 4,950 % fällig am 27.11.2029                  |     | 30.500         | 31.031                   | 0,03                              | 5,000 % fällig am 30.09.2026 ^ (d)                              |    | 358            | 44                       | 0,00                              |
| <b>Nature Coast Re Ltd.</b>                           |     |                |                          |                                   | <b>Protective Life Global Funding</b>         |     |                |                          |                                   | <b>Sunac China Holdings Ltd. (5,250 % bar oder 6,250 % PIK)</b> |    |                |                          |                                   |
| 14,044 % fällig am 10.04.2033                         |     | 4.500          | 4.521                    | 0,00                              | 4,772 % fällig am 09.12.2029                  |     | 9.000          | 9.116                    | 0,01                              | 5,250 % fällig am 30.09.2027 ^ (d)                              |    | 359            | 45                       | 0,00                              |
| 14,308 % fällig am 07.12.2030                         |     | 11.206         | 11.459                   | 0,01                              | 4,803 % fällig am 05.06.2030                  |     | 8.200          | 8.306                    | 0,01                              | <b>Sunac China Holdings Ltd. (5,500 % bar oder 6,500 % PIK)</b> |    |                |                          |                                   |
| <b>NatWest Group PLC</b>                              |     |                |                          |                                   | <b>Purple Re Ltd.</b>                         |     |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 30.09.2027 ^ (d)                              |    | 720            | 90                       | 0,00                              |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030                          |     | 115.125        | 114.274                  | 0,12                              | 13,294 % fällig am 06.06.2031                 |     | 10.500         | 10.748                   | 0,01                              | <b>Sunac China Holdings Ltd. (5,750 % bar oder 6,750 % PIK)</b> |    |                |                          |                                   |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029                          |     | 35.773         | 36.139                   | 0,04                              | <b>Pyramid Funding Ltd.</b>                   |     |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 30.09.2028 ^ (d)                              |    | 1.082          | 135                      | 0,00                              |
| 4,964 % fällig am 15.08.2030                          |     | 55.600         | 56.256                   | 0,06                              | 1,000 % fällig am 28.03.2035                  | £   | 45.199         | 51.518                   | 0,05                              | <b>Sunac China Holdings Ltd. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)</b> |    |                |                          |                                   |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030                          |     | 134.670        | 136.684                  | 0,14                              | <b>Quercus Re DAC</b>                         |     |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 30.09.2029 ^ (d)                              |    | 1.085          | 136                      | 0,00                              |
| 5,583 % fällig am 01.03.2028                          |     | 22.700         | 23.115                   | 0,02                              | 10,176 % fällig am 06.01.2031                 | €   | 1.900          | 2.290                    | 0,00                              | <b>Sunac China Holdings Ltd. (6,250 % bar oder 7,250 % PIK)</b> |    |                |                          |                                   |
| 5,631 % fällig am 01.03.2028                          |     | 13.100         | 13.169                   | 0,01                              | <b>Realcredit Danmark A/S</b>                 |     |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 30.09.2030 ^ (d)                              |    | 511            | 63                       | 0,00                              |
| 5,663 % fällig am 15.11.2028                          |     | 76.600         | 77.194                   | 0,08                              | 2,500 % fällig am 01.04.2047                  | DKK | 0              | 0                        | 0,00                              | <b>Synchrony Financial</b>                                      |    |                |                          |                                   |
| 5,808 % fällig am 13.09.2029                          |     | 2.200          | 2.285                    | 0,00                              | <b>Realty Income Corp.</b>                    |     |                |                          |                                   | 5,450 % fällig am 06.03.2031 (m)                                |    | 38.700         | 39.049                   | 0,04                              |
| <b>NatWest Markets PLC</b>                            |     |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 20.06.2031                  | €   | 27.100         | 31.736                   | 0,03                              | <b>Taranis Reinsurance DAC</b>                                  |    |                |                          |                                   |
| 4,789 % fällig am 21.03.2028                          |     | 39.300         | 39.748                   | 0,04                              | 5,125 % fällig am 15.04.2035                  | \$  | 14.300         | 14.324                   | 0,01                              | 8,493 % fällig am 07.01.2031                                    | €  | 6.400          | 7.586                    | 0,01                              |
| 5,356 % fällig am 21.03.2028                          |     | 51.300         | 51.343                   | 0,05                              | <b>RGA Global Funding</b>                     |     |                |                          |                                   | 10,441 % fällig am 08.01.2031                                   |    | 9.400          | 11.341                   | 0,01                              |
| <b>Nissan Motor Acceptance Co. LLC</b>                |     |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 06.12.2031                  |     | 47.900         | 48.044                   | 0,05                              | <b>Thames Water Super Senior Issuer PLC</b>                     |    |                |                          |                                   |
| 1,850 % fällig am 16.09.2026                          |     | 3.000          | 2.863                    | 0,00                              | 5,500 % fällig am 11.01.2031                  |     | 8.600          | 8.876                    | 0,01                              | 9,750 % fällig am 10.10.2025                                    | £  | 10.013         | 12.829                   | 0,01                              |
| 2,000 % fällig am 09.03.2026                          |     | 800            | 780                      | 0,00                              | <b>Royal Bank of Canada</b>                   |     |                |                          |                                   | <b>TIB Diversified Payment Rights Finance Co.</b>               |    |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 09.03.2028                          |     | 21.400         | 19.551                   | 0,02                              | 4,510 % fällig am 18.10.2027                  |     | 62.600         | 62.740                   | 0,06                              | 7,226 % fällig am 15.11.2034                                    | \$ | 31.300         | 31.307                   | 0,03                              |
| 5,300 % fällig am 13.09.2027 (m)                      |     | 39.167         | 38.645                   | 0,04                              | 4,969 % fällig am 02.08.2030                  |     | 2.400          | 2.434                    | 0,00                              | <b>Titanium Bondco SARL (6,250 % PIK)</b>                       |    |                |                          |                                   |
| 6,950 % fällig am 15.09.2026                          |     | 3.350          | 3.391                    | 0,00                              | 5,068 % fällig am 18.10.2027                  |     | 63.100         | 63.181                   | 0,06                              | 6,250 % fällig am 14.01.2031 (d)                                | €  | 1.423          | 493                      | 0,00                              |
| <b>Nomura Holdings, Inc.</b>                          |     |                |                          |                                   | 5,069 % fällig am 23.07.2027                  |     | 28.000         | 28.195                   | 0,03                              | <b>Torrey Pines Re Ltd.</b>                                     |    |                |                          |                                   |
| 2,172 % fällig am 14.07.2028                          |     | 14.968         | 13.977                   | 0,01                              | 5,142 % fällig am 23.07.2027                  |     | 38.700         | 38.831                   | 0,04                              | 10,308 % fällig am 07.06.2032                                   | \$ | 7.700          | 7.953                    | 0,01                              |
| 4,904 % fällig am 01.07.2030 (c)                      |     | 38.000         | 38.144                   | 0,04                              | <b>Sabine Re Ltd.</b>                         |     |                |                          |                                   | 11,558 % fällig am 07.06.2032                                   |    | 4.600          | 4.801                    | 0,01                              |
| 5,591 % fällig am 02.07.2027                          |     | 35.300         | 35.552                   | 0,04                              | 12,544 % fällig am 07.04.2031                 |     | 3.400          | 3.523                    | 0,00                              | 13,308 % fällig am 05.06.2031                                   |    | 2.800          | 2.864                    | 0,00                              |
| <b>Nordea Kredit Realcreditaktieselskab</b>           |     |                |                          |                                   | <b>Sagax Euro MTN NL BV</b>                   |     |                |                          |                                   | <b>U.S. Capital Funding Ltd.</b>                                |    |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047                          | DKK | 0              | 0                        | 0,00                              | 1,625 % fällig am 24.02.2026                  | €   | 19.600         | 22.850                   | 0,02                              | 4,752 % fällig am 10.07.2043                                    |    | 3.871          | 3.252                    | 0,00                              |
| <b>Norinchukin Bank</b>                               |     |                |                          |                                   | <b>Sammons Financial Group Global Funding</b> |     |                |                          |                                   | <b>UBS AG</b>                                                   |    |                |                          |                                   |
| 5,094 % fällig am 16.10.2029                          | \$  | 9.300          | 9.439                    | 0,01                              | 5,050 % fällig am 10.01.2028                  | \$  | 14.800         | 15.024                   | 0,02                              | 5,500 % fällig am 20.08.2026                                    | €  | 54.000         | 65.705                   | 0,07                              |
| <b>Northwestern Mutual Global Funding</b>             |     |                |                          |                                   | 5,100 % fällig am 10.12.2029                  |     | 28.800         | 29.435                   | 0,03                              | 7,500 % fällig am 15.02.2028                                    | \$ | 1.950          | 2.104                    | 0,00                              |
| 5,160 % fällig am 28.05.2031                          |     | 4.500          | 4.619                    | 0,00                              | <b>Sammons Financial Group, Inc.</b>          |     |                |                          |                                   | <b>UBS Group AG</b>                                             |    |                |                          |                                   |
| <b>Nykredit Realcredit A/S</b>                        |     |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.04.2034                  |     | 10.600         | 11.375                   | 0,01                              | 1,305 % fällig am 02.02.2027                                    |    | 42.900         | 42.095                   | 0,04                              |
| 2,000 % fällig am 01.07.2037                          | DKK | 0              | 0                        | 0,00                              | <b>Santander Holdings USA, Inc.</b>           |     |                |                          |                                   | 3,091 % fällig am 14.05.2032                                    |    | 57.350         | 52.075                   | 0,05                              |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047                          |     | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,353 % fällig am 06.09.2030                  |     |                |                          |                                   | 3,126 % fällig am 13.08.2030                                    |    | 19.222         | 18.143                   | 0,02                              |
| 3,500 % fällig am 10.07.2031                          | €   | 2.700          | 3.193                    | 0,00                              | (m)                                           |     | 78.500         | 79.928                   | 0,08                              | 3,869 % fällig am 12.01.2029                                    |    | 5.750          | 5.663                    | 0,01                              |
| 3,625 % fällig am 24.07.2030                          |     | 4.600          | 5.498                    | 0,01                              | 5,473 % fällig am 20.03.2029                  |     | 44.000         | 44.747                   | 0,05                              | 4,194 % fällig am 01.04.2031                                    |    | 85.537         | 83.780                   | 0,08                              |
| <b>Omega Healthcare Investors, Inc.</b>               |     |                |                          |                                   | 5,741 % fällig am 20.03.2031                  |     | 34.200         | 35.120                   | 0,04                              | 4,282 % fällig am 09.01.2028                                    |    | 1.800          | 1.792                    | 0,00                              |
| 5,200 % fällig am 01.07.2030                          | \$  | 47.200         | 47.484                   | 0,05                              | 6,016 % fällig am 20.03.2029                  |     | 39.900         | 40.313                   | 0,04                              | 5,428 % fällig am 08.02.2030                                    |    | 15.000         | 15.409                   | 0,02                              |
| <b>Orange Capital RE DAC</b>                          |     |                |                          |                                   | <b>Santander UK Group Holdings PLC</b>        |     |                |                          |                                   | 5,959 % fällig am 12.01.2034                                    |    | 93.281         | 98.234                   | 0,10                              |
| 8,323 % fällig am 17.01.2029                          | €   | 1.200          | 1.407                    | 0,00                              | 2,469 % fällig am 11.01.2028                  |     | 20.600         | 19.950                   | 0,02                              | 6,246 % fällig am 22.09.2029                                    |    | 66.800         | 70.188                   | 0,07                              |
| 9,793 % fällig am 08.01.2027                          |     | 9.900          | 11.824                   | 0,01                              | 3,823 % fällig am 03.11.2028                  |     | 25.600         | 25.095                   | 0,03                              | 6,327 % fällig am 22.12.2027                                    |    | 30.800         | 31.632                   | 0,03                              |
| <b>Pacific Life Global Funding</b>                    |     |                |                          |                                   | 4,858 % fällig am 11.09.2030                  |     | 91.100         | 91.012                   | 0,09                              | 6,442 % fällig am 11.08.2028                                    |    | 110.350        | 114.681                  | 0,12                              |
| 4,850 % fällig am 10.02.2030                          | \$  | 9.800          | 9.956                    | 0,01                              | 5,694 % fällig am 15.04.2031                  |     | 68.000         | 70.165                   | 0,07                              | 6,537 % fällig am 12.08.2033                                    |    | 122.623        | 133.422                  | 0,13                              |
| <b>Palm RE Ltd.</b>                                   |     |                |                          |                                   | 6,534 % fällig am 10.01.2029                  |     | 3.300          | 3.445                    | 0,00                              | 6,537 % fällig am 12.08.2033                                    |    | 59.850         | 65.121                   | 0,07                              |
| 12,058 % fällig am 07.06.2032                         |     | 3.000          | 3.006                    | 0,00                              | 7,482 % fällig am 29.08.2029                  | £   | 46.210         | 68.071                   | 0,07                              | 7,750 % fällig am 01.03.2029                                    | €  | 104.080        | 137.691                  | 0,14                              |
| 13,794 % fällig am 09.06.2031                         |     | 900            | 923                      | 0,00                              | <b>SBA Tower Trust</b>                        |     |                |                          |                                   | 9,016 % fällig am 15.11.2033                                    | \$ | 38.550         | 47.678                   | 0,05                              |
| <b>Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC</b> |     |                |                          |                                   | 4,831 % fällig am 15.10.2029                  | \$  | 100.000        | 100.209                  | 0,10                              | <b>Uniti Group LP</b>                                           |    |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 05.04.2032 (f)                      |     | 135.733        | 96.592                   | 0,10                              | <b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b> |     |                |                          |                                   | 10,500 % fällig am 15.02.2028                                   |    | 57.229         | 60.708                   | 0,06                              |
| <b>Paychex, Inc.</b>                                  |     |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^                |     | 6.100          | 366                      | 0,00                              | <b>Ursa Re Ltd.</b>                                             |    |                |                          |                                   |
| 5,100 % fällig am 15.04.2030                          |     | 1.600          | 1.639                    | 0,00                              | <b>Selective Insurance Group, Inc.</b>        |     |                |                          |                                   | 9,610 % fällig am 07.12.2026                                    |    | 19.400         | 20.001                   | 0,02                              |
| 5,350 % fällig am 15.04.2032                          |     | 2.100          | 2.157                    | 0,00                              | 5,900 % fällig am 15.04.2035 (m)              |     | 7.700          | 7.878                    | 0,01                              | 11,794 % fällig am 22.02.2028                                   |    | 13.100         | 13.177                   | 0,01                              |
| 5,600 % fällig am 15.04.2035                          |     | 1.200          | 1.241                    | 0,00                              | <b>Sirius Real Estate Ltd.</b>                |     |                |                          |                                   | 13,044 % fällig am 07.12.2026                                   |    | 24.900         | 25.927                   | 0,03                              |
| <b>Polestar Re Ltd.</b>                               |     |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 22.06.2026                  | €   | 18.900         | 21.783                   | 0,02                              | <b>VD DPR Finance Co.</b>                                       |    |                |                          |                                   |
| 14,794 % fällig am 07.01.2028                         |     | 8.500          | 8.769                    | 0,01                              | 1,750 % fällig am 24.11.2028                  |     | 7.500          | 8.348                    | 0,01                              | 6,833 % fällig am 15.03.2035 (I)                                |    | 27.500         | 26.961                   | 0,03                              |
| 17,544 % fällig am 07.01.2027                         |     | 14.000         | 14.626                   | 0,02                              | <b>SLM Student Loan Trust</b>                 |     |                |                          |                                   | <b>Veraison Re Ltd.</b>                                         |    |                |                          |                                   |
| <b>Preferred Term Securities Ltd.</b>                 |     |                |                          |                                   | 2,525 % fällig am 15.12.2033                  |     | 7.604          | 8.443                    | 0,01                              | 9,294 % fällig am 08.03.2033                                    |    |                |                          |                                   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| 3,875 % fällig am 15.02.2029         | \$ 32.080       | \$ 31.053                 | 0,03                              | Bayer U.S. Finance LLC                        |                 |                           |                                   | Dell International LLC                 |                 |                           |                                   |
| 4,125 % fällig am 15.08.2030         | 14.516          | 13.939                    | 0,01                              | 4,250 % fällig am 15.12.2025                  | \$ 8.400        | \$ 8.377                  | 0,01                              | 4,750 % fällig am 01.04.2028           | \$ 42.800       | \$ 43.310                 | 0,04                              |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026         | 31.400          | 31.220                    | 0,03                              | 4,375 % fällig am 15.12.2028                  | 60.775          | 60.224                    | 0,06                              | 5,000 % fällig am 01.04.2030           | 18.000          | 18.294                    | 0,02                              |
| 4,500 % fällig am 01.09.2026         | 11.028          | 11.000                    | 0,01                              | 6,125 % fällig am 21.11.2026                  | 110.041         | 111.871                   | 0,11                              | Delta Air Lines Pass-Through Trust     |                 |                           |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028         | 2.000           | 1.992                     | 0,00                              | 6,250 % fällig am 21.01.2029 (m)              | 83.902          | 88.123                    | 0,09                              | 2,000 % fällig am 10.12.2029           | 1.858           | 1.749                     | 0,00                              |
| 4,625 % fällig am 01.12.2029         | 42.575          | 41.845                    | 0,04                              | 6,375 % fällig am 21.11.2030                  | 99.071          | 105.315                   | 0,11                              | Devon Energy Corp.                     |                 |                           |                                   |
| 4,750 % fällig am 01.04.2028         | 13.400          | 13.513                    | 0,01                              | 6,500 % fällig am 21.11.2033 (m)              | 86.621          | 92.916                    | 0,09                              | 5,200 % fällig am 15.09.2034 (m)       | 26.800          | 26.042                    | 0,03                              |
| 4,950 % fällig am 15.02.2030         | 28.400          | 28.579                    | 0,03                              | 6,875 % fällig am 21.11.2053 (m)              | 4.600           | 4.888                     | 0,01                              | Diamondback Energy, Inc.               |                 |                           |                                   |
| 5,125 % fällig am 15.11.2031         | 28.100          | 28.155                    | 0,03                              | Biocanico Sovereign Certificate Ltd.          |                 |                           |                                   | 5,550 % fällig am 01.04.2035 (m)       | 27.400          | 27.710                    | 0,03                              |
| 5,625 % fällig am 01.04.2035         | 36.200          | 36.547                    | 0,04                              | 0,000 % fällig am 05.06.2034 (f)              | 999             | 795                       | 0,00                              | DISH DBS Corp.                         |                 |                           |                                   |
| 5,750 % fällig am 01.02.2027         | 28.055          | 28.452                    | 0,03                              | BMW U.S. Capital LLC                          |                 |                           |                                   | 5,250 % fällig am 01.12.2026           | 115.270         | 104.824                   | 0,11                              |
| 5,750 % fällig am 01.04.2034         | 6.200           | 6.342                     | 0,01                              | 4,650 % fällig am 19.03.2027                  | 24.100          | 24.246                    | 0,02                              | 5,750 % fällig am 01.12.2028           | 117.000         | 101.497                   | 0,10                              |
| Vitality Re Ltd.                     |                 |                           |                                   | 4,750 % fällig am 21.03.2028                  | 46.300          | 46.844                    | 0,05                              | Enbridge, Inc.                         |                 |                           |                                   |
| 6,044 % fällig am 08.01.2030         | 2.900           | 2.905                     | 0,00                              | 5,185 % fällig am 19.03.2027                  | 35.400          | 35.435                    | 0,04                              | 4,600 % fällig am 20.06.2028           | 11.500          | 11.589                    | 0,01                              |
| 8,044 % fällig am 08.01.2030         | 2.400           | 2.408                     | 0,00                              | 5,326 % fällig am 21.03.2028                  | 64.500          | 64.345                    | 0,07                              | Energy Transfer LP                     |                 |                           |                                   |
| Voyager Aviation Holdings LLC        |                 |                           |                                   | Boeing Co.                                    |                 |                           |                                   | 4,950 % fällig am 15.05.2028           | 2.500           | 2.536                     | 0,00                              |
| 8,500 % fällig am 09.05.2026 ^       | 2.097           | 0                         | 0,00                              | 2,196 % fällig am 04.02.2026                  | 111.710         | 109.982                   | 0,11                              | 5,200 % fällig am 01.04.2030           | 1.400           | 1.432                     | 0,00                              |
| Wells Fargo & Co.                    |                 |                           |                                   | 2,750 % fällig am 01.02.2026                  | 11.164          | 11.038                    | 0,01                              | 5,250 % fällig am 01.07.2029           | 11.300          | 11.580                    | 0,01                              |
| 3,526 % fällig am 24.03.2028         | 1.500           | 1.479                     | 0,00                              | 3,250 % fällig am 01.02.2028                  | 7.800           | 7.567                     | 0,01                              | 5,600 % fällig am 01.09.2034 (m)       | 20.550          | 20.881                    | 0,02                              |
| 5,420 % fällig am 22.04.2028         | 64.500          | 64.956                    | 0,07                              | 5,150 % fällig am 01.05.2030                  | 34.200          | 34.835                    | 0,04                              | 5,700 % fällig am 01.04.2035           | 6.800           | 6.929                     | 0,01                              |
| 5,707 % fällig am 22.04.2028         | 25.000          | 25.551                    | 0,03                              | 6,259 % fällig am 01.05.2027                  | 76.037          | 78.259                    | 0,08                              | 6,050 % fällig am 01.12.2026           | 18.300          | 18.691                    | 0,02                              |
| 6,303 % fällig am 23.10.2029         | 58.800          | 62.155                    | 0,06                              | 6,298 % fällig am 01.05.2029                  | 99.120          | 104.817                   | 0,11                              | 6,050 % fällig am 01.09.2054           | 25.000          | 24.050                    | 0,02                              |
| Winston RE Ltd.                      |                 |                           |                                   | 6,388 % fällig am 01.05.2031                  | 24.800          | 26.663                    | 0,03                              | 6,100 % fällig am 01.12.2028           | 250             | 263                       | 0,00                              |
| 10,808 % fällig am 21.02.2028        | 1.000           | 1.016                     | 0,00                              | 6,528 % fällig am 01.05.2034 (m)              | 39.700          | 43.161                    | 0,04                              | 6,400 % fällig am 01.12.2030           | 19.000          | 20.484                    | 0,02                              |
| 16,044 % fällig am 26.02.2031        | 2.400           | 2.524                     | 0,00                              | Booz Allen Hamilton, Inc.                     |                 |                           |                                   | Essent Group Ltd.                      |                 |                           |                                   |
| Yango Group Co. Ltd.                 |                 |                           |                                   | 5,950 % fällig am 15.04.2035 (m)              | 16.400          | 16.685                    | 0,02                              | 6,250 % fällig am 01.07.2029           | 21.900          | 22.694                    | 0,02                              |
| 6,900 % fällig am 31.10.2022 ^       | CNY 50.000      | 199                       | 0,00                              | British Airways Pass-Through Trust            |                 |                           |                                   | Exela Intermediate LLC (11,500 % PIK)  |                 |                           |                                   |
|                                      |                 | 15.398.988                | 15,55                             | 2,900 % fällig am 15.09.2036                  | 6.317           | 5.705                     | 0,01                              | 11,500 % fällig am 15.04.2026 (d)      | 5.303           | 265                       | 0,00                              |
| INDUSTRIEWERTE                       |                 |                           |                                   | 3,300 % fällig am 15.06.2034                  | 2.883           | 2.685                     | 0,00                              | Expand Energy Corp.                    |                 |                           |                                   |
| Air Canada Pass-Through Trust        |                 |                           |                                   | 3,800 % fällig am 20.03.2033                  | 1.861           | 1.803                     | 0,00                              | 5,700 % fällig am 15.01.2035           | 20.100          | 20.404                    | 0,02                              |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031         | \$ 1.735        | 1.625                     | 0,00                              | 4,250 % fällig am 15.05.2034                  | 10.407          | 10.003                    | 0,01                              | Flora Food Management BV               |                 |                           |                                   |
| 3,600 % fällig am 15.09.2028         | 825             | 806                       | 0,00                              | Broadcom, Inc.                                |                 |                           |                                   | 6,875 % fällig am 02.07.2029           | € 39.200        | 46.786                    | 0,05                              |
| 5,250 % fällig am 01.10.2030         | 24.557          | 24.816                    | 0,03                              | 2,450 % fällig am 15.02.2031                  | 31.000          | 27.730                    | 0,03                              | Flutter Treasury DAC                   |                 |                           |                                   |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust   |                 |                           |                                   | 2,600 % fällig am 15.02.2033                  | 8.410           | 7.196                     | 0,01                              | 6,375 % fällig am 29.04.2029           | \$ 5.000        | 5.153                     | 0,01                              |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029         | 16.423          | 16.451                    | 0,02                              | 3,187 % fällig am 15.11.2036                  | 24.404          | 20.241                    | 0,02                              | Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.      |                 |                           |                                   |
| Altice France S.A.                   |                 |                           |                                   | 3,419 % fällig am 15.04.2033                  | 3.720           | 3.375                     | 0,00                              | 4,950 % fällig am 23.03.2027           | 20.300          | 17.762                    | 0,02                              |
| 3,375 % fällig am 15.01.2028         | € 12.400        | 12.223                    | 0,01                              | 3,469 % fällig am 15.04.2034                  | 41.233          | 36.849                    | 0,04                              | 4,950 % fällig am 06.02.2028           | 24.600          | 19.926                    | 0,02                              |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029         | 1.400           | 1.382                     | 0,00                              | 4,150 % fällig am 15.02.2028                  | 34.700          | 34.606                    | 0,04                              | 5,150 % fällig am 11.02.2026           | 32.700          | 30.248                    | 0,03                              |
| 4,125 % fällig am 15.01.2029         | 2.800           | 2.774                     | 0,00                              | 4,350 % fällig am 15.02.2030                  | 33.400          | 33.285                    | 0,03                              | 7,288 % fällig am 16.08.2037           | 18.510          | 14.808                    | 0,02                              |
| 4,250 % fällig am 15.10.2029         | 13.600          | 13.436                    | 0,01                              | 4,550 % fällig am 15.02.2032                  | 32.000          | 31.716                    | 0,03                              | 8,625 % fällig am 28.04.2034           | 38.699          | 33.862                    | 0,03                              |
| 5,125 % fällig am 15.01.2029         | \$ 1.360        | 1.125                     | 0,00                              | 4,800 % fällig am 15.10.2034 (m)              | 58.500          | 57.819                    | 0,06                              | Global Payments, Inc.                  |                 |                           |                                   |
| 5,125 % fällig am 15.07.2029         | 13.811          | 11.429                    | 0,01                              | 5,050 % fällig am 12.07.2027                  | 30.900          | 31.354                    | 0,03                              | 1,200 % fällig am 01.03.2026           | 2.664           | 2.602                     | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028         | 19.615          | 16.526                    | 0,02                              | 5,050 % fällig am 12.07.2029                  | 73.700          | 75.498                    | 0,08                              | 4,875 % fällig am 17.03.2031           | € 14.250        | 17.591                    | 0,02                              |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029         | 10.100          | 8.383                     | 0,01                              | 5,150 % fällig am 15.11.2031                  | 14.500          | 14.923                    | 0,02                              | Greene King Finance PLC                |                 |                           |                                   |
| 5,875 % fällig am 01.02.2027         | € 20.100        | 21.304                    | 0,02                              | Burberry Group PLC                            |                 |                           |                                   | 4,064 % fällig am 15.03.2035           | £ 3.266         | 4.240                     | 0,00                              |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027         | \$ 51.000       | 45.939                    | 0,05                              | 5,750 % fällig am 20.06.2030                  | £ 55.200        | 75.730                    | 0,08                              | 5,106 % fällig am 15.03.2034           | 2.617           | 3.556                     | 0,00                              |
| Altrad Investment Authority S.A.S.   |                 |                           |                                   | Canadian Natural Resources Ltd.               |                 |                           |                                   | Harbour Energy PLC                     |                 |                           |                                   |
| 3,704 % fällig am 23.06.2029         | € 15.000        | 17.635                    | 0,02                              | 5,000 % fällig am 15.12.2029                  | \$ 18.900       | 19.080                    | 0,02                              | 6,327 % fällig am 01.04.2035 (m)       | \$ 27.300       | 27.168                    | 0,03                              |
| 4,429 % fällig am 23.06.2032         | 16.700          | 19.630                    | 0,02                              | 5,400 % fällig am 15.12.2034 (m)              | 19.100          | 18.987                    | 0,02                              | HCA, Inc.                              |                 |                           |                                   |
| Amdocs Ltd.                          |                 |                           |                                   | Carnival Corp.                                |                 |                           |                                   | 5,000 % fällig am 01.03.2028           | 1.400           | 1.421                     | 0,00                              |
| 2,538 % fällig am 15.06.2030         | \$ 11.200       | 10.151                    | 0,01                              | 4,000 % fällig am 01.08.2028                  | 65.676          | 64.321                    | 0,07                              | 5,250 % fällig am 01.03.2030           | 3.400           | 3.487                     | 0,00                              |
| American Airlines Pass-Through Trust |                 |                           |                                   | Carvana Co. (13,000 % PIK)                    |                 |                           |                                   | 5,257 % fällig am 01.03.2028           | 21.100          | 21.229                    | 0,02                              |
| 2,875 % fällig am 11.01.2036         | 13.171          | 11.631                    | 0,01                              | 13,000 % fällig am 01.06.2030 (d)             | 105.406         | 110.915                   | 0,11                              | 5,450 % fällig am 01.04.2031           | 26.300          | 27.127                    | 0,03                              |
| 3,000 % fällig am 15.04.2030         | 2.351           | 2.227                     | 0,00                              | Carvana Co. (14,000 % PIK)                    |                 |                           |                                   | 5,500 % fällig am 01.03.2032           | 10.700          | 11.048                    | 0,01                              |
| 3,150 % fällig am 15.08.2033         | 656             | 604                       | 0,00                              | 14,000 % fällig am 01.06.2031 (d)             | 131.558         | 151.508                   | 0,15                              | Hyatt Hotels Corp.                     |                 |                           |                                   |
| 3,200 % fällig am 15.12.2029         | 2.792           | 2.680                     | 0,00                              | CDW LLC                                       |                 |                           |                                   | 5,050 % fällig am 30.03.2028           | 11.600          | 11.729                    | 0,01                              |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031         | 10.069          | 9.596                     | 0,01                              | 2,670 % fällig am 01.12.2026                  | 10.600          | 10.341                    | 0,01                              | 5,250 % fällig am 30.06.2029           | 400             | 407                       | 0,00                              |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028         | 19.956          | 19.465                    | 0,02                              | 3,569 % fällig am 01.12.2031                  | 28.300          | 26.067                    | 0,03                              | 5,375 % fällig am 15.12.2031           | 22.800          | 23.130                    | 0,02                              |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029         | 8.284           | 8.033                     | 0,01                              | 5,100 % fällig am 01.03.2030                  | 18.400          | 18.544                    | 0,02                              | 5,750 % fällig am 30.03.2032           | 12.900          | 13.248                    | 0,01                              |
| 3,600 % fällig am 22.03.2029         | 1.549           | 1.508                     | 0,00                              | Centene Corp.                                 |                 |                           |                                   | Hyundai Capital America                |                 |                           |                                   |
| 3,650 % fällig am 15.08.2030         | 1.845           | 1.786                     | 0,00                              | 2,500 % fällig am 01.03.2031                  | 16.900          | 14.562                    | 0,01                              | 4,300 % fällig am 24.09.2027           | 73.900          | 73.321                    | 0,07                              |
| 3,700 % fällig am 01.04.2028         | 25.690          | 25.245                    | 0,03                              | 2,625 % fällig am 01.08.2031                  | 28.100          | 24.096                    | 0,02                              | 5,300 % fällig am 19.03.2027           | 31.800          | 32.160                    | 0,03                              |
| 4,000 % fällig am 15.08.2030         | 4.551           | 4.360                     | 0,00                              | 3,000 % fällig am 15.10.2030                  | 14.300          | 12.787                    | 0,01                              | 5,350 % fällig am 19.03.2029           | 15.900          | 16.208                    | 0,02                              |
| AppLovin Corp.                       |                 |                           |                                   | 3,375 % fällig am 15.02.2030                  | 12.800          | 11.799                    | 0,01                              | 5,445 % fällig am 19.03.2027           | 24.700          | 24.674                    | 0,03                              |
| 5,125 % fällig am 01.12.2029 (m)     | 48.400          | 49.044                    | 0,05                              | 4,250 % fällig am 15.12.2027                  | 43.130          | 42.503                    | 0,04                              | Icon Investments Six DAC               |                 |                           |                                   |
| Bacardi-Martini BV                   |                 |                           |                                   | 4,625 % fällig am 15.12.2029                  | 33.300          | 32.411                    | 0,03                              | 5,809 % fällig am 08.05.2027           | 31.389          | 32.057                    | 0,03                              |
| 5,550 % fällig am 01.02.2030         | 33.550          | 34.448                    | 0,03                              | CGI, Inc.                                     |                 |                           |                                   | 5,849 % fällig am 08.05.2029           | 20.100          | 20.861                    | 0,02                              |
| 6,000 % fällig am 01.02.2035         | 18.750          | 19.378                    | 0,02                              | 1,450 % fällig am 14.09.2026                  | 8.100           | 7.826                     | 0,01                              | Illumina, Inc.                         |                 |                           |                                   |
| Barry Callebaut Services NV          |                 |                           |                                   | 2,300 % fällig am 14.09.2031                  | 2.933           | 2.538                     | 0,00                              | 2,550 % fällig am 23.03.2031           | 7.000           | 6.158                     | 0,01                              |
| 3,750 % fällig am 19.02.2028         | € 28.500        | 33.781                    | 0,03                              | 4,950 % fällig am 14.03.2030                  | 42.900          | 43.340                    | 0,04                              | 4,650 % fällig am 09.09.2026           | 40.700          | 40.759                    | 0,04                              |
| BAT Capital Corp.                    |                 |                           |                                   | Claritev Corp. (6,000 % bar oder 0,750 % PIK) |                 |                           |                                   | Imperial Brands Finance Netherlands BV |                 |                           |                                   |
| 5,834 % fällig am 20.02.2031         | \$ 21.400       | 22.528                    | 0,02                              | 6,750 % fällig am 31.03.2031 (d)              | 23.200          | 16.356                    | 0,02                              | 1,750 % fällig am 18.03.2033           | € 31.690        | 32.104                    | 0,03                              |
| 6,421 % fällig am 02.08.2033         | 4.300           | 4.672                     | 0,00                              | CVS Pass-Through Trust                        |                 |                           |                                   | 5,250 % fällig am 15.02.2031           | 32.457          | 41.263                    | 0,04                              |
| BAT International Finance PLC        |                 |                           |                                   | 4,163 % fällig am 11.08.2036                  | 1.239           | 1.147                     | 0,00                              | Imperial Brands Finance PLC            |                 |                           |                                   |
| 5,931 % fällig am 02.02.2029 (m)     | 44.000          | 46.189                    | 0,05                              | 4,704 % fällig am 10.01.2036                  | 4.621           | 4.430                     | 0,00                              | 3,500 % fällig am 26.07.2026           | \$ 30.555       | 30.200                    | 0,03                              |
|                                      |                 |                           |                                   | 5,926 % fällig am 10.01.2034                  | 634             | 641                       | 0,00                              | 3,875 % fällig am 12.02.2034           | € 32.100        | 37.081                    | 0,04                              |
|                                      |                 |                           |                                   | 6,036 % fällig am 10.12.2028                  | 1.691           | 1.715                     | 0,00                              | 4,500 % fällig am 30.06.2028 (c)       | \$ 23.700       | 23.701                    | 0,02                              |
|                                      |                 |                           |                                   | 6,943 % fällig am 10.01.2030                  | 3.816           | 3.940                     | 0,00                              |                                        |                 |                           |                                   |
|                                      |                 |                           |                                   | 7,507 % fällig am 10.01.2032                  | 4.830           | 5.060                     | 0,01                              |                                        |                 |                           |                                   |
|                                      |                 |                           |                                   | 8,353 % fällig am 10.07.2031                  | 3.763           | 4.084                     | 0,00                              |                                        |                 |                           |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Incora Intermediate LLC (0,000 % bar oder 0,500 % PIK)</b> |                |                          |                                   | <b>Rolls-Royce PLC</b>                      |                |                          |                                   | <b>Verisk Analytics, Inc.</b>                  |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 31.01.2030 (d)                              | \$ 10.106      | \$10.106                 | 0,01                              | 3,375 % fällig am 18.06.2026                | £ 2.098        | \$ 2.846                 | 0,00                              | 5,250 % fällig am 15.03.2035                   | \$ 40.500      | \$ 40.746                | 0,04                              |
| <b>Informa PLC</b>                                            |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 16.02.2026                | € 16.896       | 20.010                   | 0,02                              | <b>Volkswagen Group of America Finance LLC</b> |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 09.06.2031                                  | € 16.500       | 19.277                   | 0,02                              | 5,750 % fällig am 15.10.2027                | \$ 121.023     | 124.296                  | 0,13                              | 5,050 % fällig am 27.03.2028                   | 70.300         | 70.722                   | 0,07                              |
| <b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b>                         |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.10.2027                | £ 22.371       | 31.457                   | 0,03                              | 5,250 % fällig am 22.03.2029                   | 93.500         | 94.629                   | 0,10                              |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030                                  | \$ 290.777     | 297.231                  | 0,30                              | <b>Royalty Pharma PLC</b>                   |                |                          |                                   | <b>Warnermedia Holdings, Inc.</b>              |                |                          |                                   |
| <b>Ipsen S.A.</b>                                             |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 02.09.2027                | \$ 24.384      | 23.099                   | 0,02                              | 3,755 % fällig am 15.03.2027                   | 5.300          | 5.168                    | 0,01                              |
| 3,875 % fällig am 25.03.2032                                  | € 20.000       | 23.664                   | 0,02                              | <b>Russian Railways Via RZD Capital PLC</b> |                |                          |                                   | <b>Whitbread Group PLC</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>JDE Peet's NV</b>                                          |                |                          |                                   | 7,487 % fällig am 25.03.2031 ^              | £ 13.950       | 13.381                   | 0,01                              | 5,500 % fällig am 31.05.2032                   | £ 33.600       | 45.748                   | 0,05                              |
| 2,250 % fällig am 24.09.2031                                  | \$ 7.422       | 6.333                    | 0,01                              | <b>Saudi Arabian Oil Co.</b>                |                |                          |                                   | <b>Windstream Services LLC</b>                 |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 23.01.2030                                  | € 5.200        | 6.357                    | 0,01                              | 5,875 % fällig am 17.07.2064                | \$ 50.700      | 46.389                   | 0,05                              | 8,250 % fällig am 01.10.2031                   | \$ 186.950     | 195.950                  | 0,20                              |
| 4,500 % fällig am 23.01.2034                                  | 22.171         | 27.257                   | 0,03                              | <b>Spirit Airlines Pass-Through Trust</b>   |                |                          |                                   | <b>Woodside Finance Ltd.</b>                   |                |                          |                                   |
| <b>JetBlue Pass-Through Trust</b>                             |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.08.2031                | 2.262          | 2.007                    | 0,00                              | 5,100 % fällig am 12.09.2034                   | 24.400         | 23.640                   | 0,02                              |
| 2,750 % fällig am 15.11.2033                                  | \$ 3.571       | 3.133                    | 0,00                              | 4,100 % fällig am 01.10.2029                | 7.951          | 7.306                    | 0,01                              | <b>Yorkshire Water Finance PLC</b>             |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034                                  | 33.622         | 31.555                   | 0,03                              | <b>Synopsys, Inc.</b>                       |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 18.11.2034                   | £ 48.930       | 69.307                   | 0,07                              |
| <b>JT International Financial Services BV</b>                 |                |                          |                                   | 4,550 % fällig am 01.04.2027                | 11.200         | 11.261                   | 0,01                              |                                                |                | 7.760.333                | 7,83                              |
| 3,625 % fällig am 11.04.2034                                  | € 57.700       | 66.986                   | 0,07                              | 4,650 % fällig am 01.04.2028                | 5.100          | 5.153                    | 0,01                              | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>LG Energy Solution Ltd.</b>                                |                |                          |                                   | 4,850 % fällig am 01.04.2030                | 18.900         | 19.168                   | 0,02                              | <b>Chile Electricity Lux MPC SARL</b>          |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 02.04.2028                                  | \$ 26.900      | 27.011                   | 0,03                              | 5,000 % fällig am 01.04.2032                | 23.300         | 23.611                   | 0,02                              | 5,580 % fällig am 20.10.2035                   | \$ 83.968      | 84.100                   | 0,09                              |
| <b>Market Bidco Finco PLC</b>                                 |                |                          |                                   | 5,150 % fällig am 01.04.2035                | 14.100         | 14.218                   | 0,01                              | <b>Dominion Energy, Inc.</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 04.11.2027                                  | € 13.400       | 15.694                   | 0,02                              | <b>Tennessee Gas Pipeline Co. LLC</b>       |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.06.2030                   | 47.900         | 48.904                   | 0,05                              |
| <b>Marriott International, Inc.</b>                           |                |                          |                                   | 2,900 % fällig am 01.03.2030                | 8.200          | 7.577                    | 0,01                              | <b>Edison International</b>                    |                |                          |                                   |
| 5,100 % fällig am 15.04.2032                                  | \$ 1.100       | 1.113                    | 0,00                              | <b>Thames Water Super Senior Issuer PLC</b> |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.03.2032                   | 15.600         | 14.809                   | 0,02                              |
| <b>Mars, Inc.</b>                                             |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 10.10.2027                | £ 9.944        | 14.995                   | 0,02                              | 6,250 % fällig am 15.03.2030                   | 20.900         | 21.234                   | 0,02                              |
| 4,600 % fällig am 01.03.2028                                  | 66.100         | 66.651                   | 0,07                              | <b>Thames Water Utilities Finance PLC</b>   |                |                          |                                   | <b>Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC</b>        |                |                          |                                   |
| <b>Microchip Technology, Inc.</b>                             |                |                          |                                   | 0,875 % fällig am 31.01.2030                | € 21.300       | 15.917                   | 0,02                              | 2,950 % fällig am 27.01.2029                   | 183.800        | 131.417                  | 0,13                              |
| 4,900 % fällig am 15.03.2028                                  | 21.200         | 21.438                   | 0,02                              | 1,250 % fällig am 31.01.2034                | 7.940          | 6.012                    | 0,01                              | <b>NorthWestern Corp.</b>                      |                |                          |                                   |
| 5,050 % fällig am 15.02.2030                                  | 49.054         | 49.781                   | 0,05                              | 1,604 % fällig am 23.12.2029                | \$ 5.800       | 3.791                    | 0,00                              | 5,073 % fällig am 21.03.2030                   | 28.200         | 28.658                   | 0,03                              |
| <b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>                    |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 22.04.2042                | £ 700          | 635                      | 0,00                              | <b>Oncor Electric Delivery Co. LLC</b>         |                |                          |                                   |
| 5,111 % fällig am 15.12.2030                                  | 2.640          | 2.549                    | 0,00                              | 2,625 % fällig am 24.01.2034                | 10.300         | 9.214                    | 0,01                              | 4,500 % fällig am 20.03.2027                   | 31.000         | 31.165                   | 0,03                              |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030                                  | £ 4.034        | 5.577                    | 0,01                              | 3,500 % fällig am 25.02.2030                | 4.800          | 4.365                    | 0,00                              | <b>ONEOK, Inc.</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>MPH Acquisition Holdings LLC</b>                           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 19.06.2027                | 11.300         | 10.887                   | 0,01                              | 4,750 % fällig am 15.10.2031                   | 29.400         | 29.125                   | 0,03                              |
| 5,750 % fällig am 31.12.2030                                  | \$ 2.687       | 2.216                    | 0,00                              | 4,000 % fällig am 18.04.2029                | € 7.400        | 5.694                    | 0,01                              | <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>          |                |                          |                                   |
| 11,500 % fällig am 31.12.2030                                 | 4.113          | 4.082                    | 0,00                              | 4,375 % fällig am 18.01.2033                | 54.200         | 41.640                   | 0,04                              | 2,100 % fällig am 01.08.2027                   | 12.877         | 12.200                   | 0,01                              |
| <b>NetApp, Inc.</b>                                           |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 03.07.2036                | £ 10.600       | 9.545                    | 0,01                              | 2,500 % fällig am 01.02.2031                   | 13.491         | 11.718                   | 0,01                              |
| 5,500 % fällig am 17.03.2032                                  | 13.700         | 14.116                   | 0,01                              | 4,625 % fällig am 04.06.2048                | 5.300          | 4.828                    | 0,01                              | 2,950 % fällig am 01.03.2026                   | 104.155        | 102.802                  | 0,10                              |
| 5,700 % fällig am 17.03.2035                                  | 17.700         | 18.184                   | 0,02                              | 5,125 % fällig am 28.09.2039                | 5.800          | 5.340                    | 0,01                              | 3,000 % fällig am 15.06.2028                   | 31.800         | 30.209                   | 0,03                              |
| <b>Nissan Motor Co. Ltd.</b>                                  |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 11.02.2043                | 5.500          | 5.013                    | 0,01                              | 3,150 % fällig am 01.01.2026                   | 62.792         | 62.199                   | 0,06                              |
| 3,522 % fällig am 17.09.2025                                  | 58.000         | 57.677                   | 0,06                              | 6,500 % fällig am 09.02.2034                | 2.500          | 2.306                    | 0,00                              | 3,250 % fällig am 01.06.2031                   | 37.030         | 33.253                   | 0,03                              |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027                                  | 83.324         | 80.049                   | 0,08                              | 7,125 % fällig am 30.04.2033                | 7.800          | 7.278                    | 0,01                              | 3,300 % fällig am 15.03.2027                   | 19.465         | 19.022                   | 0,02                              |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 (m)                              | 43.097         | 39.567                   | 0,04                              | 7,750 % fällig am 30.04.2046                | 5.900          | 5.523                    | 0,01                              | 3,300 % fällig am 01.12.2027                   | 136.502        | 132.111                  | 0,13                              |
| <b>NPC Ukregenergo</b>                                        |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 25.04.2042                | 7.600          | 7.397                    | 0,01                              | 3,450 % fällig am 01.07.2025                   | 103.044        | 103.043                  | 0,11                              |
| 6,875 % fällig am 09.11.2028                                  | 1.000          | 813                      | 0,00                              | <b>Thames Water Utilities Ltd.</b>          |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.08.2050                   | 1.723          | 1.106                    | 0,00                              |
| <b>Occidental Petroleum Corp.</b>                             |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 22.03.2027 (f)            | 1.467          | 1.697                    | 0,00                              | 3,750 % fällig am 01.07.2028                   | 113.694        | 110.354                  | 0,11                              |
| 5,200 % fällig am 01.08.2029                                  | 38.400         | 38.552                   | 0,04                              | <b>Times Square Hotel Trust</b>             |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.08.2042                   | 17.317         | 12.361                   | 0,01                              |
| 5,375 % fällig am 01.01.2032                                  | 28.200         | 27.989                   | 0,03                              | 8,528 % fällig am 01.08.2026                | \$ 592         | 594                      | 0,00                              | 4,000 % fällig am 01.12.2046                   | 3.527          | 2.529                    | 0,00                              |
| 5,550 % fällig am 01.10.2034 (m)                              | 10.100         | 9.917                    | 0,01                              | <b>Topaz Solar Farms LLC</b>                |                |                          |                                   | 4,200 % fällig am 01.03.2029                   | 32.300         | 31.535                   | 0,03                              |
| <b>Oracle Corp.</b>                                           |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 30.09.2039                | 4.790          | 4.239                    | 0,00                              | 4,200 % fällig am 01.06.2041                   | 1.800          | 1.386                    | 0,00                              |
| 4,800 % fällig am 03.08.2028                                  | 2.500          | 2.542                    | 0,00                              | 5,750 % fällig am 30.09.2039                | 41.253         | 40.535                   | 0,04                              | 4,250 % fällig am 15.03.2046                   | 6.232          | 4.650                    | 0,01                              |
| <b>Petroleos de Venezuela S.A.</b>                            |                |                          |                                   | <b>U.S. Renal Care, Inc.</b>                |                |                          |                                   | 4,300 % fällig am 15.03.2045                   | 61.034         | 46.129                   | 0,05                              |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^                                | 53.114         | 6.696                    | 0,01                              | 10,625 % fällig am 28.06.2028               | 3.879          | 3.321                    | 0,00                              | 4,400 % fällig am 01.03.2032                   | 27.000         | 25.344                   | 0,03                              |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^                                | 50.574         | 6.374                    | 0,01                              | <b>UCB S.A.</b>                             |                |                          |                                   | 4,450 % fällig am 15.04.2042                   | 23.987         | 19.080                   | 0,02                              |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^                                | 47.576         | 6.074                    | 0,01                              | 4,250 % fällig am 20.03.2030                | € 3.400        | 4.095                    | 0,00                              | 4,550 % fällig am 01.07.2030                   | 207.115        | 202.254                  | 0,21                              |
| 6,000 % fällig am 15.11.2026 ^                                | 63.177         | 8.042                    | 0,01                              | <b>United Airlines Pass-Through Trust</b>   |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 15.06.2043                   | 23.378         | 18.548                   | 0,02                              |
| 9,750 % fällig am 17.05.2035 ^                                | 28.330         | 4.193                    | 0,00                              | 3,500 % fällig am 01.09.2031                | 2.381          | 2.248                    | 0,00                              | 4,650 % fällig am 01.08.2028                   | 4.100          | 4.078                    | 0,00                              |
| <b>Petroleos Mexicanos</b>                                    |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 03.03.2028                | 6.515          | 6.410                    | 0,01                              | 4,750 % fällig am 15.02.2044                   | 14.492         | 11.808                   | 0,01                              |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027                                  | € 3.000        | 3.361                    | 0,00                              | 4,000 % fällig am 11.10.2027                | 410            | 406                      | 0,00                              | 5,000 % fällig am 04.06.2028                   | 21.600         | 21.671                   | 0,02                              |
| 5,950 % fällig am 28.01.2031                                  | \$ 43.161      | 39.060                   | 0,04                              | 4,150 % fällig am 25.02.2033                | 658            | 631                      | 0,00                              | 5,450 % fällig am 15.06.2027                   | 8.500          | 8.602                    | 0,01                              |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032                                  | 303.442        | 282.193                  | 0,29                              | 5,875 % fällig am 15.04.2029                | 61.035         | 62.335                   | 0,06                              | 5,700 % fällig am 01.03.2035                   | 29.600         | 29.350                   | 0,03                              |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047                                  | 2.466          | 1.788                    | 0,00                              | <b>Universal Music Group NV</b>             |                |                          |                                   | 5,900 % fällig am 15.06.2032                   | 10.000         | 10.214                   | 0,01                              |
| 6,950 % fällig am 28.01.2060                                  | 60.850         | 43.764                   | 0,04                              | 3,750 % fällig am 30.06.2032                | € 98.300       | 118.375                  | 0,12                              | 6,000 % fällig am 15.08.2035                   | 53.300         | 53.921                   | 0,06                              |
| 7,690 % fällig am 23.01.2050                                  | 9.240          | 7.274                    | 0,01                              | 4,000 % fällig am 13.06.2031                | 30.900         | 37.860                   | 0,04                              | <b>Peru LNG SRL</b>                            |                |                          |                                   |
| <b>Philip Morris International, Inc.</b>                      |                |                          |                                   | <b>Valaris Ltd.</b>                         |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 22.03.2030                   | 500            | 471                      | 0,00                              |
| 3,750 % fällig am 15.01.2031                                  | € 13.600       | 16.495                   | 0,02                              | 8,375 % fällig am 30.04.2030                | \$ 12.102      | 12.426                   | 0,01                              | <b>Rio Oil Finance Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 01.11.2031                                  | \$ 14.300      | 14.414                   | 0,01                              | <b>Var Energi ASA</b>                       |                |                          |                                   | 8,200 % fällig am 06.04.2028                   | 11.064         | 11.542                   | 0,01                              |
| 4,875 % fällig am 13.02.2029                                  | 46.600         | 47.438                   | 0,05                              | 3,875 % fällig am 12.03.2031                | € 49.200       | 58.037                   | 0,06                              | 9,750 % fällig am 06.01.2027                   | 3.467          | 3.590                    | 0,00                              |
| 5,125 % fällig am 13.02.2031                                  | 9.600          | 9.891                    | 0,01                              | <b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>    |                |                          |                                   | <b>Southern California Edison Co.</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Prosus NV</b>                                              |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.08.2029                | \$ 44.300      | 41.797                   | 0,04                              | 2,250 % fällig am 01.06.2030                   | 5.284          | 4.642                    | 0,01                              |
| 1,985 % fällig am 13.07.2033                                  | € 10.500       | 10.707                   | 0,01                              | 3,875 % fällig am 01.11.2033 (m)            | 153.500        | 134.360                  | 0,14                              | 2,750 % fällig am 01.02.2032                   | 14.284         | 12.321                   | 0,01                              |
| 2,085 % fällig am 19.01.2030                                  | 3.900          | 4.352                    | 0,00                              | 4,125 % fällig am 15.08.2031                | 30.900         | 28.623                   | 0,03                              | 4,700 % fällig am 01.06.2027                   | 46.060         | 46.240                   | 0,05                              |
| 2,778 % fällig am 19.01.2034                                  | 8.700          | 9.318                    | 0,01                              | <b>Venture Global LNG, Inc.</b>             |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.03.2030                   | 70.200         | 70.953                   | 0,07                              |
| 3,061 % fällig am 13.07.2031                                  | \$ 4.600       | 4.076                    | 0,00                              | 7,000 % fällig am 15.01.2030                | 86.600         | 87.621                   | 0,09                              | 5,300 % fällig am 01.03.2028                   | 2.198          | 2.227                    | 0,00                              |
| 4,193 % fällig am 19.01.2032                                  | 3.700          | 3.467                    | 0,00                              | 8,125 % fällig am 01.06.2028                | 149.225        | 154.324                  | 0,16                              | 5,950 % fällig am 01.11.2032                   | 12.906         | 13.258                   | 0,01                              |
| <b>Quanta Services, Inc.</b>                                  |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am 01.06.2031                | 22.100         | 22.970                   | 0,02                              | 6,200 % fällig am 15.09.2055                   | 10.200         | 9.777                    | 0,01                              |
| 4,750 % fällig am 09.08.2027                                  | 7.186          | 7.249                    | 0,01                              | 9,500 % fällig am 01.02.2029 (m)            | 255.252        | 278.225                  | 0,28                              | <b>Southern Gas Corridor CJSC</b>              |                |                          |                                   |
| <b>Roadster Finance DAC</b>                                   |                |                          |                                   | 9,875 % fällig am 01.02.2032                | 101.000        | 109.139                  | 0,11                              | 6,875 % fällig am 24.03.2026                   | 14.200         | 14.404                   | 0,02                              |
| 2,375 % fällig am 08.12.2032                                  | € 7.000        | 8.049                    | 0,01                              |                                             |                |                          |                                   | <b>Sprint Capital Corp.</b>                    |                |                          |                                   |
|                                                               |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.11.2028                   | 2.200          | 2.362                    | 0,00                              |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 8,750 % fällig am 15.03.2032                                 | \$ 32.200      | \$ 39.080                | 0,04                              | 4,034 % fällig am 15.10.2033     | \$ 254         | \$ 250                   | 0,00                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| <b>Sprint LLC</b>                                            |                |                          |                                   | 4,306 % fällig am 25.10.2052     | 118.436        | 98.326                   | 0,10                              | 01.08.2055                                              | \$ 114.000     | \$ 111.983               | 0,11                              |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026                                 | 8.100          | 8.178                    | 0,01                              | 4,446 % fällig am 25.11.2052     | 153.717        | 138.231                  | 0,14                              | 5,500 % fällig am 01.07.2055                            | 270.300        | 270.739                  | 0,27                              |
|                                                              |                | 1.749.934                | 1,77                              | 4,492 % fällig am 25.11.2055     | 36.702         | 31.612                   | 0,03                              | 6,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel                       |                | 24.909.255               | 25,15                             | 4,500 % fällig am 01.08.2048     | 6.364          | 4.144                    | 0,01                              | 01.08.2055                                              | 263.000        | 266.589                  | 0,27                              |
| <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                          |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.05.2049 (a) | 2.936          | 2.766                    | 0,01                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Golden State, California Tobacco Securitization Corp.</b> |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 25.07.2056 -   |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.06.2031 -                          |                |                          |                                   |
| Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021              |                |                          |                                   | 25.11.2057                       | 91.312         | 89.138                   | 0,09                              | 01.03.2032                                              | 178            | 171                      | 0,00                              |
| 3,000 % fällig am 01.06.2046                                 | 2.370          | 2.081                    | 0,00                              | 5,000 % fällig am 15.02.2049 (a) | 1.209          | 193                      | 0,00                              | 3,000 % fällig am 01.12.2025 -                          | 517.779        | 454.113                  | 0,46                              |
| <b>Golden State, California Tobacco Securitization Corp.</b> |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.08.2033 -   |                |                          |                                   | 01.12.2052                                              | 166.248        | 153.164                  | 0,16                              |
| Revenue Bonds, Series 2021                                   |                |                          |                                   | 01.04.2036                       | 0              | 0                        | 0,00                              | 3,500 % fällig am 01.11.2025 -                          |                |                          |                                   |
| 3,850 % fällig am 01.06.2050                                 | 1.330          | 1.211                    | 0,00                              | 5,505 % fällig am 25.12.2054     | 30.470         | 30.484                   | 0,03                              | 01.05.2052                                              | 428.631        | 408.367                  | 0,41                              |
| 4,214 % fällig am 01.06.2050                                 | 13.300         | 9.591                    | 0,01                              | 6,000 % fällig am 01.01.2033 -   |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.08.2030 -                          |                |                          |                                   |
| <b>Illinois State General Obligation Bonds, (BABs),</b>      |                |                          |                                   | 01.09.2033                       | 0              | 0                        | 0,00                              | 01.04.2053                                              |                |                          |                                   |
| Series 2010                                                  |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.02.2032 -   | 2.473          | 2.614                    | 0,00                              | 4,500 % fällig am 01.09.2033 -                          | 92.586         | 88.876                   | 0,09                              |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035                                 | 6.112          | 6.424                    | 0,01                              | 25.11.2049                       |                |                          |                                   | 01.07.2053                                              |                |                          |                                   |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035                                 | 2.073          | 2.194                    | 0,00                              | 7,000 % fällig am 01.12.2025 -   |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.05.2026 -                          | 154.819        | 152.540                  | 0,15                              |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035                                 | 6.301          | 6.742                    | 0,01                              | 01.06.2037                       | 4              | 2                        | 0,00                              | 01.08.2053                                              | 1.467.444      | 1.471.359                | 1,49                              |
| <b>Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds,</b>   |                |                          |                                   | 7,388 % fällig am 25.12.2047     | 1.364          | 1.363                    | 0,00                              | 5,500 % fällig am 01.12.2034 -                          |                |                          |                                   |
| (BABs), Series 2010                                          |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 01.07.2030     | 0              | 0                        | 0,00                              | 01.09.2053                                              | 2.159.418      | 2.201.166                | 2,22                              |
| 6,050 % fällig am 01.07.2032 ^                               | 6.790          | 3.310                    | 0,00                              | <b>Ginnie Mae</b>                |                |                          |                                   | 01.09.2054                                              |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 01.07.2040 ^                               | 435            | 212                      | 0,00                              | 0,000 % fällig am 20.01.2049 -   | 38.226         | 581                      | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.07.2031 -                          | 81.147         | 84.353                   | 0,09                              |
| <b>Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds,</b>   |                |                          |                                   | 20.05.2049 (a)                   |                |                          |                                   | 01.07.2054                                              |                |                          |                                   |
| Series 2008                                                  |                |                          |                                   | 0,300 % fällig am 16.05.2050 (a) | 616            | 2                        | 0,00                              | 7,500 % fällig am 01.04.2029 -                          |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 01.07.2022 ^                               | 2.355          | 1.142                    | 0,00                              | 0,636 % fällig am 20.12.2040     | 1.320          | 1.214                    | 0,00                              | 01.10.2030                                              | 0              | 0                        | 0,00                              |
|                                                              |                | 32.907                   | 0,03                              | 1,123 % fällig am 20.12.2040     | 180            | 155                      | 0,00                              | 8,000 % fällig am 01.03.2030                            | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                 |                |                          |                                   | 1,724 % fällig am 16.01.2043 (a) | 407            | 33                       | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b>            |                |                          |                                   |
| <b>Fannie Mae</b>                                            |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 20.04.2052     | 50.995         | 43.378                   | 0,04                              | 2,000 % fällig am 01.07.2040                            | 200            | 183                      | 0,00                              |
| 0,230 % fällig am 25.03.2035 (a)                             | 91             | 4                        | 0,00                              | 3,000 % fällig am 20.01.2052 -   | 68.855         | 60.985                   | 0,06                              | 2,500 % fällig am 01.07.2040 -                          | 1.350          | 1.255                    | 0,00                              |
| 0,241 % fällig am 25.05.2041                                 | 36             | 28                       | 0,00                              | 20.03.2052                       |                |                          |                                   | 01.07.2055                                              | 1.256.100      | 1.095.652                | 1,11                              |
| 1,564 % fällig am 25.08.2033                                 | 128            | 120                      | 0,00                              | 3,500 % fällig am 20.03.2043 (a) | 508            | 70                       | 0,00                              | 01.08.2055                                              | 2.016.022      | 1.814.944                | 1,83                              |
| 1,580 % fällig am 25.10.2049 -                               |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 20.03.2052 -   |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.07.2055 -                          | 4.047.453      | 3.763.304                | 3,80                              |
| 25.11.2049 (a)                                               | 34.712         | 4.668                    | 0,00                              | 20.06.2055                       | 441.777        | 402.784                  | 0,41                              | 01.08.2055                                              | 2.787.800      | 2.665.723                | 2,69                              |
| 1,630 % fällig am 25.04.2044 -                               |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 20.03.2054 -   | 108.216        | 100.766                  | 0,10                              | 4,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| 25.02.2049 (a)                                               | 5.117          | 562                      | 0,00                              | 20.06.2054                       |                |                          |                                   | 01.08.2055                                              | 8.800.864      | 8.621.244                | 8,71                              |
| 1,780 % fällig am 25.05.2048 (a)                             | 12.508         | 1.735                    | 0,00                              | 4,500 % fällig am 15.07.2030 -   | 127.339        | 125.663                  | 0,13                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 25.12.2027 -                               |                |                          |                                   | 20.07.2053                       | 425            | 423                      | 0,00                              | 01.08.2055                                              | 6.593.710      | 6.588.521                | 6,65                              |
| 25.02.2028 (a)                                               | 1.427          | 28                       | 0,00                              | 4,563 % fällig am 20.10.2065     | 6.711          | 6.865                    | 0,01                              | 6,000 % fällig am 01.07.2055 -                          | 11.681.958     | 11.862.600               | 11,98                             |
| 3,000 % fällig am 25.06.2042 -                               |                |                          |                                   | 20.12.2045                       | 260            | 260                      | 0,00                              | 01.08.2055                                              | 11.765.761     | 12.135.236               | 12,27                             |
| 25.02.2046 (a)                                               | 428            | 55                       | 0,00                              | 4,752 % fällig am 20.01.2072     | 661            | 661                      | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.09.2057                                 | 14.748         | 12.829                   | 0,01                              | 4,796 % fällig am 20.08.2065     | 9              | 9                        | 0,00                              | 01.08.2055                                              | 1.160.500      | 1.216.703                | 1,23                              |
| 3,500 % fällig am 25.12.2049 (a)                             | 5.193          | 1.082                    | 0,00                              | 4,896 % fällig am 20.08.2066     |                |                          |                                   | 01.09.2055                                              | 58.258.832     | 58,84                    |                                   |
| 4,000 % fällig am 01.01.2059                                 | 7.634          | 7.170                    | 0,01                              | 5,000 % fällig am 20.11.2032 -   | 171.426        | 173.556                  | 0,18                              | <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 25.09.2040                                 | 2.043          | 2.031                    | 0,00                              | 20.06.2049                       | 5.049          | 5.031                    | 0,01                              | <b>U.S. Treasury Bonds</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 25.12.2042 (a)                             | 105            | 17                       | 0,00                              | 5,002 % fällig am 20.02.2074     | 141            | 141                      | 0,00                              | 2,500 % fällig am 15.02.2045                            | 59.000         | 41.553                   | 0,04                              |
| 5,000 % fällig am 01.05.2034 -                               |                |                          |                                   | 5,016 % fällig am 20.04.2062     | 6              | 6                        | 0,00                              | 2,875 % fällig am 15.05.2043                            | 69.079         | 53.264                   | 0,05                              |
| 01.06.2037                                                   | 5              | 5                        | 0,00                              | 5,046 % fällig am 20.01.2062     | 281            | 283                      | 0,00                              | 2,875 % fällig am 15.08.2045                            | 510.010        | 381.491                  | 0,39                              |
| 5,500 % fällig am 01.05.2033 -                               |                |                          |                                   | 5,096 % fällig am 20.02.2070     | 1.557          | 1.558                    | 0,00                              | 3,000 % fällig am 15.11.2044                            | 371.252        | 285.995                  | 0,29                              |
| 25.05.2038                                                   | 135            | 134                      | 0,00                              | 5,106 % fällig am 20.12.2065     | 1.150          | 1.152                    | 0,00                              | 3,000 % fällig am 15.08.2048                            | 81.815         | 60.533                   | 0,06                              |
| 5,505 % fällig am 25.12.2054                                 | 37.147         | 37.241                   | 0,04                              | 5,146 % fällig am 20.08.2066     | 15.433         | 15.642                   | 0,02                              | 3,000 % fällig am 15.02.2049                            | 10.169         | 7.496                    | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 01.08.2036 -                               |                |                          |                                   | 5,196 % fällig am 20.10.2066 -   | 2.911          | 2.919                    | 0,00                              | 3,125 % fällig am 15.02.2043                            | 178.076        | 143.261                  | 0,14                              |
| 01.05.2038                                                   | 0              | 0                        | 0,00                              | 20.02.2067                       | 1.082          | 1.085                    | 0,00                              | 3,125 % fällig am 15.08.2044                            | 283.117        | 223.320                  | 0,23                              |
| 6,500 % fällig am 01.03.2029                                 | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,227 % fällig am 20.06.2067     | 4.322          | 4.341                    | 0,00                              | 3,125 % fällig am 15.05.2048                            | 55.840         | 42.384                   | 0,04                              |
| 7,000 % fällig am 01.04.2029                                 | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,246 % fällig am 20.06.2066     | 1.137          | 1.143                    | 0,00                              | 3,375 % fällig am 15.05.2044                            | 416.095        | 342.384                  | 0,35                              |
| 13,082 % fällig am 25.07.2037                                | 2              | 3                        | 0,00                              | 5,296 % fällig am 20.07.2066     |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 15.02.2044                            | 145.436        | 124.558                  | 0,13                              |
| <b>Freddie Mac</b>                                           |                |                          |                                   | 5,366 % fällig am 20.07.2065     | 0              | 0                        | 0,00                              | 3,750 % fällig am 15.11.2043                            | 80.988         | 70.789                   | 0,07                              |
| 1,063 % fällig am 15.01.2041                                 | 366            | 334                      | 0,00                              | 5,446 % fällig am 20.03.2066     | 8.646          | 8.785                    | 0,01                              | 4,250 % fällig am 15.08.2054                            | 178.800        | 163.337                  | 0,16                              |
| 1,115 % fällig am 25.04.2029 (a)                             | 42.077         | 776                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 15.04.2037 -   |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.08.2043                            | 208.600        | 198.899                  | 0,20                              |
| 1,580 % fällig am 25.12.2049 (a)                             | 19.254         | 2.503                    | 0,00                              | 20.11.2038                       | 2              | 1                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 15.11.2054                            | 1.009.800      | 962.623                  | 0,97                              |
| 1,732 % fällig am 15.11.2042 (a)                             | 2.878          | 367                      | 0,00                              | 6,111 % fällig am 20.09.2067     | 8.514          | 8.642                    | 0,01                              | 4,625 % fällig am 15.05.2054                            | 418.600        | 406.696                  | 0,41                              |
| 1,782 % fällig am 15.01.2042 (a)                             | 149            | 12                       | 0,00                              | 6,500 % fällig am 15.05.2028 -   |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (h)</b> |                |                          |                                   |
| 2,332 % fällig am 15.03.2037 (a)                             | 55             | 5                        | 0,00                              | 15.09.2037                       |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.10.2025                            | 119.295        | 118.884                  | 0,12                              |
| 2,500 % fällig am 15.09.2027 -                               |                |                          |                                   | 6,717 % fällig am 20.07.2067     |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.04.2026                            | 8.317          | 8.225                    | 0,01                              |
| 15.12.2027 (a)                                               | 1.789          | 38                       | 0,00                              | 7,000 % fällig am 15.01.2026 -   |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.07.2026                            | 202.867        | 201.131                  | 0,20                              |
| 3,000 % fällig am 15.12.2032 -                               |                |                          |                                   | 15.05.2038                       | 2              | 0                        | 0,00                              | 0,125 % fällig am 15.10.2026                            | 347.104        | 343.154                  | 0,35                              |
| 15.04.2049 (a)                                               | 3.034          | 446                      | 0,00                              | 7,500 % fällig am 15.09.2025 -   |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.07.2030                            | 322.236        | 302.802                  | 0,31                              |
| 3,000 % fällig am 01.11.2046 -                               |                |                          |                                   | 20.01.2030                       | 0              | 0                        | 0,00                              | 0,125 % fällig am 15.01.2031                            | 11.829         | 10.964                   | 0,01                              |
| 01.05.2049                                                   | 1.608          | 1.430                    | 0,00                              | 7,519 % fällig am 20.09.2066     | 3.573          | 3.658                    | 0,00                              | 0,125 % fällig am 15.07.2031                            | 62.029         | 57.104                   | 0,06                              |
| 3,500 % fällig am 15.12.2032 -                               |                |                          |                                   | 7,763 % fällig am 20.04.2037     | 5              | 6                        | 0,00                              | 0,125 % fällig am 15.01.2032                            | 50.683         | 45.957                   | 0,05                              |
| 15.05.2049 (a)                                               | 7.495          | 1.009                    | 0,00                              | 7,843 % fällig am 20.09.2066     | 8.725          | 9.005                    | 0,01                              | 0,250 % fällig am 15.07.2029                            | 922.068        | 885.701                  | 0,89                              |
| 3,500 % fällig am 01.07.2046 -                               |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 15.03.2030 -   |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 15.02.2050                            | 121.146        | 70.440                   | 0,07                              |
| 01.03.2048                                                   | 5.544          | 6.289                    | 0,00                              | 15.05.2032                       | 0              | 0                        | 0,00                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 3,607 % fällig am 25.10.2046                                 | 4.181          | 4.132                    | 0,00                              | 8,500 % fällig am 15.01.2031     | 0              | 0                        | 0,00                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 01.05.2039 -                               |                |                          |                                   | <b>Ginnie Mae, TBA</b>           |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
| 01.11.2047                                                   | 25             | 25                       | 0,00                              | 3,000 % fällig am 01.07.2055 -   | 264.600        | 234.023                  | 0,24                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 15.06.2049 (a)                             | 3.804          | 695                      | 0,00                              | 01.08.2055                       | 193.940        | 176.343                  | 0,18                              |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.07.2055     |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.07.2055 -   | 231.824        | 215.542                  | 0,22                              |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 01.08.2055                       |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.07.2055 -   | 771.122        | 738.186                  | 0,75                              |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 01.08.2055                       |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                      | PARI<br>(000S) | % DES<br>MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |                          | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | % DES<br>MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |                          | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | % DES<br>MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |                          |
|-----------------------------------|----------------|-----------------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------|----------------|-----------------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------------|----------------|-----------------------------------------------|--------------------------|
|                                   |                | MARKT-<br>WERT                                | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                                         |                | MARKT-<br>WERT                                | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                                               |                | MARKT-<br>WERT                                | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027      | \$ 20.212      | \$ 19.937                                     | 0,02                     | AFG Trust                               |                |                                               |                          | 4,812 % fällig am 20.12.2046                  | \$ 1.672       | \$ 1.490                                      | 0,00                     |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027      | 5.455          | 5.382                                         | 0,01                     | 4,528 % fällig am 10.07.2056 AUD        | 11.139         | \$ 7.300                                      | 0,01                     | 4,852 % fällig am 20.04.2047                  | 596            | 501                                           | 0,00                     |
| 0,625 % fällig am 15.07.2032      | 555.528        | 518.403                                       | 0,52                     | Alba PLC                                |                |                                               |                          | 4,852 % fällig am 20.05.2047                  | 5.229          | 4.825                                         | 0,01                     |
| 0,625 % fällig am 15.02.2043      | 16.881         | 12.558                                        | 0,01                     | 4,528 % fällig am 17.03.2039            | £ 4.100        | 5.534                                         | 0,01                     | 4,852 % fällig am 20.06.2047                  | 401            | 329                                           | 0,00                     |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028      | 179.971        | 177.812                                       | 0,18                     | 4,578 % fällig am 15.12.2038            | 6.275          | 8.342                                         | 0,01                     | 4,992 % fällig am 20.06.2047                  | 1.650          | 1.360                                         | 0,00                     |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042      | 47.839         | 37.180                                        | 0,04                     | 4,598 % fällig am 17.03.2039            | 3.923          | 5.216                                         | 0,01                     | 4,994 % fällig am 25.07.2037                  | 160            | 153                                           | 0,00                     |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045      | 158.922        | 116.130                                       | 0,12                     | 4,648 % fällig am 17.03.2039            | 6.267          | 8.089                                         | 0,01                     | 5,014 % fällig am 25.05.2037                  | 3.868          | 3.301                                         | 0,00                     |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029      | 216.323        | 213.014                                       | 0,22                     | 4,707 % fällig am 25.11.2042            | 957            | 1.287                                         | 0,00                     | 5,014 % fällig am 25.07.2037                  | 1.569          | 1.503                                         | 0,00                     |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047      | 122.914        | 89.136                                        | 0,09                     | Alliance Bancorp Trust                  |                |                                               |                          | 5,032 % fällig am 20.05.2047                  | 1.201          | 1.117                                         | 0,00                     |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046      | 65.927         | 49.999                                        | 0,05                     | 4,914 % fällig am 25.07.2037            | \$ 818         | 730                                           | 0,00                     | 5,034 % fällig am 25.08.2036                  | 139            | 125                                           | 0,00                     |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048      | 146.075        | 107.536                                       | 0,11                     | American Home Mortgage Assets Trust     |                |                                               |                          | 5,069 % fällig am 20.07.2047                  | 796            | 771                                           | 0,00                     |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049      | 384.223        | 279.048                                       | 0,28                     | 3,210 % fällig am 25.11.2035            | 1.049          | 734                                           | 0,00                     | 5,078 % fällig am 20.01.2047                  | 1.256          | 1.094                                         | 0,00                     |
| 1,125 % fällig am 15.01.2033      | 54.488         | 52.091                                        | 0,05                     | 4,554 % fällig am 25.10.2046            | 4.956          | 4.469                                         | 0,01                     | 5,189 % fällig am 20.05.2036                  | 975            | 921                                           | 0,00                     |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033      | 1.531.853      | 1.488.344                                     | 1,50                     | 4,559 % fällig am 25.03.2047            | 1.032          | 921                                           | 0,00                     | 5,482 % fällig am 20.04.2035                  | 1.604          | 1.431                                         | 0,00                     |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044      | 18.443         | 15.499                                        | 0,02                     | 4,624 % fällig am 25.10.2046            | 9.142          | 5.294                                         | 0,01                     | 5,483 % fällig am 20.02.2036                  | 35             | 28                                            | 0,00                     |
| 1,500 % fällig am 15.02.2053      | 174.595        | 138.419                                       | 0,14                     | 4,624 % fällig am 25.12.2046            | 4.393          | 3.754                                         | 0,01                     | 5,500 % fällig am 25.01.2036                  | 11             | 11                                            | 0,00                     |
| 1,750 % fällig am 15.01.2034      | 381.921        | 378.787                                       | 0,38                     | 4,644 % fällig am 25.10.2046            | 3.746          | 1.896                                         | 0,00                     | 5,500 % fällig am 25.03.2036                  | 39             | 35                                            | 0,00                     |
| 1,875 % fällig am 15.07.2034      | 2.807.480      | 2.811.262                                     | 2,84                     | 4,814 % fällig am 25.09.2046            | 2.480          | 2.329                                         | 0,00                     | 5,716 % fällig am 20.05.2036                  | 167            | 156                                           | 0,00                     |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040      | 24.338         | 24.043                                        | 0,02                     | 5,014 % fällig am 25.08.2037            | 1.288          | 1.160                                         | 0,00                     | 5,750 % fällig am 25.11.2035                  | 0              | 0                                             | 0,00                     |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041      | 10.985         | 10.760                                        | 0,01                     | 5,099 % fällig am 25.02.2047            | 24.154         | 8.415                                         | 0,01                     | 5,750 % fällig am 25.03.2036                  | 58             | 48                                            | 0,00                     |
| U.S. Treasury Notes               |                |                                               |                          | 5,319 % fällig am 25.11.2046            | 30.474         | 7.398                                         | 0,01                     | 5,760 % fällig am 20.09.2035                  | 1.645          | 1.352                                         | 0,00                     |
| 0,375 % fällig am 31.01.2026      | 100.000        | 97.803                                        | 0,10                     | 5,339 % fällig am 25.10.2046            | 3.764          | 2.450                                         | 0,00                     | 5,773 % fällig am 25.05.2037                  | 73             | 64                                            | 0,00                     |
| 0,375 % fällig am 30.09.2027      | 38.660         | 35.904                                        | 0,04                     | 6,750 % fällig am 25.11.2046            | 4.186          | 3.750                                         | 0,01                     | 5,846 % fällig am 25.01.2037                  | 157            | 146                                           | 0,00                     |
| 0,500 % fällig am 31.10.2027      | 46.600         | 43.287                                        | 0,04                     | American Home Mortgage Investment Trust |                |                                               |                          | 6,000 % fällig am 25.07.2036                  | 413            | 318                                           | 0,00                     |
| 0,625 % fällig am 30.11.2027      | 542.910        | 504.758                                       | 0,51                     | 4,624 % fällig am 25.05.2047            | 1.991          | 1.171                                         | 0,00                     | 6,000 % fällig am 25.08.2036                  | 199            | 172                                           | 0,00                     |
| 0,625 % fällig am 31.12.2027      | 230.260        | 213.512                                       | 0,22                     | 4,714 % fällig am 25.03.2046            | 6.549          | 5.917                                         | 0,01                     | 6,000 % fällig am 25.09.2036                  | 501            | 436                                           | 0,00                     |
| 0,750 % fällig am 30.04.2026      | 100.000        | 97.298                                        | 0,10                     | 4,794 % fällig am 25.12.2046            | 6.440          | 5.416                                         | 0,01                     | 6,000 % fällig am 25.08.2037                  | 1.310          | 1.081                                         | 0,00                     |
| 0,750 % fällig am 31.01.2028      | 199.210        | 184.853                                       | 0,19                     | 4,834 % fällig am 25.03.2046            | 2.439          | 2.167                                         | 0,00                     | 6,000 % fällig am 26.10.2037                  | 1.081          | 999                                           | 0,00                     |
| 0,875 % fällig am 30.09.2026      | 100.000        | 96.344                                        | 0,10                     | 5,034 % fällig am 25.09.2045            | 5.692          | 5.060                                         | 0,01                     | 6,230 % fällig am 20.11.2034                  | 5              | 5                                             | 0,00                     |
| 1,500 % fällig am 15.08.2026      | 56.200         | 54.701                                        | 0,05                     | 5,034 % fällig am 25.11.2045            | 4.683          | 3.244                                         | 0,00                     | 6,249 % fällig am 20.02.2036                  | 38             | 36                                            | 0,00                     |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025      | 110.000        | 109.663                                       | 0,11                     | 5,259 % fällig am 25.02.2045            | 5.863          | 5.544                                         | 0,01                     | 6,253 % fällig am 25.10.2036                  | 7              | 6                                             | 0,00                     |
| 2,000 % fällig am 15.11.2026      | 9.100          | 8.874                                         | 0,01                     | 5,883 % fällig am 25.09.2035            | 10.935         | 5.997                                         | 0,01                     | 6,263 % fällig am 25.10.2036                  | 156            | 138                                           | 0,00                     |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025      | 57.430         | 56.997                                        | 0,06                     | 6,326 % fällig am 25.09.2035            | 3.029          | 1.143                                         | 0,00                     | 6,347 % fällig am 25.01.2037                  | 489            | 457                                           | 0,00                     |
| 2,250 % fällig am 15.02.2027      | 262.600        | 256.240                                       | 0,26                     | 6,460 % fällig am 25.12.2036            | 3.533          | 2.991                                         | 0,00                     | 6,474 % fällig am 20.07.2036                  | 57             | 58                                            | 0,00                     |
| 2,375 % fällig am 31.03.2029      | 139.700        | 133.141                                       | 0,13                     | 6,500 % fällig am 25.03.2047            | 660            | 428                                           | 0,00                     | 6,479 % fällig am 25.10.2036                  | 404            | 368                                           | 0,00                     |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029      | 255.400        | 242.999                                       | 0,24                     | 6,950 % fällig am 25.06.2036            | 7.599          | 1.064                                         | 0,00                     | 6,557 % fällig am 20.11.2035                  | 177            | 169                                           | 0,00                     |
| 2,625 % fällig am 31.01.2026      | 881.400        | 873.324                                       | 0,88                     | Angel Oak Mortgage Trust                |                |                                               |                          | 6,559 % fällig am 20.07.2036                  | 426            | 423                                           | 0,00                     |
| 2,750 % fällig am 15.08.2032      | 832.400        | 768.052                                       | 0,78                     | 1,469 % fällig am 25.06.2065            | 959            | 912                                           | 0,00                     | 6,567 % fällig am 26.07.2035                  | 99             | 85                                            | 0,00                     |
| 2,875 % fällig am 15.08.2028      | 500            | 488                                           | 0,00                     | APS Resecuritization Trust              |                |                                               |                          | 6,619 % fällig am 20.11.2034                  | 29             | 29                                            | 0,00                     |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032      | 171.690        | 160.228                                       | 0,16                     | 2,818 % fällig am 27.06.2049            | 2.326          | 2.260                                         | 0,00                     | 6,986 % fällig am 20.06.2032                  | 2              | 2                                             | 0,00                     |
| 3,375 % fällig am 15.09.2027      | 375.000        | 372.466                                       | 0,38                     | Ashford Hospitality Trust               |                |                                               |                          | Banc of America Merrill Lynch Trust           |                |                                               |                          |
| 3,750 % fällig am 31.08.2026      | 100.000        | 99.777                                        | 0,10                     | 5,384 % fällig am 15.04.2035            | 372            | 371                                           | 0,00                     | 2,848 % fällig am 14.08.2034                  | 18.900         | 16.062                                        | 0,02                     |
| 4,000 % fällig am 31.10.2029      | 592.900        | 598.690                                       | 0,60                     | 5,734 % fällig am 15.04.2035            | 3.000          | 2.978                                         | 0,00                     | 3,819 % fällig am 14.07.2037                  | 8.000          | 7.716                                         | 0,01                     |
| 4,250 % fällig am 15.01.2028      | 300.000        | 303.926                                       | 0,31                     | 5,884 % fällig am 15.04.2035            | 2.500          | 2.476                                         | 0,00                     | 4,325 % fällig am 15.08.2046                  | 400            | 359                                           | 0,00                     |
| 4,250 % fällig am 15.02.2028      | 250.000        | 253.418                                       | 0,26                     | Atlas Funding PLC                       |                |                                               |                          | 6,013 % fällig am 17.06.2050                  | 200            | 46                                            | 0,00                     |
| 4,375 % fällig am 31.07.2026      | 200.000        | 200.832                                       | 0,20                     | 5,074 % fällig am 20.09.2061            | £ 25.419       | 34.935                                        | 0,04                     | Banc of America Mortgage Trust                |                |                                               |                          |
| 4,500 % fällig am 31.03.2026      | 1.661.900      | 1.666.566                                     | 1,68                     | 5,374 % fällig am 20.01.2061            | 23.913         | 32.941                                        | 0,03                     | 3,969 % fällig am 25.02.2036                  | 213            | 181                                           | 0,00                     |
| 4,500 % fällig am 15.04.2027      | 1.673.100      | 1.694.210                                     | 1,71                     | Atrium Hotel Portfolio Trust            |                |                                               |                          | 4,244 % fällig am 20.10.2046                  | 199            | 174                                           | 0,00                     |
|                                   |                | 21.226.636                                    | 21,44                    | 5,539 % fällig am 15.12.2036            | \$ 34.469      | 33.716                                        | 0,04                     | 4,843 % fällig am 25.01.2036                  | 69             | 60                                            | 0,00                     |
|                                   |                |                                               |                          | 6,109 % fällig am 15.12.2036            | 4.000          | 3.873                                         | 0,01                     | 5,329 % fällig am 20.11.2046                  | 118            | 105                                           | 0,00                     |
| NON-AGENCY-MBS                    |                |                                               |                          | Avon Finance PLC                        |                |                                               |                          | 5,830 % fällig am 25.08.2035                  | 929            | 889                                           | 0,00                     |
| 1211 Avenue of the Americas Trust |                |                                               |                          | 5,139 % fällig am 28.12.2049            | £ 33.068       | 45.390                                        | 0,05                     | 6,000 % fällig am 25.03.2037                  | 544            | 466                                           | 0,00                     |
| 3,901 % fällig am 10.08.2035      | 1.500          | 1.440                                         | 0,00                     | Banc of America Alternative Loan Trust  |                |                                               |                          | 6,000 % fällig am 25.05.2037                  | 181            | 144                                           | 0,00                     |
| 4,230 % fällig am 10.08.2035      | 9.600          | 9.118                                         | 0,01                     | 4,834 % fällig am 25.01.2037            | \$ 1.365       | 1.110                                         | 0,00                     | 6,000 % fällig am 25.07.2046                  | 15             | 13                                            | 0,00                     |
| 4,280 % fällig am 10.08.2035      | 7.400          | 6.868                                         | 0,01                     | 5,500 % fällig am 25.12.2035            | 122            | 111                                           | 0,00                     | 6,019 % fällig am 25.01.2035                  | 521            | 510                                           | 0,00                     |
| 20 Times Square Trust             |                |                                               |                          | 5,913 % fällig am 25.10.2036            | 9.385          | 2.518                                         | 0,00                     | 6,102 % fällig am 25.09.2035                  | 455            | 399                                           | 0,00                     |
| 3,203 % fällig am 15.05.2035      | 38.291         | 34.080                                        | 0,04                     | 6,000 % fällig am 25.11.2035            | 169            | 152                                           | 0,00                     | 6,107 % fällig am 25.07.2035                  | 723            | 693                                           | 0,00                     |
| 225 Liberty Street Trust          |                |                                               |                          | 6,000 % fällig am 25.04.2037            | 309            | 266                                           | 0,00                     | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust |                |                                               |                          |
| 3,597 % fällig am 10.02.2036      | 25.260         | 24.124                                        | 0,03                     | 6,000 % fällig am 25.06.2037            | 389            | 333                                           | 0,00                     | 3,966 % fällig am 10.08.2033                  | 29.500         | 27.276                                        | 0,03                     |
| 280 Park Avenue Mortgage Trust    |                |                                               |                          | 6,000 % fällig am 25.06.2046            | 1.729          | 1.395                                         | 0,00                     | 4,197 % fällig am 10.08.2035                  | 1.350          | 1.323                                         | 0,00                     |
| 5,492 % fällig am 15.09.2034      | 700            | 694                                           | 0,00                     | 6,000 % fällig am 25.07.2046            | 1.137          | 993                                           | 0,00                     | 6,500 % fällig am 15.07.2037                  | 10.000         | 9.313                                         | 0,01                     |
| 5,862 % fällig am 15.09.2034      | 2.000          | 1.957                                         | 0,00                     | 6,500 % fällig am 25.03.2036            | 1.308          | 1.199                                         | 0,00                     | 7,000 % fällig am 15.07.2037                  | 24.373         | 20.247                                        | 0,02                     |
| Adjustable Rate Mortgage Trust    |                |                                               |                          | Banc of America Funding Corp.           |                |                                               |                          | BCAP LLC Trust                                |                |                                               |                          |
| 3,398 % fällig am 25.08.2035      | 289            | 221                                           | 0,00                     | 4,460 % fällig am 25.09.2048            | 1.269          | 1.195                                         | 0,00                     | 0,000 % fällig am 26.08.2036                  | 1.198          | 490                                           | 0,00                     |
| 3,792 % fällig am 25.09.2035      | 2.050          | 1.768                                         | 0,00                     | Banc of America Funding Trust           |                |                                               |                          | 3,547 % fällig am 26.01.2037                  | 3.502          | 3.165                                         | 0,00                     |
| 4,674 % fällig am 25.08.2036      | 10.955         | 3.693                                         | 0,01                     | 3,752 % fällig am 20.05.2035            | 609            | 534                                           | 0,00                     | 4,058 % fällig am 26.07.2037                  | 2.913          | 2.642                                         | 0,00                     |
| 4,759 % fällig am 25.05.2036      | 59             | 52                                            | 0,00                     | 3,898 % fällig am 29.04.2037            | 7.232          | 6.468                                         | 0,01                     | 4,083 % fällig am 26.03.2037                  | 0              | 0                                             | 0,00                     |
| 4,774 % fällig am 25.05.2036      | 3.616          | 1.488                                         | 0,00                     | 4,098 % fällig am 26.10.2036            | 8.235          | 7.887                                         | 0,01                     | 4,466 % fällig am 26.03.2037                  | 101            | 100                                           | 0,00                     |
| 4,854 % fällig am 25.06.2037      | 2.275          | 2.633                                         | 0,00                     | 4,226 % fällig am 20.09.2046            | 53             | 43                                            | 0,00                     | 4,714 % fällig am 25.04.2037                  | 1.220          | 1.143                                         | 0,00                     |
| 4,954 % fällig am 25.01.2036      | 99             | 94                                            | 0,00                     | 4,494 % fällig am 25.01.2037            | 1.871          | 1.597                                         | 0,00                     | 4,738 % fällig am 26.04.2047                  | 2.187          | 2.054                                         | 0,00                     |
| 4,974 % fällig am 25.02.2036      | 148            | 88                                            | 0,00                     | 4,521 % fällig am 20.01.2047            | 128            | 111                                           | 0,00                     | 4,774 % fällig am 25.01.2037                  | 2.251          | 2.073                                         | 0,00                     |
| 5,041 % fällig am 25.03.2037      | 3.507          | 2.640                                         | 0,00                     | 4,524 % fällig am 20.06.2047            | 2.942          | 2.619                                         | 0,00                     | 4,794 % fällig am 25.03.2037                  | 5.184          | 4.687                                         | 0,01                     |
| 5,384 % fällig am 25.08.2035      | 765            | 680                                           | 0,00                     | 4,534 % fällig am 25.04.2037            | 2.698          | 2.272                                         | 0,00                     | 4,814 % fällig am 25.10.2036                  | 41             | 43                                            | 0,00                     |
| 5,423 % fällig am 25.04.2035      | 4              | 4                                             | 0,00                     | 4,646 % fällig am 26.05.2037            | 5.643          | 4.992                                         | 0,01                     | 4,854 % fällig am 25.04.2037                  | 48             | 46                                            | 0,00                     |
| 5,584 % fällig am 25.01.2035      | 1.182          | 1.033                                         | 0,00                     | 4,690 % fällig am 20.05.2036            | 179            | 158                                           | 0,00                     | 4,854 % fällig am 25.05.2047                  | 194            | 185                                           | 0,00                     |
| 5,584 % fällig am 25.03.2035      | 896            | 782                                           | 0,00                     | 4,699 % fällig am 26.07.2036            | 5.061          | 4.454                                         | 0,01                     | 4,934 % fällig am 25.02.2047                  | 848            | 770                                           | 0,00                     |
| 6,024 % fällig am 25.01.2036      | 22             | 21                                            | 0,00                     | 4,746 % fällig am 27.08.2036            | 11.885         | 11.431                                        | 0,01                     | 4,967 % fällig am                             |                |                                               |                          |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>  |                |                          |                                   | <b>BNPP Mortgage Securities LLC Trust</b>                                   |                |                          |                                   | <b>4,564 % fällig am 25.06.2036</b>                                           | \$ 3.875       | \$ 3.745                 | 0,01                              |
| 4,204 % fällig am 25.05.2047                        | \$ 110         | \$ 90                    | 0,00                              | 6,000 % fällig am 27.08.2037                                                | \$ 1.114       | \$ 378                   | 0,00                              | 4,681 % fällig am 20.02.2036                                                  | 1.296          | 1.190                    | 0,00                              |
| 4,250 % fällig am 25.05.2047                        | 2.602          | 2.347                    | 0,00                              | <b>Braccan Mortgage Funding PLC</b>                                         |                |                          |                                   | 4,719 % fällig am 25.08.2036                                                  | 10.538         | 4.300                    | 0,01                              |
| 4,334 % fällig am 25.08.2047                        | 1.003          | 886                      | 0,00                              | 5,077 % fällig am 15.02.2067                                                | £ 47.520       | 65.301                   | 0,07                              | 4,742 % fällig am 25.03.2037                                                  | 1.338          | 1.162                    | 0,00                              |
| 4,424 % fällig am 25.07.2036                        | 152            | 132                      | 0,00                              | <b>Brants Bridge PLC</b>                                                    |                |                          |                                   | 4,753 % fällig am 25.06.2036                                                  | 882            | 852                      | 0,00                              |
| 4,893 % fällig am 25.06.2035                        | 11             | 10                       | 0,00                              | 5,139 % fällig am 14.06.2066                                                | 7.382          | 10.136                   | 0,01                              | 4,754 % fällig am 25.09.2036                                                  | 208            | 197                      | 0,00                              |
| 4,987 % fällig am 25.10.2046                        | 1.194          | 1.038                    | 0,00                              | <b>Bridgegate Funding PLC</b>                                               |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.01.2037                                                  | 2.565          | 2.239                    | 0,00                              |
| 5,292 % fällig am 25.08.2035                        | 488            | 425                      | 0,00                              | 6,564 % fällig am 16.10.2062                                                | 63.770         | 88.150                   | 0,09                              | 4,783 % fällig am 25.09.2037                                                  | 2.448          | 2.148                    | 0,00                              |
| 5,513 % fällig am 25.07.2034                        | 1              | 1                        | 0,00                              | 7,314 % fällig am 16.10.2062                                                | 44.065         | 61.000                   | 0,06                              | 4,934 % fällig am 25.09.2036                                                  | 2.702          | 2.560                    | 0,00                              |
| 5,531 % fällig am 25.02.2036                        | 1.616          | 1.480                    | 0,00                              | 8,314 % fällig am 16.10.2062                                                | 25.165         | 34.897                   | 0,04                              | 5,000 % fällig am 25.03.2037                                                  | 3.205          | 2.858                    | 0,00                              |
| 5,828 % fällig am 25.02.2047                        | 1.891          | 1.656                    | 0,00                              | 9,314 % fällig am 16.10.2062                                                | 18.898         | 26.139                   | 0,03                              | 5,084 % fällig am 25.11.2036                                                  | 1.758          | 1.517                    | 0,00                              |
| 6,159 % fällig am 25.10.2033                        | 0              | 0                        | 0,00                              | <b>BX Trust</b>                                                             |                |                          |                                   | 5,103 % fällig am 25.04.2035                                                  | 303            | 290                      | 0,00                              |
| 6,244 % fällig am 25.06.2035                        | 30             | 30                       | 0,00                              | 6,579 % fällig am 15.05.2035                                                | \$ 662         | 655                      | 0,00                              | 5,135 % fällig am 25.07.2037                                                  | 1.015          | 907                      | 0,00                              |
| 6,250 % fällig am 25.02.2033                        | 0              | 0                        | 0,00                              | <b>BXP Trust</b>                                                            |                |                          |                                   | 5,155 % fällig am 25.11.2036                                                  | 420            | 281                      | 0,00                              |
| 6,339 % fällig am 25.11.2034                        | 2              | 1                        | 0,00                              | 3,379 % fällig am 13.06.2039                                                | 90.000         | 87.107                   | 0,09                              | 5,178 % fällig am 25.12.2035                                                  | 451            | 288                      | 0,00                              |
| 6,373 % fällig am 25.12.2046                        | 3.248          | 2.710                    | 0,00                              | <b>Canada Square Funding PLC</b>                                            |                |                          |                                   | 5,266 % fällig am 25.04.2037                                                  | 1.194          | 1.079                    | 0,00                              |
| 6,375 % fällig am 25.08.2033                        | 1              | 1                        | 0,00                              | 5,019 % fällig am 17.06.2058                                                | £ 11.715       | 16.060                   | 0,02                              | 5,452 % fällig am 25.03.2036                                                  | 238            | 228                      | 0,00                              |
| 6,464 % fällig am 25.10.2035                        | 331            | 332                      | 0,00                              | 5,161 % fällig am 17.01.2059                                                | 2.551          | 3.503                    | 0,01                              | 5,500 % fällig am 25.09.2035                                                  | 540            | 550                      | 0,00                              |
| 6,530 % fällig am 25.02.2036                        | 873            | 833                      | 0,00                              | 5,189 % fällig am 17.06.2058                                                | 11.981         | 16.440                   | 0,02                              | 5,718 % fällig am 25.05.2042                                                  | 732            | 713                      | 0,00                              |
| 6,547 % fällig am 25.04.2033                        | 23             | 23                       | 0,00                              | <b>Canterbury Finance PLC</b>                                               |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.11.2035                                                  | 1.400          | 1.092                    | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                     |                |                          |                                   | 5,073 % fällig am 16.05.2058                                                | 29.151         | 39.998                   | 0,04                              | 5,988 % fällig am 25.08.2035                                                  | 233            | 209                      | 0,00                              |
| 4,016 % fällig am 25.05.2036                        | 740            | 686                      | 0,00                              | <b>Chase Mortgage Finance Trust</b>                                         |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.12.2035                                                  | 817            | 813                      | 0,00                              |
| 4,037 % fällig am 25.04.2037                        | 204            | 142                      | 0,00                              | 4,669 % fällig am 25.03.2037                                                | \$ 2.340       | 2.168                    | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.11.2036                                                  | 34             | 35                       | 0,00                              |
| 4,192 % fällig am 25.08.2036                        | 4.480          | 2.052                    | 0,00                              | 4,745 % fällig am 25.12.2035                                                | 578            | 522                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.08.2037                                                  | 1.370          | 490                      | 0,00                              |
| 4,433 % fällig am 25.07.2035                        | 269            | 191                      | 0,00                              | 4,780 % fällig am 25.12.2035                                                | 69             | 61                       | 0,00                              | 6,081 % fällig am 25.07.2036                                                  | 118            | 86                       | 0,00                              |
| 4,607 % fällig am 25.11.2036                        | 9.538          | 4.899                    | 0,01                              | 4,918 % fällig am 25.01.2036                                                | 396            | 369                      | 0,00                              | 6,800 % fällig am 25.07.2036                                                  | 1.335          | 1.012                    | 0,00                              |
| 4,632 % fällig am 25.07.2035                        | 542            | 352                      | 0,00                              | 4,939 % fällig am 25.07.2037                                                | 430            | 352                      | 0,00                              | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   |
| 4,711 % fällig am 25.08.2046                        | 3.210          | 2.202                    | 0,00                              | 5,078 % fällig am 25.03.2037                                                | 614            | 597                      | 0,00                              | 4,841 % fällig am 25.09.2035                                                  | 1.075          | 966                      | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.08.2036                        | 4.815          | 4.249                    | 0,01                              | 5,250 % fällig am 25.05.2035                                                | 0              | 0                        | 0,00                              | <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                                    |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.11.2036                        | 1.908          | 1.644                    | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                                | 1.858          | 1.329                    | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.05.2037                                                  | 3.269          | 2.728                    | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.06.2046                        | 2.107          | 1.902                    | 0,00                              | 5,969 % fällig am 25.02.2037                                                | 675            | 648                      | 0,00                              | 4,984 % fällig am 25.01.2037                                                  | 3.972          | 3.278                    | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.01.2047                        | 1.413          | 1.207                    | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.05.2036                                                | 2.681          | 1.100                    | 0,00                              | 4,984 % fällig am 25.02.2037                                                  | 1.289          | 1.037                    | 0,00                              |
| 4,774 % fällig am 25.08.2036                        | 13.179         | 11.686                   | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.11.2036                                                | 941            | 373                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.03.2037                                                  | 2.067          | 1.676                    | 0,00                              |
| 4,774 % fällig am 25.12.2046                        | 4.663          | 4.129                    | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.05.2037                                                | 2.469          | 1.053                    | 0,00                              | 5,084 % fällig am 25.12.2036                                                  | 1.365          | 1.115                    | 0,00                              |
| 4,814 % fällig am 25.05.2036                        | 8.663          | 7.431                    | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                                | 5.760          | 2.287                    | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.04.2036                                                  | 182            | 172                      | 0,00                              |
| 4,816 % fällig am 25.01.2047                        | 518            | 251                      | 0,00                              | 6,328 % fällig am 25.02.2037                                                | 973            | 966                      | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.12.2036                                                  | 1.496          | 1.327                    | 0,00                              |
| 4,838 % fällig am 25.09.2047                        | 17.004         | 9.536                    | 0,01                              | 6,409 % fällig am 25.02.2037                                                | 158            | 154                      | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.02.2037                                                  | 467            | 411                      | 0,00                              |
| 4,874 % fällig am 25.04.2036                        | 2.252          | 2.002                    | 0,00                              | 6,890 % fällig am 25.07.2037                                                | 79             | 57                       | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.03.2037                                                  | 456            | 398                      | 0,00                              |
| 4,905 % fällig am 25.09.2035                        | 1.427          | 820                      | 0,00                              | <b>ChaseFlex Trust</b>                                                      |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.04.2037                                                  | 3.014          | 2.660                    | 0,00                              |
| 4,909 % fällig am 25.09.2035                        | 1.646          | 565                      | 0,00                              | 4,221 % fällig am 25.09.2036                                                | 440            | 401                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.07.2036                                                  | 717            | 632                      | 0,00                              |
| 4,914 % fällig am 25.02.2036                        | 6.648          | 6.352                    | 0,01                              | 4,994 % fällig am 25.05.2037                                                | 2.017          | 1.941                    | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.09.2036                                                  | 167            | 155                      | 0,00                              |
| 4,934 % fällig am 25.01.2036                        | 3.795          | 3.587                    | 0,01                              | 5,000 % fällig am 25.07.2037                                                | 1.368          | 443                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.10.2036                                                  | 174            | 151                      | 0,00                              |
| 4,954 % fällig am 25.11.2035                        | 8.630          | 8.057                    | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.07.2037                                                | 5.919          | 5.230                    | 0,01                              | 6,000 % fällig am 25.11.2036                                                  | 2.621          | 2.406                    | 0,00                              |
| 4,974 % fällig am 25.10.2035                        | 1.646          | 1.540                    | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.02.2035                                                | 804            | 685                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.05.2037                                                  | 338            | 323                      | 0,00                              |
| 5,074 % fällig am 25.04.2034                        | 1              | 1                        | 0,00                              | <b>ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                                  | 5.472          | 4.798                    | 0,01                              |
| 5,134 % fällig am 25.10.2035                        | 91             | 89                       | 0,00                              | 4,145 % fällig am 25.08.2037                                                | 511            | 428                      | 0,00                              | <b>Commercial Mortgage Trust</b>                                              |                |                          |                                   |
| 5,154 % fällig am 25.08.2035                        | 3.347          | 3.260                    | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.08.2037                                                | 4.709          | 4.384                    | 0,01                              | 0,000 % fällig am 10.04.2047 (a)                                              | 6.443          | 0                        | 0,00                              |
| 5,174 % fällig am 25.01.2036                        | 487            | 461                      | 0,00                              | <b>Chester A PLC</b>                                                        |                |                          |                                   | 1,441 % fällig am 10.10.2049 (a)                                              | 64.410         | 469                      | 0,00                              |
| 5,326 % fällig am 25.10.2035                        | 545            | 454                      | 0,00                              | 0,000 % fällig am                                                           |                |                          |                                   | 3,140 % fällig am 10.10.2036                                                  | 19.220         | 17.875                   | 0,02                              |
| 5,334 % fällig am 25.11.2034                        | 430            | 430                      | 0,00                              | 17.03.2046 (f)(l)                                                           | £ 13.675       | 18.286                   | 0,02                              | 3,651 % fällig am 10.02.2049                                                  | 12.546         | 12.413                   | 0,01                              |
| 5,409 % fällig am 25.07.2035                        | 1.406          | 1.384                    | 0,00                              | 1,000 % fällig am 20.05.2046 (l)                                            | 1              | 5.317                    | 0,01                              | 3,942 % fällig am 10.04.2033                                                  | 2.400          | 2.331                    | 0,00                              |
| 5,439 % fällig am 25.09.2034                        | 78             | 72                       | 0,00                              | 5,639 % fällig am 17.03.2046 (l)                                            | 19.053         | 26.170                   | 0,03                              | 3,961 % fällig am 10.05.2051                                                  | 39.998         | 39.294                   | 0,04                              |
| 5,467 % fällig am 25.05.2035                        | 361            | 345                      | 0,00                              | 6,489 % fällig am 17.03.2046 (l)                                            | 14.727         | 20.235                   | 0,02                              | 5,608 % fällig am 15.09.2033                                                  | 28.649         | 26.248                   | 0,03                              |
| 5,513 % fällig am 25.09.2035                        | 3.202          | 1.005                    | 0,00                              | 7,389 % fällig am 17.03.2046 (l)                                            | 13.675         | 18.804                   | 0,02                              | <b>Copa PPN Placeholder</b>                                                   |                |                          |                                   |
| 5,559 % fällig am 25.01.2035                        | 1.200          | 1.140                    | 0,00                              | 8,239 % fällig am 17.03.2046 (l)                                            | 8.415          | 11.579                   | 0,01                              | 0,010 % fällig am 31.12.2030 (l)                                              | € 108.000      | 126.776                  | 0,13                              |
| 5,568 % fällig am 25.12.2046                        | 147            | 105                      | 0,00                              | 8,739 % fällig am 17.03.2046 (l)                                            | 4.207          | 5.786                    | 0,01                              | <b>Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust</b>                    |                |                          |                                   |
| 5,964 % fällig am 25.09.2035                        | 1.123          | 887                      | 0,00                              | <b>Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates</b>                 |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.05.2036                                                  | \$ 257         | 142                      | 0,00                              |
| 6,084 % fällig am 25.09.2034                        | 1.045          | 1.030                    | 0,00                              | 4,455 % fällig am 25.08.2035                                                | \$ 232         | 191                      | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.08.2037                                                  | 1.137          | 522                      | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>   |                |                          |                                   | 4,584 % fällig am 25.01.2036                                                | 172            | 164                      | 0,00                              | 7,000 % fällig am 25.01.2037                                                  | 282            | 48                       | 0,00                              |
| 4,834 % fällig am 25.10.2034                        | 47             | 42                       | 0,00                              | 4,614 % fällig am 25.05.2036                                                | 460            | 439                      | 0,00                              | <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.12.2035                        | 2.637          | 1.255                    | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.01.2036                                                | 469            | 447                      | 0,00                              | 0,000 % fällig am 25.09.2034                                                  | 2              | 2                        | 0,00                              |
| 5,125 % fällig am 25.03.2034                        | 110            | 145                      | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.10.2036                                                | 827            | 791                      | 0,00                              | 2,066 % fällig am 25.09.2037 (a)                                              | 795            | 123                      | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 25.08.2035                        | 1.568          | 929                      | 0,00                              | 4,664 % fällig am 25.10.2035                                                | 545            | 527                      | 0,00                              | 2,516 % fällig am 25.10.2037 (a)                                              | 1.502          | 205                      | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035                        | 134            | 129                      | 0,00                              | 4,684 % fällig am 25.08.2035                                                | 487            | 471                      | 0,00                              | 3,470 % fällig am 25.05.2035                                                  | 1.844          | 1.463                    | 0,00                              |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034                        | 1.106          | 986                      | 0,00                              | 4,704 % fällig am 25.05.2035                                                | 455            | 443                      | 0,00                              | 3,692 % fällig am 25.07.2021                                                  | 2              | 2                        | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 25.03.2037                        | 1.451          | 1.313                    | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.01.2035                                                | 139            | 136                      | 0,00                              | 4,332 % fällig am 25.06.2037                                                  | 4.731          | 4.239                    | 0,01                              |
| <b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>          |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.08.2035                                                | 81             | 78                       | 0,00                              | 4,571 % fällig am 25.03.2047                                                  | 581            | 534                      | 0,00                              |
| 4,594 % fällig am 25.12.2046                        | 7.582          | 6.790                    | 0,01                              | 4,754 % fällig am 25.05.2035                                                | 124            | 121                      | 0,00                              | 4,612 % fällig am 20.02.2047                                                  | 5.673          | 4.557                    | 0,01                              |
| 4,714 % fällig am 25.03.2037                        | 2.041          | 1.908                    | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.03.2035                                                | 101            | 100                      | 0,00                              | 4,622 % fällig am 20.03.2047                                                  | 5.135          | 4.415                    | 0,01                              |
| 4,754 % fällig am 25.06.2047                        | 2.356          | 2.090                    | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.10.2035                                                | 260            | 252                      | 0,00                              | 4,627 % fällig am 20.12.2046                                                  | 7.287          | 6.371                    | 0,01                              |
| 4,774 % fällig am 25.06.2047                        | 5.663          | 5.024                    | 0,01                              | 5,114 % fällig am 25.10.2034                                                | 158            | 155                      | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.06.2036                                                  | 1.402          | 1.316                    | 0,00                              |
| 4,814 % fällig am 25.01.2037                        | 8.745          | 8.458                    | 0,01                              | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                                  |                |                          |                                   | 4,674 % fällig am 25.12.2046                                                  | 526            | 467                      | 0,00                              |
| 4,834 % fällig am 25.02.2037                        | 7.687          | 7.215                    | 0,01                              | 3,351 % fällig am 25.02.2037                                                | 2.813          | 2.164                    | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.03.2047                                                  | 1.386          | 1.100                    | 0,00                              |
| 4,834 % fällig am 25.09.2047                        | 9.089          | 8.635                    | 0,01                              | 3,698 % fällig am 25.08.2047                                                | 185            | 162                      | 0,00                              | 4,712 % fällig am 20.09.2046                                                  | 3.331          | 2.923                    | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b> |                |                          |                                   | 4,077 % fällig am 25.04.2036                                                | 695            | 382                      | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.08.2037                                                  | 5.786          | 5.366                    | 0,01                              |
| 4,120 % fällig am 26.12.2046                        | 1.420          | 1.130                    | 0,00                              | 4,145 % fällig am 25.01.2082                                                | 22.187         | 19.356                   | 0,02                              | 4,714 % fällig am 25.04.2047                                                  | 4.980          | 4.580                    | 0,01                              |
| 5,062 % fällig am 26.01.2036                        | 1.189          | 847                      | 0,00                              | 4,333 % fällig am 25.10.2035                                                | 66             | 60                       | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.08.2035                                                  | 227            | 143                      | 0,00                              |
| <b>BellaVista Mortgage Trust</b>                    |                |                          |                                   | 4,413 % fällig am 25.09.2064                                                | 11.643         | 9.885                    | 0,01                              | 4,734 % fällig am 25.11.2035                                                  | 782            | 76                       | 0,00                              |
| 5,156 % fällig am 22.01.2045                        | 309            | 291                      | 0,00                              | 4,485 % fällig am 25.05.2035                                                | 120            |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |



| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | % DES<br>MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |        | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | % DES<br>MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |        | BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | % DES<br>MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |        |
|------------------------------|----------------|-----------------------------------------------|--------|---------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------------------|--------|----------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------------------|--------|
|                              |                | (000S)                                        | (000S) |                                                   |                | (000S)                                        | (000S) |                                                                      |                | (000S)                                        | (000S) |
| 4,784 % fällig am 25.05.2036 | \$ 2.042       | \$ 785                                        | 0,00   | 5,750 % fällig am 25.05.2036                      | \$ 8.760       | \$ 3.184                                      | 0,00   | 5,500 % fällig am 25.09.2035                                         | \$ 297         | \$ 297                                        | 0,00   |
| 4,784 % fällig am 25.10.2036 | 1.425          | 621                                           | 0,00   | 5,750 % fällig am 25.03.2037                      | 4.265          | 2.350                                         | 0,00   | 5,500 % fällig am 25.10.2035                                         | 831            | 449                                           | 0,00   |
| 4,784 % fällig am 25.11.2036 | 3.961          | 3.665                                         | 0,01   | 5,750 % fällig am 25.06.2037                      | 10.514         | 4.496                                         | 0,01   | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                         | 1.539          | 925                                           | 0,00   |
| 4,794 % fällig am 25.09.2046 | 1.641          | 1.526                                         | 0,00   | 5,779 % fällig am 25.11.2047                      | 3.278          | 2.914                                         | 0,00   | 5,500 % fällig am 25.01.2036                                         | 550            | 331                                           | 0,00   |
| 4,794 % fällig am 25.05.2047 | 258            | 238                                           | 0,00   | 5,799 % fällig am 25.08.2035                      | 550            | 524                                           | 0,00   | 5,535 % fällig am 20.10.2034                                         | 163            | 152                                           | 0,00   |
| 4,794 % fällig am 25.06.2047 | 3.753          | 3.254                                         | 0,00   | 5,894 % fällig am 25.11.2035                      | 5.966          | 5.549                                         | 0,01   | 5,607 % fällig am 20.06.2035                                         | 15             | 14                                            | 0,00   |
| 4,804 % fällig am 25.02.2037 | 729            | 212                                           | 0,00   | 5,999 % fällig am 25.08.2035                      | 1.428          | 1.229                                         | 0,00   | 5,750 % fällig am 25.12.2035                                         | 1.245          | 589                                           | 0,00   |
| 4,814 % fällig am 25.07.2046 | 742            | 793                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.03.2027                      | 14             | 14                                            | 0,00   | 5,750 % fällig am 25.02.2037                                         | 2.846          | 1.237                                         | 0,00   |
| 4,814 % fällig am 25.08.2046 | 7.873          | 6.758                                         | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.10.2033                      | 4              | 4                                             | 0,00   | 5,750 % fällig am 25.06.2037                                         | 1.798          | 827                                           | 0,00   |
| 4,834 % fällig am 25.05.2036 | 2.955          | 2.531                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.11.2034                      | 2.777          | 2.886                                         | 0,00   | 5,825 % fällig am 20.04.2035                                         | 68             | 64                                            | 0,00   |
| 4,834 % fällig am 25.12.2036 | 3.836          | 799                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.12.2034                      | 567            | 510                                           | 0,00   | 5,850 % fällig am 25.05.2036                                         | 243            | 96                                            | 0,00   |
| 4,834 % fällig am 25.04.2037 | 2.036          | 667                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.02.2035                      | 1.131          | 942                                           | 0,00   | 5,899 % fällig am 25.01.2036                                         | 139            | 138                                           | 0,00   |
| 4,852 % fällig am 20.03.2046 | 4.363          | 4.025                                         | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.08.2035                      | 51             | 19                                            | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.04.2036                                         | 1.052          | 510                                           | 0,00   |
| 4,852 % fällig am 20.05.2046 | 13.606         | 12.074                                        | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.12.2035                      | 3.317          | 2.382                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.05.2036                                         | 4.518          | 1.941                                         | 0,00   |
| 4,854 % fällig am 25.07.2046 | 4.781          | 4.315                                         | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.01.2036                      | 1.773          | 1.228                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.07.2036                                         | 2.396          | 1.160                                         | 0,00   |
| 4,874 % fällig am 25.09.2047 | 3.763          | 3.614                                         | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.02.2036                      | 1.395          | 1.225                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.02.2037                                         | 3.738          | 1.692                                         | 0,00   |
| 4,884 % fällig am 25.09.2035 | 1.789          | 1.088                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.03.2036                      | 3.114          | 1.402                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.03.2037                                         | 3.883          | 1.694                                         | 0,00   |
| 4,894 % fällig am 25.03.2036 | 2.481          | 2.448                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.04.2036                      | 7.626          | 3.501                                         | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.04.2037                                         | 2.676          | 1.229                                         | 0,00   |
| 4,894 % fällig am 25.11.2036 | 3.101          | 2.680                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.05.2036                      | 41             | 16                                            | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.05.2037                                         | 8.510          | 3.684                                         | 0,01   |
| 4,896 % fällig am 20.07.2035 | 1.253          | 1.208                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.08.2036                      | 15.490         | 9.898                                         | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.07.2037                                         | 1.119          | 475                                           | 0,00   |
| 4,897 % fällig am 25.10.2035 | 152            | 116                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.10.2036                      | 4.481          | 2.345                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.08.2037                                         | 3.354          | 1.435                                         | 0,00   |
| 4,914 % fällig am 25.07.2035 | 951            | 793                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.11.2036                      | 7.984          | 4.422                                         | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.10.2037                                         | 1.155          | 799                                           | 0,00   |
| 4,914 % fällig am 25.01.2037 | 2.761          | 2.342                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.12.2036                      | 2.104          | 570                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.01.2038                                         | 6.757          | 2.847                                         | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.05.2035 | 3.652          | 2.858                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.01.2037                      | 1.153          | 655                                           | 0,00   | 6,248 % fällig am 20.02.2036                                         | 1.394          | 1.290                                         | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.06.2035 | 2.764          | 1.954                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.02.2037                      | 10.646         | 3.874                                         | 0,01   | 6,250 % fällig am 25.09.2036                                         | 475            | 193                                           | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.12.2035 | 1.349          | 782                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.03.2037                      | 4.844          | 1.799                                         | 0,00   | 6,315 % fällig am 20.12.2035                                         | 9              | 9                                             | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.07.2036 | 2.135          | 843                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.04.2037                      | 6.506          | 3.246                                         | 0,00   | 6,500 % fällig am 25.12.2037                                         | 4.709          | 1.869                                         | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.09.2036 | 102            | 40                                            | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.05.2037                      | 10.854         | 4.608                                         | 0,01   | 6,991 % fällig am 20.07.2034                                         | 46             | 44                                            | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.05.2037 | 1.902          | 623                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.07.2037                      | 6.358          | 3.262                                         | 0,00   | 7,743 % fällig am 25.08.2034                                         | 268            | 250                                           | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.06.2037 | 3.105          | 2.582                                         | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.08.2037                      | 17.662         | 8.223                                         | 0,01   | 7,991 % fällig am 20.10.2034                                         | 187            | 169                                           | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.09.2037 | 795            | 285                                           | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.02.2047                      | 2.123          | 1.028                                         | 0,00   | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust                       |                |                                               |        |
| 4,934 % fällig am 25.07.2046 | 1.885          | 1.629                                         | 0,00   | 6,044 % fällig am 25.06.2035                      | 1.709          | 1.623                                         | 0,00   | 4,744 % fällig am 25.01.2034                                         | 155            | 140                                           | 0,00   |
| 4,954 % fällig am 25.07.2035 | 1.050          | 950                                           | 0,00   | 6,250 % fällig am 25.11.2036                      | 407            | 191                                           | 0,00   | 4,774 % fällig am 25.06.2035                                         | 30             | 29                                            | 0,00   |
| 4,954 % fällig am 25.12.2035 | 884            | 814                                           | 0,00   | 6,500 % fällig am 25.08.2032                      | 6              | 6                                             | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.03.2035                                         | 182            | 202                                           | 0,00   |
| 4,974 % fällig am 25.01.2036 | 1.870          | 1.703                                         | 0,00   | 6,500 % fällig am 25.09.2037                      | 8.942          | 3.154                                         | 0,00   | Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.                         |                |                                               |        |
| 4,974 % fällig am 25.07.2036 | 2.060          | 1.865                                         | 0,00   | 6,571 % fällig am 25.04.2036                      | 82             | 77                                            | 0,00   | 5,945 % fällig am 27.11.2035                                         | 159            | 142                                           | 0,00   |
| 4,984 % fällig am 25.08.2035 | 2.399          | 1.920                                         | 0,00   | 6,750 % fällig am 25.10.2036                      | 1.412          | 395                                           | 0,00   | Countrywide, Inc.                                                    |                |                                               |        |
| 4,994 % fällig am 25.08.2035 | 2.491          | 2.380                                         | 0,00   | 7,000 % fällig am 25.10.2037                      | 5.409          | 1.811                                         | 0,00   | 5,693 % fällig am 27.11.2035                                         | 0              | 0                                             | 0,00   |
| 4,994 % fällig am 25.02.2037 | 3.885          | 3.287                                         | 0,00   | 7,500 % fällig am 25.07.2036                      | 1.724          | 1.147                                         | 0,00   | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                 |                |                                               |        |
| 4,994 % fällig am 25.10.2046 | 6.326          | 5.935                                         | 0,01   | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. |                |                                               |        | 5,000 % fällig am 25.07.2035                                         | 473            | 451                                           | 0,00   |
| 4,994 % fällig am 25.08.2047 | 4.728          | 3.957                                         | 0,01   | 4,914 % fällig am 25.04.2036                      | 609            | 542                                           | 0,00   | 5,500 % fällig am 25.07.2035                                         | 1.280          | 1.215                                         | 0,00   |
| 5,000 % fällig am 25.08.2035 | 2.121          | 1.419                                         | 0,00   | 5,154 % fällig am 25.11.2035                      | 81             | 81                                            | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.12.2035                                         | 1.869          | 751                                           | 0,00   |
| 5,014 % fällig am 25.02.2036 | 988            | 897                                           | 0,00   | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust |                |                                               |        | 6,043 % fällig am 25.06.2046                                         | 13.226         | 12.561                                        | 0,01   |
| 5,034 % fällig am 25.12.2035 | 1.538          | 1.179                                         | 0,00   | 1,616 % fällig am 20.01.2035                      | 26             | 22                                            | 0,00   | 6,286 % fällig am 25.03.2033                                         | 60             | 60                                            | 0,00   |
| 5,034 % fällig am 25.01.2036 | 1.273          | 1.159                                         | 0,00   | 2,766 % fällig am 25.05.2036 (a)                  | 311            | 52                                            | 0,00   | 6,500 % fällig am 25.12.2035                                         | 412            | 182                                           | 0,00   |
| 5,034 % fällig am 25.10.2036 | 618            | 232                                           | 0,00   | 3,297 % fällig am 25.02.2035                      | 1.631          | 1.329                                         | 0,00   | 7,000 % fällig am 25.12.2035                                         | 1.296          | 186                                           | 0,00   |
| 5,036 % fällig am 20.11.2035 | 991            | 921                                           | 0,00   | 3,655 % fällig am 25.04.2035                      | 1.541          | 1.215                                         | 0,00   | 7,000 % fällig am 25.01.2036                                         | 4.856          | 803                                           | 0,00   |
| 5,036 % fällig am 25.03.2047 | 548            | 522                                           | 0,00   | 3,944 % fällig am 25.05.2047                      | 1.927          | 1.648                                         | 0,00   | Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates |                |                                               |        |
| 5,054 % fällig am 25.08.2035 | 1.168          | 1.074                                         | 0,00   | 4,180 % fällig am 20.02.2036                      | 1.985          | 1.769                                         | 0,00   | 5,556 % fällig am 25.07.2035                                         | 1.369          | 1.275                                         | 0,00   |
| 5,074 % fällig am 25.11.2035 | 664            | 600                                           | 0,00   | 4,300 % fällig am 20.09.2036                      | 1.445          | 1.281                                         | 0,00   | 7,553 % fällig am 25.10.2033                                         | 4              | 4                                             | 0,00   |
| 5,076 % fällig am 20.11.2035 | 6.874          | 6.097                                         | 0,01   | 4,366 % fällig am 19.01.2034                      | 7              | 7                                             | 0,00   | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                          |                |                                               |        |
| 5,096 % fällig am 20.11.2035 | 7.516          | 7.390                                         | 0,01   | 4,412 % fällig am 20.12.2035                      | 1.391          | 1.267                                         | 0,00   | 2,500 % fällig am 25.07.2057                                         | 47.233         | 43.342                                        | 0,05   |
| 5,114 % fällig am 25.09.2035 | 601            | 392                                           | 0,00   | 4,517 % fällig am 20.05.2036                      | 962            | 876                                           | 0,00   | 2,661 % fällig am 25.12.2048                                         | 10.889         | 10.064                                        | 0,01   |
| 5,114 % fällig am 25.10.2035 | 631            | 360                                           | 0,00   | 4,545 % fällig am 20.06.2036                      | 1.153          | 1.017                                         | 0,00   | 2,974 % fällig am 25.07.2057                                         | 15.700         | 13.416                                        | 0,02   |
| 5,134 % fällig am 25.09.2035 | 3.570          | 3.261                                         | 0,00   | 4,551 % fällig am 25.11.2037                      | 1.648          | 1.488                                         | 0,00   | 3,056 % fällig am 25.02.2056                                         | 139.782        | 108.958                                       | 0,11   |
| 5,134 % fällig am 25.02.2036 | 2.657          | 1.679                                         | 0,00   | 4,623 % fällig am 20.04.2036                      | 884            | 801                                           | 0,00   | 3,158 % fällig am 25.07.2057                                         | 52.573         | 33.181                                        | 0,04   |
| 5,134 % fällig am 25.05.2036 | 3.994          | 1.646                                         | 0,00   | 4,688 % fällig am 25.11.2037                      | 1.164          | 1.085                                         | 0,00   | 3,222 % fällig am 25.07.2058                                         | 246.987        | 194.831                                       | 0,20   |
| 5,184 % fällig am 25.01.2036 | 65             | 40                                            | 0,00   | 4,699 % fällig am 20.05.2036                      | 588            | 562                                           | 0,00   | 3,241 % fällig am 30.11.2037                                         | 5.781          | 5.285                                         | 0,01   |
| 5,234 % fällig am 25.12.2035 | 249            | 212                                           | 0,00   | 4,704 % fällig am 25.04.2035                      | 222            | 211                                           | 0,00   | 3,431 % fällig am 10.11.2032                                         | 5.500          | 4.508                                         | 0,01   |
| 5,249 % fällig am 25.11.2046 | 4.283          | 3.853                                         | 0,01   | 4,720 % fällig am 20.02.2036                      | 527            | 464                                           | 0,00   | 3,780 % fällig am 27.02.2046                                         | 5.660          | 2.944                                         | 0,00   |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 | 1.154          | 859                                           | 0,00   | 4,734 % fällig am 25.05.2036                      | 311            | 89                                            | 0,00   | 4,000 % fällig am 01.08.2057                                         | 4.796          | 4.542                                         | 0,01   |
| 5,250 % fällig am 25.10.2035 | 186            | 126                                           | 0,00   | 4,735 % fällig am 25.04.2037                      | 1.223          | 1.146                                         | 0,00   | 4,269 % fällig am 25.09.2057                                         | 25.840         | 22.493                                        | 0,02   |
| 5,334 % fällig am 25.12.2036 | 772            |                                               |        |                                                   |                |                                               |        |                                                                      |                |                                               |        |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

|                                                                |          |          | % DES  |                                                     |           |        | % DES  |                                |           |          |        | % DES |
|----------------------------------------------------------------|----------|----------|--------|-----------------------------------------------------|-----------|--------|--------|--------------------------------|-----------|----------|--------|-------|
|                                                                | PARI     | MARKT-   | NETTO- |                                                     | PARI      | MARKT- | NETTO- |                                | PARI      | MARKT-   | NETTO- | % DES |
| BESCHREIBUNG                                                   | (000S)   | WERT     | VERMÖ- | BESCHREIBUNG                                        | (000S)    | WERT   | VERMÖ- | BESCHREIBUNG                   | (000S)    | WERT     | VERMÖ- | GENS  |
| 5,837 % fällig am 25.04.2037                                   | \$ 5.080 | \$ 1.275 | 0,00   | 2,215 % fällig am 15.12.2044                        | € 120     | \$ 140 | 0,00   | 4,784 % fällig am 25.03.2035   | \$ 5.008  | \$ 4.702 | 0,01   |       |
| 5,942 % fällig am 25.02.2037                                   | 1.002    | 231      | 0,00   | 2,403 % fällig am 13.03.2045                        | 4.000     | 4.386  | 0,01   | 4,784 % fällig am 25.09.2035   | 5.946     | 5.118    | 0,01   |       |
| 6,000 % fällig am 25.10.2021                                   | 9        | 2        | 0,00   | 2,409 % fällig am 10.09.2044                        | 3.021     | 3.501  | 0,01   | 4,834 % fällig am 25.06.2034   | 1.075     | 965      | 0,00   |       |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036                                   | 3.844    | 1.461    | 0,00   | 4,808 % fällig am 10.09.2044                        | £ 1.133   | 1.533  | 0,00   | 7,056 % fällig am 20.10.2032   | 944       | 885      | 0,00   |       |
| 6,396 % fällig am 25.04.2036                                   | 242      | 126      | 0,00   | 4,838 % fällig am 10.06.2044                        | 1.229     | 1.670  | 0,00   | GSR Mortgage Loan Trust        |           |          |        |       |
| 6,421 % fällig am 25.10.2037                                   | 4.014    | 2.332    | 0,00   | 5,128 % fällig am 13.09.2045                        | 8.400     | 11.219 | 0,01   | 4,240 % fällig am 25.04.2036   | 2.906     | 1.874    | 0,00   |       |
| Credit Suisse Mortgage Capital Trust                           |          |          |        | 5,308 % fällig am 13.06.2045                        | 5.728     | 7.845  | 0,01   | 4,354 % fällig am 25.05.2037   | 1.225     | 650      | 0,00   |       |
| 0,000 % fällig am 25.07.2057                                   | 3.213    | 2.411    | 0,00   | 5,358 % fällig am 13.06.2045                        | 3.172     | 4.128  | 0,01   | 4,468 % fällig am 25.05.2037   | 2.123     | 1.837    | 0,00   |       |
| 3,550 % fällig am 25.09.2048                                   | 11.550   | 8.283    | 0,01   | Finsbury Square PLC                                 |           |        |        | 4,495 % fällig am 25.03.2047   | 5.158     | 2.986    | 0,00   |       |
| 4,342 % fällig am 25.09.2057                                   | 1.095    | 925      | 0,00   | 5,039 % fällig am 16.12.2071                        | 789       | 1.083  | 0,00   | 4,664 % fällig am 25.05.2037   | 11.279    | 5.343    | 0,01   |       |
| 7,030 % fällig am 25.10.2058                                   | 458      | 384      | 0,00   | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust |           |        |        | 4,729 % fällig am 25.01.2036   | 613       | 574      | 0,00   |       |
| Curzon Mortgages PLC                                           |          |          |        | 4,391 % fällig am 25.09.2035                        | \$ 145    | 139    | 0,00   | 4,784 % fällig am 25.06.2035   | 1.565     | 1.506    | 0,00   |       |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                                   | £ 54.630 | 75.091   | 0,08   | 4,493 % fällig am 25.02.2036                        | 83        | 59     | 0,00   | 4,874 % fällig am 25.08.2046   | 18.042    | 3.802    | 0,01   |       |
| 6,032 % fällig am 28.07.2049                                   | 3.253    | 4.472    | 0,01   | 4,649 % fällig am 25.03.2035                        | 418       | 239    | 0,00   | 4,954 % fällig am 25.08.2046   | 15.076    | 3.333    | 0,01   |       |
| DBWF Mortgage Trust                                            |          |          |        | 4,701 % fällig am 25.11.2035                        | 1.292     | 752    | 0,00   | 5,018 % fällig am 25.07.2035   | 22        | 21       | 0,00   |       |
| 3,791 % fällig am 10.12.2036                                   | \$ 7.475 | 7.276    | 0,01   | 4,811 % fällig am 25.02.2037                        | 374       | 256    | 0,00   | 5,500 % fällig am 25.09.2034   | 400       | 401      | 0,00   |       |
| Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                  |          |          |        | 4,869 % fällig am 25.01.2037                        | 704       | 562    | 0,00   | 5,500 % fällig am 25.07.2035   | 346       | 333      | 0,00   |       |
| 4,185 % fällig am 25.08.2035                                   | 535      | 474      | 0,00   | 5,155 % fällig am 25.11.2036                        | 643       | 446    | 0,00   | 5,750 % fällig am 25.03.2036   | 215       | 193      | 0,00   |       |
| 4,456 % fällig am 25.02.2036                                   | 340      | 212      | 0,00   | 5,500 % fällig am 25.11.2035                        | 66        | 30     | 0,00   | 5,880 % fällig am 25.05.2034   | 13        | 12       | 0,00   |       |
| 4,634 % fällig am 25.11.2035                                   | 2        | 1        | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.05.2036                        | 661       | 256    | 0,00   | 5,981 % fällig am 25.05.2037   | 96        | 89       | 0,00   |       |
| 4,674 % fällig am 25.08.2036                                   | 430      | 391      | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.02.2037                        | 719       | 263    | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.11.2035   | 2.336     | 890      | 0,00   |       |
| 4,683 % fällig am 25.10.2035                                   | 1.593    | 1.237    | 0,00   | 6,250 % fällig am 25.11.2036                        | 2.052     | 535    | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.02.2036   | 1.676     | 705      | 0,00   |       |
| 4,694 % fällig am 25.08.2047                                   | 4.366    | 4.035    | 0,01   | First Horizon Asset Securities, Inc.                |           |        |        | 6,000 % fällig am 25.07.2036   | 1.827     | 1.034    | 0,00   |       |
| 4,714 % fällig am 25.07.2047                                   | 7.957    | 7.400    | 0,01   | 4,996 % fällig am 25.01.2036                        | 22        | 11     | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.07.2037   | 406       | 258      | 0,00   |       |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                                   | 5.233    | 4.889    | 0,01   | First Horizon Mortgage Pass-Through Trust           |           |        |        | 6,250 % fällig am 25.08.2036   | 2.125     | 589      | 0,00   |       |
| 4,734 % fällig am 25.09.2047                                   | 6.412    | 5.507    | 0,01   | 3,875 % fällig am 25.07.2037                        | 133       | 64     | 0,00   | 6,341 % fällig am 25.10.2035   | 39        | 37       | 0,00   |       |
| 4,754 % fällig am 25.03.2037                                   | 12.254   | 5.773    | 0,01   | 4,218 % fällig am 25.11.2036                        | 278       | 158    | 0,00   | 6,500 % fällig am 25.05.2036   | 815       | 309      | 0,00   |       |
| 4,794 % fällig am 25.01.2047                                   | 1.735    | 1.586    | 0,00   | 6,000 % fällig am 25.05.2036                        | 165       | 60     | 0,00   | HarborView Mortgage Loan Trust |           |          |        |       |
| 4,814 % fällig am 25.10.2036                                   | 14.646   | 4.050    | 0,01   | 6,000 % fällig am 25.08.2037                        | 247       | 90     | 0,00   | 4,612 % fällig am 19.11.2046   | 694       | 510      | 0,00   |       |
| 4,814 % fällig am 25.12.2036                                   | 4.195    | 1.335    | 0,00   | 6,344 % fällig am 25.11.2037                        | 274       | 198    | 0,00   | 4,692 % fällig am 19.03.2037   | 5.123     | 4.744    | 0,01   |       |
| 4,814 % fällig am 25.02.2037                                   | 1.960    | 1.697    | 0,00   | 6,851 % fällig am 25.08.2037                        | 210       | 47     | 0,00   | 4,732 % fällig am 25.01.2047   | 10.030    | 9.576    | 0,01   |       |
| 4,814 % fällig am 25.08.2047                                   | 4.682    | 4.305    | 0,01   | 6,973 % fällig am 25.09.2035                        | 4         | 4      | 0,00   | 4,772 % fällig am 19.12.2036   | 462       | 420      | 0,00   |       |
| 4,824 % fällig am 25.11.2035                                   | 451      | 469      | 0,00   | Firstmac Mortgage Funding Trust                     |           |        |        | 4,801 % fällig am 19.11.2036   | 13.359    | 11.650   | 0,01   |       |
| 4,834 % fällig am 25.08.2047                                   | 2.484    | 2.335    | 0,00   | 4,805 % fällig am 18.02.2056 AUD                    | 52.642    | 34.529 | 0,04   | 4,812 % fällig am 19.09.2037   | 7.225     | 6.226    | 0,01   |       |
| 4,914 % fällig am 25.01.2047                                   | 2.297    | 2.007    | 0,00   | Fondo de Titulizacion de Activos UCI                |           |        |        | 4,812 % fällig am 19.01.2038   | 7.025     | 6.169    | 0,01   |       |
| 4,994 % fällig am 25.08.2036                                   | 2.894    | 2.598    | 0,00   | 2,125 % fällig am 16.06.2049                        | € 6.241   | 7.198  | 0,01   | 4,824 % fällig am 19.07.2035   | 16        | 12       | 0,00   |       |
| 5,074 % fällig am 25.08.2047                                   | 5.649    | 4.133    | 0,01   | GC Pastor Hipotecario FTA                           |           |        |        | 4,842 % fällig am 19.12.2036   | 21.950    | 17.232   | 0,02   |       |
| 5,094 % fällig am 25.08.2037                                   | 10.331   | 8.380    | 0,01   | 2,206 % fällig am 21.06.2046                        | 873       | 944    | 0,00   | 4,852 % fällig am 19.11.2036   | 5.897     | 5.402    | 0,01   |       |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035                                   | 556      | 449      | 0,00   | Glen Securities Finance DAC                         |           |        |        | 4,854 % fällig am 19.06.2036   | 2.084     | 1.039    | 0,00   |       |
| Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust                  |          |          |        | 4,261 % fällig am 28.10.2038                        | 2.650     | 3.143  | 0,00   | 4,872 % fällig am 19.05.2035   | 2.539     | 2.442    | 0,00   |       |
| 4,678 % fällig am 25.06.2036                                   | 1.702    | 1.570    | 0,00   | 5,261 % fällig am 28.10.2038                        | 2.002     | 2.346  | 0,00   | 4,932 % fällig am 19.01.2036   | 2.886     | 1.876    | 0,00   |       |
| 6,005 % fällig am 25.10.2036                                   | 1.077    | 941      | 0,00   | 6,061 % fällig am 28.10.2038                        | 957       | 1.108  | 0,00   | 4,972 % fällig am 19.03.2035   | 514       | 522      | 0,00   |       |
| 6,445 % fällig am 25.02.2036                                   | 2.885    | 2.640    | 0,00   | GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.                |           |        |        | 4,992 % fällig am 20.10.2045   | 2.272     | 1.572    | 0,00   |       |
| Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.                      |          |          |        | 5,456 % fällig am 10.03.2051                        | \$ 17.597 | 14.884 | 0,02   | 5,032 % fällig am 19.04.2034   | 48        | 45       | 0,00   |       |
| 6,500 % fällig am 27.07.2037                                   | 424      | 346      | 0,00   | 5,550 % fällig am 10.08.2038                        | 10.798    | 10.320 | 0,01   | 5,052 % fällig am 19.09.2035   | 8.435     | 4.001    | 0,01   |       |
| Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates |          |          |        | GMAC Mortgage Corp. Loan Trust                      |           |        |        | 5,052 % fällig am 19.11.2035   | 131       | 85       | 0,00   |       |
| 4,319 % fällig am 27.06.2037                                   | 417      | 370      | 0,00   | 0,000 % fällig am 19.07.2035                        | 7         | 3      | 0,00   | 5,072 % fällig am 19.08.2045   | 1.462     | 1.147    | 0,00   |       |
| Dilosk RMBS DAC                                                |          |          |        | 3,843 % fällig am 19.11.2035                        | 57        | 46     | 0,00   | 5,112 % fällig am 19.01.2035   | 132       | 132      | 0,00   |       |
| 2,786 % fällig am 24.09.2060                                   | € 26.410 | 30.996   | 0,03   | 3,938 % fällig am 19.04.2036                        | 262       | 218    | 0,00   | 5,227 % fällig am 19.07.2045   | 17        | 14       | 0,00   |       |
| 2,838 % fällig am 25.01.2063                                   | 13.793   | 16.184   | 0,02   | 4,068 % fällig am 18.03.2035                        | 10        | 9      | 0,00   | 5,249 % fällig am 19.12.2036   | 1.575     | 1.417    | 0,00   |       |
| 3,049 % fällig am 20.10.2062                                   | 11.525   | 13.585   | 0,02   | Great Hall Mortgages PLC                            |           |        |        | 5,782 % fällig am 20.06.2035   | 686       | 611      | 0,00   |       |
| 3,106 % fällig am 20.07.2061                                   | 1.003    | 1.180    | 0,00   | 2,221 % fällig am 18.03.2039                        | € 1.170   | 1.358  | 0,00   | 5,899 % fällig am 19.09.2035   | 69        | 49       | 0,00   |       |
| Domi BV                                                        |          |          |        | 2,531 % fällig am 18.06.2039                        | 1.960     | 2.187  | 0,00   | 5,972 % fällig am 19.02.2036   | 1.686     | 758      | 0,00   |       |
| 2,655 % fällig am 15.06.2056                                   | 24.573   | 28.801   | 0,03   | 3,201 % fällig am 18.06.2039                        | 8.800     | 9.695  | 0,01   | 6,399 % fällig am 19.10.2035   | 5.095     | 2.556    | 0,00   |       |
| 3,008 % fällig am 16.04.2057                                   | 27.000   | 31.724   | 0,03   | 4,658 % fällig am 18.06.2039                        | £ 2.271   | 3.080  | 0,00   | 6,399 % fällig am 19.01.2036   | 887       | 351      | 0,00   |       |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust          |          |          |        | 4,818 % fällig am 18.06.2038                        | 4.200     | 5.554  | 0,01   | 6,434 % fällig am 25.10.2037   | 9.519     | 8.815    | 0,01   |       |
| 4,622 % fällig am 19.10.2036                                   | \$ 5.285 | 4.764    | 0,01   | 5,138 % fällig am 18.03.2039                        | 1.710     | 2.220  | 0,00   | 6,441 % fällig am 19.11.2034   | 186       | 181      | 0,00   |       |
| 4,632 % fällig am 19.10.2036                                   | 3.529    | 2.345    | 0,00   | 5,608 % fällig am 18.06.2039                        | 2.000     | 2.576  | 0,00   | 7,223 % fällig am 25.02.2036   | 147       | 38       | 0,00   |       |
| 5,012 % fällig am 19.10.2045                                   | 2.816    | 2.583    | 0,00   | GreenPoint Mortgage Funding Trust                   |           |        |        | 7,297 % fällig am 19.12.2035   | 0         | 0        | 0,00   |       |
| 5,172 % fällig am 19.10.2045                                   | 2.561    | 2.395    | 0,00   | 4,834 % fällig am 25.10.2046                        | \$ 5.932  | 5.620  | 0,01   | Harbour Plc                    |           |          |        |       |
| 5,252 % fällig am 19.09.2044                                   | 6        | 5        | 0,00   | 4,854 % fällig am 25.04.2036                        | 245       | 217    | 0,00   | 5,332 % fällig am 28.10.2054   | £ 21.225  | 29.098   | 0,03   |       |
| Dutch Property Finance BV                                      |          |          |        | 4,874 % fällig am 25.06.2045                        | 1.427     | 1.303  | 0,00   | Hilton USA Trust               |           |          |        |       |
| 2,861 % fällig am 28.04.2059                                   | € 21.799 | 25.597   | 0,03   | 4,954 % fällig am 25.10.2045                        | 1.576     | 1.538  | 0,00   | 2,828 % fällig am 05.11.2035   | \$ 15.286 | 13.000   | 0,01   |       |
| 3,061 % fällig am 28.04.2062                                   | 11.541   | 13.604   | 0,02   | 5,014 % fällig am 25.02.2036                        | 1.236     | 1.116  | 0,00   | Hipocat FTA                    |           |          |        |       |
| 3,061 % fällig am 28.04.2064                                   | 36.894   | 43.465   | 0,05   | 5,054 % fällig am 25.10.2045                        | 1.402     | 1.333  | 0,00   | 2,331 % fällig am 24.10.2039   | € 210     | 246      | 0,00   |       |
| Edenbrook Mortgage Funding PLC                                 |          |          |        | Grifonas Finance PLC                                |           |        |        | HomeBanc Mortgage Trust        |           |          |        |       |
| 5,109 % fällig am 22.03.2057                                   | £ 41.299 | 56.731   | 0,06   | 2,669 % fällig am 28.08.2039                        | € 11.369  | 12.981 | 0,01   | 4,645 % fällig am 25.04.2037   | \$ 387    | 361      | 0,00   |       |
| Elstree Funding                                                |          |          |        | GS Mortgage Securities Corp. Trust                  |           |        |        | 4,738 % fällig am 25.04.2047   | 817       | 676      | 0,00   |       |
| 4,943 % fällig am 21.01.2065                                   | 27.411   | 37.579   | 0,04   | 3,055 % fällig am 26.04.2037                        | \$ 9.344  | 2.138  | 0,00   | 4,954 % fällig am 25.01.2036   | 278       | 269      | 0,00   |       |
| EMF-UK PLC                                                     |          |          |        | 3,659 % fällig am 10.01.2043                        | 1.900     | 1.785  | 0,00   | 5,169 % fällig am 25.01.2036   | 5.636     | 5.094    | 0,01   |       |
| 5,338 % fällig am 13.03.2046                                   | 4.904    | 6.717    | 0,01   | 3,721 % fällig am 10.02.2037                        | 6.435     | 6.211  | 0,01   | 5,174 % fällig am 25.12.2034   | 40        | 38       | 0,00   |       |
| Eurohome UK Mortgages PLC                                      |          |          |        | 4,619 % fällig am 26.09.2036                        | 7.398     | 4.443  | 0,01   | Hops Hill PLC                  |           |          |        |       |
| 4,508 % fällig am 15.06.2044                                   | 932      | 1.273    | 0,00   | 4,959 % fällig am 26.08.2035                        | 0         | 0      | 0,00   | 5,103 % fällig am 21.04.2056   | £ 39.482  | 54.293   | 0,06   |       |
| 4,658 % fällig am 15.06.2044                                   | 3.775    | 5.094    | 0,01   | 5,559 % fällig am 15.07.2035                        | 27.852    | 18.681 | 0,02   | Household Capital RMBS         |           |          |        |       |
| 4,708 % fällig am 15.09.2044                                   | 1.250    | 1.698    | 0,00   |                                                     |           |        |        |                                |           |          |        |       |

| BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|----------------------------------------|
|                                        |                |                          |                                        |                                                     |                |                          |                                        |                                                    |                |                          |                                        |
| 5,064 % fällig am 25.02.2036           | \$ 1.161       | \$ 960                   | 0,00                                   | 6,500 % fällig am 25.07.2037                        | \$ 372         | \$ 119                   | 0,00                                   | 2,250 % fällig am 22.02.2045                       | £ 4.258        | \$ 3.614                 | 0,01                                   |
| 5,074 % fällig am 25.11.2034           | 440            | 432                      | 0,00                                   | 6,500 % fällig am 25.09.2037                        | 1.774          | 949                      | 0,00                                   | 5,156 % fällig am 22.02.2045                       | 16.001         | 21.860                   | 0,02                                   |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035           | 1.927          | 1.860                    | 0,00                                   | 6,500 % fällig am 25.10.2037                        | 2.609          | 1.222                    | 0,00                                   | 6,356 % fällig am 22.02.2045                       | 13.150         | 17.514                   | 0,02                                   |
| 5,114 % fällig am 25.01.2035           | 1.501          | 1.451                    | 0,00                                   | Jeronimo Funding DAC                                |                |                          |                                        | Landmark Mortgage Securities PLC                   |                |                          |                                        |
| 6,060 % fällig am 25.10.2034           | 279            | 343                      | 0,00                                   | 3,408 % fällig am 25.10.2064                        | € 24.956       | 29.343                   | 0,03                                   | 4,558 % fällig am 17.06.2039                       | 5.416          | 7.307                    | 0,01                                   |
| Impac Secured Assets CMN Owner Trust   |                |                          |                                        | JPMorgan Alternative Loan Trust                     |                |                          |                                        | 5,231 % fällig am 17.04.2044                       | 6.914          | 9.095                    | 0,01                                   |
| 5,450 % fällig am 25.03.2033           | 129            | 128                      | 0,00                                   | 4,172 % fällig am 25.03.2037                        | \$ 888         | 734                      | 0,00                                   | Lanebrook Mortgage Transaction PLC                 |                |                          |                                        |
| Impac Secured Assets Corp.             |                |                          |                                        | 4,293 % fällig am 25.10.2036                        | 2.862          | 2.591                    | 0,00                                   | 5,039 % fällig am 15.03.2061                       | 42.131         | 57.844                   | 0,06                                   |
| 5,074 % fällig am 25.03.2036           | 964            | 842                      | 0,00                                   | 4,667 % fällig am 25.01.2036                        | 296            | 187                      | 0,00                                   | Lansdowne Mortgage Securities PLC                  |                |                          |                                        |
| Impac Secured Assets Trust             |                |                          |                                        | 4,754 % fällig am 25.07.2036                        | 2.266          | 2.053                    | 0,00                                   | 2,275 % fällig am 15.06.2045                       | € 1.697        | 1.924                    | 0,00                                   |
| 4,654 % fällig am 25.05.2037           | 449            | 372                      | 0,00                                   | 4,794 % fällig am 25.05.2036                        | 2.221          | 1.840                    | 0,00                                   | Legacy Mortgage Asset Trust                        |                |                          |                                        |
| 4,914 % fällig am 25.03.2037           | 3.432          | 2.984                    | 0,00                                   | 4,994 % fällig am 25.06.2037                        | 14.014         | 5.242                    | 0,01                                   | 0,000 % fällig am 25.12.2056 (a)                   | \$ 105.313     | 711                      | 0,00                                   |
| 4,914 % fällig am 25.09.2037           | 2.290          | 1.975                    | 0,00                                   | 4,994 % fällig am 25.04.2047                        | 2.530          | 2.433                    | 0,00                                   | 0,125 % fällig am 26.12.2057 (a)                   | 59.802         | 273                      | 0,00                                   |
| 4,954 % fällig am 25.01.2037           | 6.816          | 5.898                    | 0,01                                   | 5,021 % fällig am 25.03.2036                        | 531            | 400                      | 0,00                                   | 1,326 % fällig am 26.12.2057 (a)                   | 10.621         | 97                       | 0,00                                   |
| 4,974 % fällig am 25.11.2036           | 5.240          | 4.555                    | 0,01                                   | 5,843 % fällig am 26.05.2037                        | 2.250          | 1.763                    | 0,00                                   | 3,053 % fällig am 25.12.2056                       | 105.313        | 82.601                   | 0,09                                   |
| 4,974 % fällig am 25.02.2037           | 4.122          | 3.797                    | 0,01                                   | 6,000 % fällig am 27.12.2036                        | 1.055          | 518                      | 0,00                                   | 4,000 % fällig am 25.02.2058                       | 1.235          | 1.226                    | 0,00                                   |
| 5,134 % fällig am 25.05.2036           | 335            | 309                      | 0,00                                   | 6,180 % fällig am 25.03.2036                        | 5.774          | 5.182                    | 0,01                                   | 4,250 % fällig am 25.02.2058                       | 1.575          | 1.539                    | 0,00                                   |
| 5,154 % fällig am 25.09.2037           | 1.953          | 1.694                    | 0,00                                   | 6,210 % fällig am 25.12.2036                        | 81             | 83                       | 0,00                                   | 4,250 % fällig am 26.08.2058                       | 35.689         | 34.820                   | 0,04                                   |
| IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust |                |                          |                                        | 6,460 % fällig am 25.12.2036                        | 577            | 580                      | 0,00                                   | 4,326 % fällig am 25.02.2058                       | 1.575          | 1.117                    | 0,00                                   |
| 6,622 % fällig am 25.01.2032           | 0              | 0                        | 0,00                                   | 6,550 % fällig am 25.05.2036                        | 44             | 46                       | 0,00                                   | 4,492 % fällig am 26.08.2058                       | 17.864         | 13.486                   | 0,02                                   |
| IndyMac Mortgage Loan Trust            |                |                          |                                        | 6,620 % fällig am 25.08.2036                        | 66             | 65                       | 0,00                                   | 4,500 % fällig am 25.02.2058                       | 1.575          | 1.459                    | 0,00                                   |
| 3,195 % fällig am 25.07.2037           | 5.779          | 4.937                    | 0,01                                   | 6,920 % fällig am 25.08.2036                        | 3.496          | 2.672                    | 0,00                                   | 4,560 % fällig am 25.01.2058                       | 18.215         | 16.563                   | 0,02                                   |
| 3,203 % fällig am 25.06.2037           | 2.766          | 2.247                    | 0,00                                   | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust |                |                          |                                        | 4,576 % fällig am 26.12.2057                       | 48.428         | 39.310                   | 0,04                                   |
| 3,337 % fällig am 25.06.2037           | 1.536          | 1.376                    | 0,00                                   | 2,949 % fällig am 06.09.2038                        | 11.700         | 11.411                   | 0,01                                   | Lehman Mortgage Trust                              |                |                          |                                        |
| 3,341 % fällig am 25.05.2037           | 1.285          | 1.031                    | 0,00                                   | 4,128 % fällig am 05.07.2031                        | 33.610         | 30.903                   | 0,03                                   | 4,934 % fällig am 25.07.2037                       | 111            | 94                       | 0,00                                   |
| 3,386 % fällig am 25.04.2037           | 3.396          | 3.083                    | 0,00                                   | 4,248 % fällig am 05.07.2033                        | 10.000         | 9.501                    | 0,01                                   | 5,334 % fällig am 25.12.2035                       | 550            | 300                      | 0,00                                   |
| 3,421 % fällig am 25.06.2036           | 5.061          | 3.143                    | 0,00                                   | 4,549 % fällig am 05.07.2033                        | 3.839          | 3.073                    | 0,00                                   | 5,750 % fällig am 25.01.2037                       | 288            | 162                      | 0,00                                   |
| 3,453 % fällig am 25.08.2037           | 4.063          | 2.875                    | 0,00                                   | 4,950 % fällig am 05.07.2033                        | 38.900         | 29.476                   | 0,03                                   | 6,000 % fällig am 25.01.2036                       | 2.406          | 534                      | 0,00                                   |
| 3,612 % fällig am 25.08.2037           | 2.559          | 1.675                    | 0,00                                   | 5,350 % fällig am 05.07.2033                        | 9.940          | 6.461                    | 0,01                                   | 6,000 % fällig am 25.07.2036                       | 661            | 312                      | 0,00                                   |
| 3,736 % fällig am 25.08.2035           | 52             | 37                       | 0,00                                   | 5,409 % fällig am 15.02.2035                        | 29.250         | 28.792                   | 0,03                                   | 6,000 % fällig am 25.12.2036                       | 1.011          | 819                      | 0,00                                   |
| 3,794 % fällig am 25.04.2037           | 5.920          | 5.381                    | 0,01                                   | 5,569 % fällig am 15.06.2035                        | 2.180          | 1.884                    | 0,00                                   | Lehman XS Trust                                    |                |                          |                                        |
| 3,795 % fällig am 25.08.2036           | 144            | 113                      | 0,00                                   | 5,776 % fällig am 15.12.2036                        | 17.100         | 10.730                   | 0,01                                   | 4,674 % fällig am 25.08.2036                       | 45             | 47                       | 0,00                                   |
| 3,838 % fällig am 25.03.2036           | 2.909          | 2.000                    | 0,00                                   | 5,909 % fällig am 15.02.2035                        | 2.057          | 1.980                    | 0,00                                   | 4,704 % fällig am 25.02.2036                       | 256            | 238                      | 0,00                                   |
| 3,873 % fällig am 25.01.2037           | 120            | 104                      | 0,00                                   | 6,205 % fällig am 05.07.2033                        | 10.109         | 8.404                    | 0,01                                   | 4,734 % fällig am 25.11.2035                       | 1.118          | 1.114                    | 0,00                                   |
| 3,886 % fällig am 25.06.2037           | 5.695          | 3.468                    | 0,01                                   | JPMorgan Mortgage Trust                             |                |                          |                                        | 4,814 % fällig am 25.12.2036                       | 2.958          | 2.312                    | 0,00                                   |
| 3,897 % fällig am 25.07.2036           | 3.032          | 1.982                    | 0,00                                   | 4,154 % fällig am 27.07.2037                        | 347            | 324                      | 0,00                                   | 4,814 % fällig am 25.09.2046                       | 104            | 92                       | 0,00                                   |
| 3,936 % fällig am 25.05.2036           | 128            | 119                      | 0,00                                   | 4,428 % fällig am 25.10.2036                        | 154            | 86                       | 0,00                                   | 4,834 % fällig am 25.08.2046                       | 3.224          | 3.100                    | 0,00                                   |
| 3,943 % fällig am 25.05.2037           | 1.708          | 1.153                    | 0,00                                   | 4,481 % fällig am 25.01.2037                        | 1.062          | 812                      | 0,00                                   | 4,834 % fällig am 25.09.2046                       | 2.020          | 1.898                    | 0,00                                   |
| 4,120 % fällig am 25.03.2037           | 291            | 226                      | 0,00                                   | 4,523 % fällig am 25.05.2036                        | 1.104          | 903                      | 0,00                                   | 4,834 % fällig am 25.11.2046                       | 592            | 549                      | 0,00                                   |
| 4,124 % fällig am 25.09.2036           | 113            | 95                       | 0,00                                   | 4,763 % fällig am 25.05.2037                        | 303            | 258                      | 0,00                                   | 4,834 % fällig am 25.03.2047                       | 9.950          | 8.477                    | 0,01                                   |
| 4,213 % fällig am 25.05.2035           | 43             | 30                       | 0,00                                   | 4,825 % fällig am 25.08.2036                        | 2.841          | 2.292                    | 0,00                                   | 4,834 % fällig am 25.06.2047                       | 4.691          | 4.252                    | 0,01                                   |
| 4,365 % fällig am 25.12.2035           | 3.030          | 2.168                    | 0,00                                   | 4,867 % fällig am 25.04.2037                        | 3              | 2                        | 0,00                                   | 4,844 % fällig am 25.08.2046                       | 6.883          | 6.180                    | 0,01                                   |
| 4,486 % fällig am 25.09.2036           | 61             | 57                       | 0,00                                   | 5,032 % fällig am 25.05.2037                        | 1.131          | 1.000                    | 0,00                                   | 4,854 % fällig am 25.11.2046                       | 12.410         | 11.371                   | 0,01                                   |
| 4,552 % fällig am 25.11.2035           | 29             | 21                       | 0,00                                   | 5,078 % fällig am 25.11.2035                        | 1.340          | 1.052                    | 0,00                                   | 4,874 % fällig am 25.06.2047                       | 4.382          | 4.075                    | 0,01                                   |
| 4,629 % fällig am 25.09.2035           | 250            | 169                      | 0,00                                   | 5,198 % fällig am 25.05.2036                        | 33             | 28                       | 0,00                                   | 4,934 % fällig am 25.08.2037                       | 2.132          | 2.095                    | 0,00                                   |
| 4,674 % fällig am 25.07.2036           | 3.900          | 3.812                    | 0,01                                   | 5,250 % fällig am 25.04.2036                        | 2.223          | 1.941                    | 0,00                                   | 4,954 % fällig am 25.02.2046                       | 7.467          | 6.676                    | 0,01                                   |
| 4,694 % fällig am 25.10.2036           | 2.175          | 1.953                    | 0,00                                   | 5,389 % fällig am 25.08.2035                        | 142            | 129                      | 0,00                                   | 5,334 % fällig am 25.08.2047                       | 8.122          | 7.267                    | 0,01                                   |
| 4,708 % fällig am 25.11.2035           | 1.947          | 1.514                    | 0,00                                   | 5,430 % fällig am 25.05.2036                        | 2.134          | 1.841                    | 0,00                                   | 5,399 % fällig am 25.11.2035                       | 24             | 24                       | 0,00                                   |
| 4,754 % fällig am 25.04.2037           | 743            | 657                      | 0,00                                   | 5,500 % fällig am 25.07.2036                        | 2.487          | 1.042                    | 0,00                                   | 5,899 % fällig am 25.03.2047                       | 2.443          | 2.187                    | 0,00                                   |
| 4,774 % fällig am 25.01.2037           | 6.694          | 6.001                    | 0,01                                   | 5,701 % fällig am 25.07.2035                        | 149            | 143                      | 0,00                                   | 6,134 % fällig am 25.09.2047                       | 1.195          | 1.072                    | 0,00                                   |
| 4,784 % fällig am 25.06.2036           | 2.646          | 2.302                    | 0,00                                   | 5,710 % fällig am 25.11.2035                        | 2.625          | 2.156                    | 0,00                                   | Liberty Trust                                      |                |                          |                                        |
| 4,794 % fällig am 25.08.2036           | 7.355          | 4.680                    | 0,01                                   | 5,750 % fällig am 25.01.2036                        | 974            | 418                      | 0,00                                   | 4,923 % fällig am 25.08.2056                       | AUD 34.500     | 22.661                   | 0,02                                   |
| 4,794 % fällig am 25.02.2037           | 5.163          | 4.741                    | 0,01                                   | 5,816 % fällig am 25.10.2037                        | 1.886          | 1.506                    | 0,00                                   | London Wall Mortgage Capital PLC                   |                |                          |                                        |
| 4,794 % fällig am 25.07.2047           | 3.000          | 1.970                    | 0,00                                   | 6,000 % fällig am 25.08.2037                        | 16.492         | 7.170                    | 0,01                                   | 4,987 % fällig am 15.05.2051                       | £ 13.609       | 18.672                   | 0,02                                   |
| 4,805 % fällig am 25.09.2036           | 1.197          | 752                      | 0,00                                   | 6,250 % fällig am 25.08.2037                        | 5.068          | 1.379                    | 0,00                                   | 5,227 % fällig am 15.05.2057                       | 16.429         | 22.592                   | 0,02                                   |
| 4,814 % fällig am 25.10.2036           | 4.613          | 1.808                    | 0,00                                   | 6,261 % fällig am 25.09.2035                        | 253            | 240                      | 0,00                                   | Ludgate Funding PLC                                |                |                          |                                        |
| 4,814 % fällig am 25.04.2037           | 1.250          | 1.105                    | 0,00                                   | 6,435 % fällig am 25.04.2035                        | 226            | 216                      | 0,00                                   | 2,285 % fällig am 01.12.2060                       | € 1.658        | 1.724                    | 0,00                                   |
| 4,834 % fällig am 25.06.2046           | 4.945          | 4.320                    | 0,01                                   | 6,476 % fällig am 25.06.2034                        | 4              | 4                        | 0,00                                   | 2,488 % fällig am 01.01.2061                       | 2.107          | 2.390                    | 0,00                                   |
| 4,834 % fällig am 25.11.2046           | 5.391          | 5.114                    | 0,01                                   | 6,500 % fällig am 25.01.2035                        | 1.077          | 1.125                    | 0,00                                   | 2,568 % fällig am 01.01.2061                       | 616            | 685                      | 0,00                                   |
| 4,854 % fällig am 25.11.2036           | 269            | 255                      | 0,00                                   | 6,500 % fällig am 25.07.2036                        | 217            | 69                       | 0,00                                   | 2,638 % fällig am 01.01.2061                       | 2.052          | 2.242                    | 0,00                                   |
| 4,854 % fällig am 25.02.2046           | 4.393          | 3.340                    | 0,00                                   | 6,500 % fällig am 25.08.2036                        | 4.320          | 1.334                    | 0,00                                   | 3,028 % fällig am 01.01.2061                       | 9.638          | 10.978                   | 0,01                                   |
| 4,854 % fällig am 25.04.2046           | 2.371          | 2.150                    | 0,00                                   | 6,582 % fällig am 25.08.2035                        | 299            | 306                      | 0,00                                   | 4,547 % fällig am 01.12.2060                       | £ 630          | 850                      | 0,00                                   |
| 4,854 % fällig am 25.05.2046           | 6.215          | 5.637                    | 0,01                                   | 6,830 % fällig am 25.08.2035                        | 5              | 4                        | 0,00                                   | 4,599 % fällig am 01.01.2061                       | 4.515          | 5.866                    | 0,01                                   |
| 4,874 % fällig am 25.04.2046           | 2.231          | 2.024                    | 0,00                                   | 7,279 % fällig am 25.08.2036                        | 80             | 65                       | 0,00                                   | 4,657 % fällig am 01.12.2060                       | 2.163          | 2.655                    | 0,00                                   |
| 4,894 % fällig am 25.04.2035           | 199            | 186                      | 0,00                                   | JPMorgan Resecuritization Trust                     |                |                          |                                        | Lugo Funding DAC                                   |                |                          |                                        |
| 4,934 % fällig am 25.11.2036           | 2.944          | 2.912                    | 0,00                                   | 4,500 % fällig am 26.04.2037                        | 1.382          | 603                      | 0,00                                   | 3,049 % fällig am 26.05.2066                       | € 54.934       | 64.619                   | 0,07                                   |
| 4,934 % fällig am 25.09.2037           | 3.263          | 2.990                    | 0,00                                   | 5,250 % fällig am 26.09.2036                        | 329            | 315                      | 0,00                                   | Luminent Mortgage Trust                            |                |                          |                                        |
| 4,954 % fällig am 25.07.2035           | 4.125          | 2.757                    | 0,00                                   | 5,750 % fällig am 26.05.2037                        | 112            | 34                       | 0,00                                   | 4,714 % fällig am 25.01.2037                       | \$ 1.799       | 1.453                    | 0,00                                   |
| 4,974 % fällig am 25.10.2036           | 1.879          | 735                      | 0,00                                   | 6,000 % fällig am 26.09.2036                        | 424            | 325                      | 0,00                                   | 4,774 % fällig am 25.12.2036                       | 2.345          | 2.140                    | 0,00                                   |
| 5,014 % fällig am 25.01.2036           | 2.790          | 1.875                    | 0,00                                   | 6,010 % fällig am 26.09.2037                        | 1.117          | 838                      | 0,00                                   | 4,794 % fällig am 25.12.2036                       | 59             | 57                       | 0,00                                   |
| 5,030 % fällig am 25.09.2037           | 10.979         | 7.955                    | 0,01                                   | Jubilee Place BV                                    |                |                          |                                        | 4,814 % fällig am 25.05.2046                       | 715            | 624                      | 0,00                                   |
| 5,032 % fällig am 25.09.2035           | 41             | 37                       | 0,00                                   | 2,724 % fällig am 18.09.2062                        | € 23.995       | 28.184                   | 0,03                                   | 4,834 % fällig am 25.02.2046                       | 1.606          | 1.147                    | 0,00                                   |
| 5,034 % fällig am 25.07.2035           | 961            | 771                      | 0,00                                   | 2,804 % fällig am 17.09.2060                        | 21.419         | 25.215                   | 0,03                                   | MA Money Pinnacle Residential Securitisation Trust |                |                          |                                        |
| 5,034 % fällig am 25.11.2035           | 39             | 22                       | 0,00                                   | 3,093 % fällig am 17.07.2058                        | 8.124          | 9.546                    | 0,01                                   | 4,535 % fällig am 15.04.2066                       | AUD 18.598     | 12.195                   | 0,01                                   |
| 5,209 % fällig am 25.08.2034           | 59             | 56                       | 0,00                                   | 3,113 % fällig am 17.01.2059                        | 16.950         | 19.941                   | 0,02                                   | Mansard Mortgages PLC                              |                |                          |                                        |
| 5,214 % fällig am 25.12.2034           | 573            | 443                      | 0,00                                   | Jupiter Mortgage PLC                                |                |                          |                                        | 4,616 % fällig am 15.04.2047                       | £ 1.222        | 1.654                    | 0,00                                   |
| 5,234 % fällig am 25.07.2046           | 4.102          | 3.639                    | 0,01                                   | 5,298 % fällig am 20.07.2055                        | £ 2.628        | 3.613                    | 0,01                                   | 5,608 % fällig am 15.12.2049                       | 2.127          |                          |                                        |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S)                | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S)                      | MARKT-<br>WERT<br>(000S)     | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |       |          |      |
|---------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------|-----------------------------------|-------|----------|------|
| 4,314 % fällig am 25.03.2035                                        | \$             | 396                      | \$ 353                            | 0,00                                                        | Morgan Stanley Re-REMIC Trust | \$                       | 2.173                             | \$ 1.909                                        | 0,00                                | 6,123 % fällig am 16.01.2060 | £                                 | 3.126 | \$ 4.291 | 0,01 |
| 4,530 % fällig am 25.03.2035                                        |                | 78                       | 69                                | 0,00                                                        | 4,252 % fällig am 26.12.2036  |                          |                                   |                                                 |                                     | 7,723 % fällig am 16.01.2060 |                                   | 1.250 | 1.721    | 0,00 |
| 5,249 % fällig am 25.12.2046                                        | 6.442          | 6.082                    | 0,01                              | Morgan Stanley Resecuritization Trust                       |                               |                          |                                   |                                                 |                                     | 8,223 % fällig am 16.01.2060 |                                   | 681   | 933      | 0,00 |
| 5,370 % fällig am 25.03.2035                                        | 42             | 35                       | 0,00                              | 3,747 % fällig am 26.11.2046                                | 2.482                         | 2.153                    | 0,00                              | Polaris PLC                                     |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| 5,534 % fällig am 25.09.2037                                        | 7.084          | 2.835                    | 0,00                              | 3,925 % fällig am 26.06.2047                                | 4.757                         | 3.752                    | 0,01                              | 5,014 % fällig am 23.12.2058                    | 13.388                              | 18.349                       | 0,02                              |       |          |      |
| 6,559 % fällig am 25.12.2035                                        | 604            | 592                      | 0,00                              | Mortgage Equity Conversion Asset Trust                      |                               |                          |                                   | 5,024 % fällig am 23.10.2059                    | 19.368                              | 26.559                       | 0,03                              |       |          |      |
| 6,562 % fällig am 25.09.2034                                        | 609            | 549                      | 0,00                              | 4,460 % fällig am 25.02.2042                                | 1.615                         | 1.594                    | 0,00                              | 5,044 % fällig am 26.02.2068                    | 50.652                              | 69.515                       | 0,07                              |       |          |      |
| <b>MASTR Alternative Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Mortgage Funding PLC</b>                                 |                               |                          |                                   | 6,874 % fällig am 23.05.2059                    | 2.768                               | 3.797                        | 0,01                              |       |          |      |
| 5,500 % fällig am 25.04.2035                                        | 1.689          | 1.003                    | 0,00                              | 5,458 % fällig am 13.03.2046                                | £                             | 6.602                    | 9.039                             | 0,01                                            | <b>Precise Mortgage Funding PLC</b> |                              |                                   |       |          |      |
| 5,750 % fällig am 25.08.2035                                        | 1.284          | 578                      | 0,00                              | MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust             |                               |                          |                                   | 5,203 % fällig am 16.07.2060                    | 43.889                              | 60.400                       | 0,06                              |       |          |      |
| 6,500 % fällig am 25.05.2034                                        | 46             | 47                       | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.06.2047                                | \$                            | 6.944                    | 6.083                             | 0,01                                            | 6,398 % fällig am 16.10.2056        | 1.200                        | 1.647                             | 0,00  |          |      |
| <b>MASTR Asset Securitization Trust</b>                             |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.09.2037                                | 2.965                         | 2.256                    | 0,00                              | 6,773 % fällig am 16.10.2056                    | 1.000                               | 1.372                        | 0,00                              |       |          |      |
| 5,000 % fällig am 25.07.2019                                        | 0              | 0                        | 0,00                              | <b>MortgageIT Trust</b>                                     |                               |                          |                                   | 7,148 % fällig am 16.10.2056                    | 1.000                               | 1.371                        | 0,00                              |       |          |      |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                                        | 1.614          | 888                      | 0,00                              | 4,994 % fällig am 25.10.2035                                | 71                            | 71                       | 0,00                              | 8,323 % fällig am 16.10.2056                    | 1.000                               | 1.372                        | 0,00                              |       |          |      |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036                                        | 560            | 455                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.08.2035                                | 1.024                         | 1.019                    | 0,00                              | <b>Primrose Residential DAC</b>                 |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| <b>MASTR Reperforming Loan Trust</b>                                |                |                          |                                   | 5,054 % fällig am 25.12.2035                                | 1.067                         | 1.061                    | 0,00                              | 3,399 % fällig am 24.10.2061                    | €                                   | 21.793                       | 25.597                            | 0,03  |          |      |
| 4,794 % fällig am 25.07.2035                                        | 2.699          | 1.304                    | 0,00                              | 5,319 % fällig am 25.02.2035                                | 185                           | 185                      | 0,00                              | <b>Progress Trust</b>                           |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| 7,000 % fällig am 25.08.2034                                        | 9              | 6                        | 0,00                              | <b>Mortimer BTL PLC</b>                                     |                               |                          |                                   | 4,803 % fällig am 12.08.2055                    | AUD                                 | 37.634                       | 24.723                            | 0,03  |          |      |
| <b>MASTR Seasoned Securitization Trust</b>                          |                |                          |                                   | 5,409 % fällig am 22.12.2056                                | £                             | 22.886                   | 31.522                            | 0,03                                            | <b>Proteus RMBS DAC</b>             |                              |                                   |       |          |      |
| 4,834 % fällig am 25.10.2032                                        | 107            | 99                       | 0,00                              | <b>Mortimer Mix PLC</b>                                     |                               |                          |                                   | 0,000 % fällig am                               |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| <b>Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust</b> |                |                          |                                   | 5,069 % fällig am 22.09.2067                                | 24.341                        | 33.463                   | 0,04                              | 29.10.2054 (b)(f)                               | €                                   | 14.190                       | 11.464                            | 0,01  |          |      |
| 4,866 % fällig am 15.12.2030                                        | 1              | 1                        | 0,00                              | <b>MSDB Trust</b>                                           |                               |                          |                                   | 3,074 % fällig am 29.10.2054                    |                                     | 16.522                       | 19.065                            | 0,02  |          |      |
| 4,906 % fällig am 15.06.2030                                        | 186            | 181                      | 0,00                              | 3,427 % fällig am 11.07.2039                                | \$                            | 1.600                    | 1.536                             | 0,00                                            | 3,524 % fällig am 29.10.2054        |                              | 8.681                             | 9.944 | 0,01     |      |
| <b>Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust</b>                   |                |                          |                                   | <b>Natixis Commercial Mortgage Securities Trust</b>         |                               |                          |                                   | 3,824 % fällig am 29.10.2054                    |                                     | 6.313                        | 7.166                             | 0,01  |          |      |
| 4,563 % fällig am 25.06.2037                                        | 2.126          | 966                      | 0,00                              | 3,858 % fällig am 10.04.2037                                | 5.780                         | 5.071                    | 0,01                              | 4,804 % fällig am 29.10.2054                    |                                     | 4.735                        | 5.365                             | 0,01  |          |      |
| 4,834 % fällig am 25.03.2037                                        | 10.312         | 2.759                    | 0,00                              | <b>New Century Alternative Mortgage Loan Trust</b>          |                               |                          |                                   | 6,674 % fällig am 29.10.2054                    |                                     | 3.946                        | 4.458                             | 0,01  |          |      |
| 4,854 % fällig am 25.04.2037                                        | 11.326         | 1.927                    | 0,00                              | 4,512 % fällig am 25.10.2036                                | 6.025                         | 1.099                    | 0,00                              | <b>Puma Trust</b>                               |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                       |                |                          |                                   | 6,810 % fällig am 25.07.2036                                | 3.126                         | 613                      | 0,00                              | 4,675 % fällig am 18.04.2056                    | AUD                                 | 57.408                       | 37.656                            | 0,04  |          |      |
| 0,221 % fällig am 25.01.2029                                        |                |                          |                                   | <b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>                  |                               |                          |                                   | <b>RBSGC Mortgage Loan Trust</b>                |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| (a)                                                                 | 261            | 1                        | 0,00                              | 3,750 % fällig am 25.08.2055                                | 3.382                         | 3.286                    | 0,00                              | 4,884 % fällig am 25.01.2037                    | \$                                  | 478                          | 235                               | 0,00  |          |      |
| 4,894 % fällig am 25.04.2029                                        | 273            | 252                      | 0,00                              | 4,000 % fällig am 25.04.2057                                | 5.281                         | 5.105                    | 0,01                              | <b>RBSGC Structured Trust</b>                   |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| 5,094 % fällig am 25.06.2028                                        | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 25.05.2058                                | 11.965                        | 11.726                   | 0,01                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                    |                                     | 50                           | 42                                | 0,00  |          |      |
| 5,094 % fällig am 25.09.2029                                        | 1              | 1                        | 0,00                              | <b>Newgate Funding PLC</b>                                  |                               |                          |                                   | <b>RBSSP Resecuritization Trust</b>             |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| 5,154 % fällig am 25.08.2035                                        | 2.952          | 2.765                    | 0,00                              | 2,215 % fällig am 01.12.2050                                | €                             | 1.245                    | 1.350                             | 0,00                                            | 4,252 % fällig am 26.12.2036        |                              | 2.557                             | 2.445 | 0,00     |      |
| 5,205 % fällig am 25.05.2036                                        | 3              | 2                        | 0,00                              | 2,346 % fällig am 01.12.2050                                | 2.956                         | 3.388                    | 0,00                              | 4,679 % fällig am 27.06.2036                    |                                     | 2.100                        | 1.837                             | 0,00  |          |      |
| 5,259 % fällig am 25.11.2029                                        | 357            | 298                      | 0,00                              | 2,575 % fällig am 15.12.2050                                | 7.238                         | 8.360                    | 0,01                              | 5,177 % fällig am 26.01.2036                    |                                     | 3.610                        | 3.316                             | 0,00  |          |      |
| 5,379 % fällig am 25.08.2036                                        | 1.832          | 1.670                    | 0,00                              | 4,517 % fällig am 01.12.2050                                | £                             | 16.409                   | 22.165                            | 0,02                                            | 6,000 % fällig am 26.05.2036        |                              | 1.443                             | 546   | 0,00     |      |
| 5,381 % fällig am 25.01.2029                                        | 22             | 22                       | 0,00                              | 4,518 % fällig am 15.12.2050                                | 6.224                         | 8.299                    | 0,01                              | 6,000 % fällig am 26.08.2037                    |                                     | 526                          | 463                               | 0,00  |          |      |
| 5,439 % fällig am 25.09.2029                                        | 46             | 44                       | 0,00                              | 4,561 % fällig am 01.12.2050                                | 2.187                         | 2.954                    | 0,00                              | 6,000 % fällig am 26.10.2037                    |                                     | 1.759                        | 1.626                             | 0,00  |          |      |
| 5,892 % fällig am 25.11.2035                                        | 45             | 42                       | 0,00                              | 5,358 % fällig am 15.12.2050                                | 5.632                         | 7.567                    | 0,01                              | <b>Reperforming Loan REMIC Trust</b>            |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| 6,018 % fällig am 25.12.2035                                        | 1.287          | 1.269                    | 0,00                              | 5,608 % fällig am 15.12.2050                                | 367                           | 489                      | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.07.2036                    |                                     | 217                          | 204                               | 0,00  |          |      |
| 6,210 % fällig am 25.12.2032                                        | 3              | 3                        | 0,00                              | <b>Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust</b> |                               |                          |                                   | <b>Residential Accredited Loans, Inc. Trust</b> |                                     |                              |                                   |       |          |      |
| 6,624 % fällig am 25.12.2034                                        | 108            | 107                      | 0,00                              | 0,000 % fällig am 25.02.2036                                | \$                            | 3                        | 0                                 | 0,00                                            | 2,116 % fällig am 25.12.2036 (a)    |                              | 1.580                             | 196   | 0,00     |      |
| 6,978 % fällig am 25.01.2037                                        | 10             | 10                       | 0,00                              | 4,763 % fällig am 25.06.2036                                |                               | 241                      | 174                               | 0,00                                            | 2,206 % fällig am 25.01.2037 (a)    |                              | 1.585                             | 181   | 0,00     |      |
| 7,062 % fällig am 25.01.2037                                        | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.06.2037                                |                               | 493                      | 411                               | 0,00                                            | 2,216 % fällig am 25.12.2036 (a)    |                              | 651                               | 77    | 0,00     |      |
| <b>Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust</b>               |                |                          |                                   | 4,954 % fällig am 25.12.2035                                |                               | 715                      | 172                               | 0,00                                            | 2,766 % fällig am 25.12.2036 (a)    |                              | 958                               | 146   | 0,00     |      |
| 4,585 % fällig am 25.04.2037                                        | 1.349          | 1.115                    | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.05.2035                                | 1.450                         | 671                      | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.05.2037                    |                                     | 87                           | 78                                | 0,00  |          |      |
| 6,530 % fällig am 25.08.2036                                        | 1.198          | 1.025                    | 0,00                              | 5,434 % fällig am 25.05.2035                                |                               | 941                      | 839                               | 0,00                                            | 4,684 % fällig am 25.03.2037        |                              | 1.675                             | 1.267 | 0,00     |      |
| <b>Merrion Square Residential DAC</b>                               |                |                          |                                   | 5,454 % fällig am 25.08.2034                                |                               | 232                      | 229                               | 0,00                                            | 4,734 % fällig am 25.08.2035        |                              | 132                               | 93    | 0,00     |      |
| 2,999 % fällig am 24.03.2081                                        | €              | 42.135                   | 49.523                            | 5,688 % fällig am 25.07.2035                                |                               | 129                      | 129                               | 0,00                                            | 4,734 % fällig am 25.12.2036        |                              | 2.908                             | 2.115 | 0,00     |      |
| <b>Metlife Securitization Trust</b>                                 |                |                          |                                   | 6,169 % fällig am 25.03.2047                                |                               | 668                      | 614                               | 0,00                                            | 4,734 % fällig am 25.06.2037        |                              | 794                               | 740   | 0,00     |      |
| 3,750 % fällig am 25.03.2057                                        | \$             | 3.945                    | 3.834                             | 6,215 % fällig am 25.08.2036                                | 9.984                         | 2.639                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.02.2047                    |                                     | 1.154                        | 1.039                             | 0,00  |          |      |
| <b>Mill City Mortgage Loan Trust</b>                                |                |                          |                                   | 6,408 % fällig am 25.05.2036                                |                               | 703                      | 127                               | 0,00                                            | 4,754 % fällig am 25.01.2037        |                              | 3.945                             | 3.542 | 0,01     |      |
| 3,250 % fällig am 25.01.2061                                        | 9.766          | 8.209                    | 0,01                              | 6,495 % fällig am 25.03.2047                                | 1.229                         | 1.128                    | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.08.2035                    |                                     | 93                           | 85                                | 0,00  |          |      |
| <b>Morgan Stanley Capital Trust</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Nomura Resecuritization Trust</b>                        |                               |                          |                                   | 4,774 % fällig am 25.12.2036                    |                                     | 1.827                        | 1.641                             | 0,00  |          |      |
| 5,209 % fällig am 15.08.2033                                        | 7.568          | 6.252                    | 0,01                              | 1,927 % fällig am 26.03.2037                                | 1.997                         | 1.607                    | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.01.2037                    |                                     | 1.496                        | 1.321                             | 0,00  |          |      |
| <b>Morgan Stanley Mortgage Capital Holdings LLC</b>                 |                |                          |                                   | 2,487 % fällig am 26.02.2037                                | 1.009                         | 825                      | 0,00                              | 4,784 % fällig am 25.12.2036                    |                                     | 1.723                        | 1.324                             | 0,00  |          |      |
| 3,397 % fällig am 13.09.2039                                        | 14.710         | 13.851                   | 0,02                              | 5,334 % fällig am 25.07.2036                                | 17.739                        | 17.175                   | 0,02                              | 4,794 % fällig am 25.07.2036                    |                                     | 6.300                        | 2.499                             | 0,00  |          |      |
| <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                           |                |                          |                                   | <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                      |                               |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.01.2037                    |                                     | 1.575                        | 1.068                             | 0,00  |          |      |
| 2,208 % fällig am 25.06.2037                                        | 3.513          | 1.816                    | 0,00                              | 0,445 % fällig am 25.09.2046                                | 9.101                         | 3.217                    | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.07.2036                    |                                     | 994                          | 913                               | 0,00  |          |      |
| 3,368 % fällig am 25.11.2037                                        | 6.096          | 4.260                    | 0,01                              | <b>OBX Trust</b>                                            |                               |                          |                                   | 4,814 % fällig am 25.09.2036                    |                                     | 1.374                        | 1.263                             | 0,00  |          |      |
| 3,473 % fällig am 25.11.2037                                        | 82             | 52                       | 0,00                              | 5,084 % fällig am 25.06.2057                                | 1.153                         | 1.131                    | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.12.2036                    |                                     | 1.066                        | 956                               | 0,00  |          |      |
| 4,047 % fällig am 25.05.2036                                        | 1.488          | 813                      | 0,00                              | <b>Olympus Trust</b>                                        |                               |                          |                                   | 4,814 % fällig am 25.07.2037                    |                                     | 3.298                        | 3.088                             | 0,00  |          |      |
| 4,466 % fällig am 25.10.2037                                        | 613            | 405                      | 0,00                              | 4,508 % fällig am 10.10.2056                                | AUD                           | 9.726                    | 6.373                             | 0,01                                            | 4,814 % fällig am 25.05.2047        |                              | 810                               | 743   | 0,00     |      |
| 4,664 % fällig am 25.03.2036                                        | 34             | 19                       | 0,00                              | <b>ORDE Trust</b>                                           |                               |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.08.2036                    |                                     | 112                          | 87                                | 0,00  |          |      |
| 4,754 % fällig am 25.06.2036                                        | 3.528          | 691                      | 0,00                              | 4,555 % fällig am 11.06.2056                                | 8.104                         | 5.310                    | 0,01                              | 4,834 % fällig am 25.05.2037                    |                                     | 2.531                        | 1.925                             | 0,00  |          |      |
| 4,774 % fällig am 25.08.2036                                        | 5.376          | 1.201                    | 0,00                              | <b>PHH Alternative Mortgage Trust</b>                       |                               |                          |                                   | 4,864 % fällig am 25.05.2046                    |                                     | 2.430                        | 2.198                             | 0,00  |          |      |
| 4,944 % fällig am 25.02.2047                                        | 6.820          | 2.722                    | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.02.2037                                | \$                            | 3.217                    | 2.384                             | 0,00                                            | 4,920 % fällig am 25.02.2035        |                              | 419                               | 373   | 0,00     |      |
| 5,500 % fällig am 25.10.2037                                        | 202            | 197                      | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.05.2037                                | 1.488                         | 1.326                    | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.02.2046                    |                                     | 62                           | 32                                | 0,00  |          |      |
| 5,559 % fällig am 25.09.2035                                        | 1.724          | 1.740                    | 0,00                              | 5,134 % fällig am 25.07.2037                                | 606                           | 596                      | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.05.2046                    |                                     | 2.148                        | 1.779                             | 0,00  |          |      |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036                                        | 260            | 244                      | 0,00                              | <b>Pierpont BTL PLC</b>                                     |                               |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.04.2036                    |                                     | 1.756                        | 1.533                             | 0,00  |          |      |
| 5,938 % fällig am 25.08.2034                                        | 19             | 19                       | 0,00                              | 5,079 % fällig am 21.09.2061                                | £                             | 24.705                   | 33.990                            | 0,04                                            | 5,034 % fällig am 25.03.2037        |                              | 3.441                             | 2.661 | 0,00     |      |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035                                        | 1.883          | 692                      | 0,00                              | 5,339 % fällig am 21.09.2054                                | 7.456                         | 10.269                   | 0,01                              | 5,249 % fällig am 25.09.2046                    |                                     | 4.159                        | 3.747                             | 0,01  |          |      |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036                                        | 5.362          | 2.587                    | 0,00                              | <b>PMF PLC</b>                                              |                               |                          |                                   | 5,397 % fällig am 25.10.2037                    |                                     | 4.326                        | 3.481                             | 0,01  |          |      |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037                                        | 10.426         | 4.972                    | 0,01                              | 0,000 % fällig am 16.01.2060 (f)                            |                               | 20                       | 3.541                             | 5,399 % fällig am 25.01.2046                    |                                     | 142                          | 111                               | 0,00  |          |      |
| 6,075 % fällig am 25.06.2036                                        | 835            | 818                      | 0,00                              | 5,023 % fällig am 16.01.2060                                | 34.386                        | 47.283                   | 0,05                              | 5,436 % fällig am 25.07.2035                    |                                     | 621                          | 586                               | 0,00  |          |      |
| 6,159 % fällig am 25.11.2035                                        | 1.855          | 1.863                    | 0,00                              | 5,323 % fällig am 16.01.2060                                | 5.628                         | 7.721                    | 0,01                              | 5,500 % fällig am 25.06.2035                    |                                     | 689                          | 580                               | 0,00  |          |      |
| 6,354 % fällig am 25.08.2036                                        | 1.232          | 208                      | 0,00                              | 5,623 % fällig am 16.01.2060                                | 3.752                         | 5.147                    | 0,01                              | 5,500 % fällig am 25.09.2035                    |                                     | 1.009                        | 805                               | 0,00  |          |      |
| 6,414 % fällig am 25.09.2035                                        | 829            | 869                      | 0,00                              |                                                             |                               |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.02.2036                    |                                     | 467                          | 384                               | 0,00  |          |      |
| 6,500 % fällig am 25.02.2036                                        | 99             | 41                       | 0,00                              |                                                             |                               |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.01.2037                    |                                     | 1.269                        | 955                               | 0,00  |          |      |

| BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 6,000 % fällig am 25.09.2035                        | \$ 1.613       | \$ 1.421                 | 0,00                              | Rochester Financing PLC                        |                |                          |                                   | 5,032 % fällig am 19.07.2034                          | \$ 278         | \$ 256                   | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035                        | 1.314          | 1.141                    | 0,00                              | 4,938 % fällig am 18.12.2044                   | £ 1.369        | \$ 1.875                 | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.08.2036                          | 5.946          | 4.323                    | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036                        | 856            | 700                      | 0,00                              | Roundstone Securities DAC                      |                |                          |                                   | 5,132 % fällig am 19.12.2034                          | 76             | 70                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036                        | 367            | 308                      | 0,00                              | 0,000 % fällig am 28.06.2058                   | € 0            | 0                        | 0,00                              | 5,534 % fällig am 25.09.2047                          | 4.273          | 3.617                    | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                        | 2.109          | 1.677                    | 0,00                              | 1,000 % fällig am 28.06.2058                   | 4.957          | 4.896                    | 0,01                              | 5,557 % fällig am 19.12.2033                          | 198            | 191                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036                        | 221            | 179                      | 0,00                              | 2,880 % fällig am 28.06.2058                   | 89.092         | 104.790                  | 0,11                              | 5,799 % fällig am 25.12.2035                          | 1.012          | 849                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036                        | 4.038          | 3.378                    | 0,00                              | 2,980 % fällig am 28.06.2058                   | 8.481          | 9.960                    | 0,01                              | 5,859 % fällig am 25.03.2046                          | 617            | 570                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036                        | 722            | 572                      | 0,00                              | 3,180 % fällig am 28.06.2058                   | 7.201          | 8.417                    | 0,01                              | 5,899 % fällig am 25.08.2047                          | 7.876          | 6.650                    | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036                        | 155            | 123                      | 0,00                              | 3,980 % fällig am 28.06.2058                   | 6.000          | 6.988                    | 0,01                              | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037                        | 3.211          | 2.548                    | 0,00                              | 4,000 % fällig am 28.06.2058                   | 13.602         | 5.156                    | 0,01                              | 4,684 % fällig am 25.07.2035                          | 1.424          | 1.331                    | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037                        | 313            | 268                      | 0,00                              | 4,980 % fällig am 28.06.2058                   | 3.600          | 4.169                    | 0,01                              | 4,684 % fällig am 25.05.2036                          | 1.647          | 1.344                    | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037                        | 296            | 248                      | 0,00                              | 5,480 % fällig am 28.06.2058                   | 1.920          | 2.182                    | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.01.2036                          | 541            | 451                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037                        | 259            | 217                      | 0,00                              | Sapphire Trust Central Finance                 |                |                          |                                   | SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust          |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037                        | 366            | 294                      | 0,00                              | 4,485 % fällig am 14.06.2066                   | AUD 33.595     | 22.023                   | 0,02                              | 4,241 % fällig am 25.06.2037                          | 673            | 599                      | 0,00                              |
| 6,104 % fällig am 25.11.2037                        | 395            | 332                      | 0,00                              | 4,585 % fällig am 14.01.2066                   | 268            | 176                      | 0,00                              | 4,979 % fällig am 25.10.2037                          | 470            | 419                      | 0,00                              |
| 6,250 % fällig am 25.01.2037                        | 90             | 75                       | 0,00                              | 5,005 % fällig am 14.01.2066                   | 17.900         | 11.760                   | 0,01                              | TBW Mortgage-Backed Trust                             |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037                        | 2.302          | 1.910                    | 0,00                              | Sequoia Mortgage Trust                         |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.07.2036                          | 10             | 1                        | 0,00                              |
| 6,287 % fällig am 25.02.2035                        | 384            | 181                      | 0,00                              | 4,487 % fällig am 20.06.2037                   | \$ 2.917       | 2.357                    | 0,00                              | 5,965 % fällig am 25.07.2037                          | 3.401          | 967                      | 0,00                              |
| 6,293 % fällig am 25.02.2036                        | 1.087          | 925                      | 0,00                              | 4,504 % fällig am 20.07.2037                   | 1.250          | 990                      | 0,00                              | 6,450 % fällig am 25.03.2037                          | 12.684         | 2.579                    | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036                        | 2.355          | 1.930                    | 0,00                              | 5,072 % fällig am 20.11.2034                   | 469            | 442                      | 0,00                              | TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos            |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036                        | 435            | 181                      | 0,00                              | 5,290 % fällig am 20.02.2034                   | 145            | 131                      | 0,00                              | 2,216 % fällig am 22.06.2040                          | € 3.086        | 3.439                    | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036                        | 194            | 163                      | 0,00                              | Sestante Finance SRL                           |                |                          |                                   | Temple Quay PLC                                       |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.02.2037                        | 3.932          | 3.313                    | 0,00                              | 2,403 % fällig am 23.07.2046                   | € 10.287       | 11.667                   | 0,01                              | 6,293 % fällig am 24.07.2085                          | £ 15.905       | 21.842                   | 0,02                              |
| 6,750 % fällig am 25.06.2037                        | 873            | 324                      | 0,00                              | Shamrock Residential DAC                       |                |                          |                                   | 7,293 % fällig am 24.07.2085                          | 14.681         | 20.178                   | 0,02                              |
| 7,519 % fällig am 25.08.2047                        | 7.433          | 1.117                    | 0,00                              | 2,899 % fällig am 24.06.2071                   | 24.320         | 28.558                   | 0,03                              | Terwin Mortgage Trust                                 |                |                          |                                   |
| Residential Asset Securitization Trust              |                |                          |                                   | Stratton BTL Mortgage Funding PLC              |                |                          |                                   | 4,615 % fällig am 25.10.2037                          | \$ 5.081       | 1.608                    | 0,00                              |
| 4,744 % fällig am 25.04.2037                        | 4.128          | 869                      | 0,00                              | 5,028 % fällig am 20.01.2054                   | £ 9.541        | 13.079                   | 0,01                              | Thornburg Mortgage Securities Trust                   |                |                          |                                   |
| 4,984 % fällig am 25.11.2035                        | 106            | 51                       | 0,00                              | Stratton Hawkmoor PLC                          |                |                          |                                   | 2,903 % fällig am 25.03.2044                          | 435            | 426                      | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034                        | 656            | 661                      | 0,00                              | 5,737 % fällig am 25.02.2053                   | 59.613         | 81.907                   | 0,08                              | 4,400 % fällig am 25.09.2037                          | 183            | 182                      | 0,00                              |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035                        | 2.568          | 1.176                    | 0,00                              | 5,987 % fällig am 25.02.2053                   | 37.882         | 51.946                   | 0,05                              | 4,481 % fällig am 25.04.2036                          | 676            | 615                      | 0,00                              |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036                        | 1.130          | 1.098                    | 0,00                              | 6,237 % fällig am 25.02.2053                   | 29.847         | 40.662                   | 0,04                              | 4,918 % fällig am 25.09.2037                          | 336            | 333                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.07.2035                        | 1.211          | 716                      | 0,00                              | Stratton Mortgage Funding PLC                  |                |                          |                                   | 5,522 % fällig am 25.10.2046                          | 33             | 31                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036                        | 17.172         | 6.443                    | 0,01                              | 5,139 % fällig am 28.06.2050                   | 23.241         | 31.882                   | 0,03                              | 5,677 % fällig am 25.07.2036                          | 1.158          | 929                      | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036                        | 2.871          | 1.247                    | 0,00                              | 5,214 % fällig am 25.06.2049                   | 24.659         | 33.831                   | 0,04                              | 5,999 % fällig am 25.06.2037                          | 69             | 59                       | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                        | 3.979          | 1.514                    | 0,00                              | 5,989 % fällig am 20.06.2060                   | 17.063         | 23.405                   | 0,03                              | Towd Point Mortgage Funding PLC                       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036                        | 7.158          | 2.012                    | 0,00                              | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust |                |                          |                                   | 5,074 % fällig am 20.04.2051                          | £ 23.797       | 32.631                   | 0,03                              |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036                        | 9.925          | 2.798                    | 0,00                              | 4,443 % fällig am 25.10.2036                   | \$ 1.764       | 1.579                    | 0,00                              | 5,223 % fällig am 20.07.2053                          | 105.612        | 145.049                  | 0,15                              |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037                        | 1.093          | 550                      | 0,00                              | 4,457 % fällig am 25.07.2035                   | 161            | 85                       | 0,00                              | 5,474 % fällig am 20.04.2051                          | 2.107          | 2.892                    | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037                        | 1.078          | 397                      | 0,00                              | 4,584 % fällig am 25.11.2035                   | 45             | 29                       | 0,00                              | 5,637 % fällig am 20.02.2054                          | 28.574         | 39.271                   | 0,04                              |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037                        | 2.304          | 1.079                    | 0,00                              | 4,665 % fällig am 25.02.2036                   | 2.580          | 1.902                    | 0,00                              | 5,774 % fällig am 20.04.2051                          | 1.263          | 1.734                    | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.01.2046                        | 2.371          | 856                      | 0,00                              | 4,703 % fällig am 25.04.2036                   | 99             | 84                       | 0,00                              | 6,474 % fällig am 20.04.2051                          | 1.051          | 1.443                    | 0,00                              |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036                        | 1.218          | 796                      | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.09.2034                   | 249            | 229                      | 0,00                              | 6,698 % fällig am 20.07.2053                          | 4.300          | 5.942                    | 0,01                              |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036                        | 1.991          | 660                      | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.01.2037                   | 1.653          | 1.588                    | 0,00                              | 7,474 % fällig am 20.04.2051                          | 841            | 1.154                    | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036                        | 1.067          | 284                      | 0,00                              | 4,789 % fällig am 25.05.2036                   | 2.017          | 1.413                    | 0,00                              | 7,798 % fällig am 20.07.2053                          | 2.842          | 3.935                    | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036                        | 1.236          | 375                      | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.10.2035                   | 1.657          | 1.582                    | 0,00                              | 8,474 % fällig am 20.04.2051                          | 527            | 723                      | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037                        | 9.894          | 2.634                    | 0,00                              | 4,871 % fällig am 25.11.2037                   | 292            | 247                      | 0,00                              | 8,798 % fällig am 20.07.2053                          | 1.600          | 2.217                    | 0,00                              |
| 6,500 % fällig am 25.06.2037                        | 6.846          | 1.338                    | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.05.2037                   | 668            | 611                      | 0,00                              | Towd Point Mortgage Trust                             |                |                          |                                   |
| 6,609 % fällig am 25.02.2037                        | 11.476         | 2.536                    | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.05.2037                   | 1.240          | 1.093                    | 0,00                              | 2,750 % fällig am 25.06.2057                          | \$ 3.185       | 3.106                    | 0,00                              |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust |                |                          |                                   | 4,930 % fällig am 25.01.2035                   | 516            | 497                      | 0,00                              | 2,750 % fällig am 25.10.2057                          | 8.127          | 7.968                    | 0,01                              |
| 0,000 % fällig am 25.09.2036                        | 33             | 0                        | 0,00                              | 4,972 % fällig am 25.07.2035                   | 528            | 464                      | 0,00                              | 3,000 % fällig am 25.06.2058                          | 1.496          | 1.418                    | 0,00                              |
| 3,642 % fällig am 25.06.2035                        | 231            | 127                      | 0,00                              | 4,984 % fällig am 25.09.2034                   | 3.011          | 2.673                    | 0,00                              | 3,250 % fällig am 25.07.2056                          | 3.209          | 3.171                    | 0,00                              |
| 4,460 % fällig am 25.08.2035                        | 33             | 13                       | 0,00                              | 5,288 % fällig am 25.09.2034                   | 1              | 1                        | 0,00                              | 3,750 % fällig am 25.04.2055                          | 6.605          | 6.509                    | 0,01                              |
| 4,996 % fällig am 25.04.2037                        | 114            | 59                       | 0,00                              | 5,398 % fällig am 25.11.2037                   | 159            | 107                      | 0,00                              | 3,750 % fällig am 25.10.2056                          | 23.315         | 22.880                   | 0,02                              |
| 5,023 % fällig am 27.07.2037                        | 309            | 226                      | 0,00                              | 5,409 % fällig am 25.08.2035                   | 1.455          | 1.297                    | 0,00                              | 3,882 % fällig am 25.07.2057                          | 13.185         | 11.798                   | 0,01                              |
| 5,594 % fällig am 25.04.2037                        | 393            | 340                      | 0,00                              | 5,519 % fällig am 25.02.2035                   | 2.089          | 1.987                    | 0,00                              | 4,097 % fällig am 25.04.2056                          | 12.200         | 11.435                   | 0,01                              |
| 5,631 % fällig am 25.08.2036                        | 1.024          | 728                      | 0,00                              | 5,751 % fällig am 25.01.2035                   | 37             | 35                       | 0,00                              | Tower Bridge Funding PLC                              |                |                          |                                   |
| 5,871 % fällig am 25.09.2035                        | 2.191          | 1.403                    | 0,00                              | 5,910 % fällig am 25.08.2036                   | 2.630          | 1.633                    | 0,00                              | 4,959 % fällig am 20.12.2063                          | £ 1.445        | 1.981                    | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036                        | 223            | 191                      | 0,00                              | 5,969 % fällig am 25.12.2034                   | 7              | 7                        | 0,00                              | 5,029 % fällig am 20.12.2066                          | 17.541         | 24.069                   | 0,03                              |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036                        | 158            | 136                      | 0,00                              | 6,085 % fällig am 25.10.2035                   | 79             | 73                       | 0,00                              | 5,117 % fällig am 20.05.2066                          | 35.307         | 48.475                   | 0,05                              |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036                        | 640            | 511                      | 0,00                              | 6,210 % fällig am 25.10.2037                   | 2.472          | 2.226                    | 0,00                              | 5,337 % fällig am 20.11.2063                          | 1.500          | 2.057                    | 0,00                              |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036                        | 1.002          | 839                      | 0,00                              | Structured Asset Mortgage Investments Trust    |                |                          |                                   | 5,398 % fällig am 20.01.2066                          | 22.114         | 30.377                   | 0,03                              |
| RESIMAC Premier Trust                               |                |                          |                                   | 3,530 % fällig am 25.05.2047                   | 2.749          | 2.232                    | 0,00                              | Trinity Square PLC                                    |                |                          |                                   |
| 4,853 % fällig am 12.02.2056                        | AUD 52.200     | 34.251                   | 0,04                              | 4,040 % fällig am 27.12.2035                   | 8              | 8                        | 0,00                              | 5,217 % fällig am 15.07.2059                          | 48.344         | 66.407                   | 0,07                              |
| Resloc UK PLC                                       |                |                          |                                   | 4,135 % fällig am 19.10.2034                   | 248            | 216                      | 0,00                              | 5,617 % fällig am 15.07.2059                          | 3.000          | 4.109                    | 0,01                              |
| 4,556 % fällig am 15.12.2043                        | \$ 9.581       | 9.393                    | 0,01                              | 4,554 % fällig am 25.08.2036                   | 8.007          | 7.059                    | 0,01                              | Triton Trust                                          |                |                          |                                   |
| 4,578 % fällig am 15.12.2043                        | £ 1.771        | 2.327                    | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.10.2036                   | 3.437          | 3.064                    | 0,00                              | 4,503 % fällig am 12.03.2057                          | AUD 4.374      | 2.868                    | 0,00                              |
| RiverView HECM Trust                                |                |                          |                                   | 4,604 % fällig am 25.02.2036                   | 1.684          | 1.411                    | 0,00                              | 4,753 % fällig am 12.03.2057                          | 55.000         | 36.015                   | 0,04                              |
| 4,704 % fällig am 25.05.2047                        | \$ 1.160       | 1.020                    | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.01.2037                   | 2.637          | 2.360                    | 0,00                              | Twin Bridges PLC                                      |                |                          |                                   |
| RMAC PLC                                            |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.01.2037                   | 1.738          | 1.544                    | 0,00                              | 5,188 % fällig am 14.06.2055                          | £ 13.633       | 18.736                   | 0,02                              |
| 5,437 % fällig am 15.02.2047                        | £ 16.495       | 22.686                   | 0,02                              | 4,794 % fällig am 25.07.2046                   | 3.284          | 2.875                    | 0,00                              | 5,417 % fällig am 15.05.2056                          | 18.570         | 25.566                   | 0,03                              |
| 7,837 % fällig am 15.02.2047                        | 3.273          | 4.579                    | 0,01                              | 4,794 % fällig am 25.09.2047                   | 165            | 154                      | 0,00                              | 6,239 % fällig am 12.06.2055                          | 5.819          | 8.016                    | 0,01                              |
| RMAC Securities PLC                                 |                |                          |                                   | 4,834 % fällig am 25.02.2036                   | 289            | 234                      | 0,00                              | Uropa Securities PLC                                  |                |                          |                                   |
| 2,104 % fällig am 12.06.2044                        | € 1.378        | 1.592                    | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.05.2036                   | 2.280          | 1.591                    | 0,00                              | 2,493 % fällig am 10.10.2040                          | € 2.999        | 3.486                    | 0,01                              |
| 2,194 % fällig am 12.06.2044                        | 4.336          | 4.979                    | 0,01                              | 4,854 % fällig am 25.09.2047                   | 10.424         | 9.201                    | 0,01                              | 4,799 % fällig am 10.10.2040                          | £ 6.630        | 8.370                    | 0,01                              |
| 2,224 % fällig am 12.06.2044                        | 1.254          | 1.408                    | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.05.2036                   | 8.507          | 6.973                    | 0,01                              | Valley Funding PLC                                    |                |                          |                                   |
| 2,424 % fällig am 12.06.2044                        | 4.227          | 4.776                    | 0,01                              | 4,874 % fällig am 25.09.2047                   | 8.122          | 7.202                    | 0,01                              | 0,000 % fällig am 16.05.2066 (f)                      | 8.873          | 9.023                    | 0,01                              |
| 4,508 % fällig am 12.06.2044                        | £ 2.169        | 2.919                    | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.02.2036                   | 828            | 770                      | 0,00                              | 5,237 % fällig am 16.05.2066                          | 54.452         | 74.710                   | 0,08                              |
| 4,528 % fällig am 12.06.2044                        | 15.406         | 20.627                   | 0,02                              | 4,894 % fällig am 25.05.2045                   | 44             | 41                       | 0,00                              | 5,737 % fällig am 16.05.2066                          | 5.246          | 7.207                    | 0,01                              |
| 4,788 % fällig am 12.06.2044                        | 534            | 708                      | 0,00                              | 4,912 % fällig am 19.04.2035                   | 2              | 2                        | 0,00                              | 6,237 % fällig am 16.05.2066                          | 5.474          | 7.505                    | 0,01                              |
| 4,804 % fällig am 12.06.2044                        | \$ 211         | 206                      | 0,00                              | 4,932 % fällig am 19.07.2035                   | 19             | 19                       | 0,00                              | 7,237 % fällig am 16                                  |                |                          |                                   |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------|----------------|----------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|----------------|-----------------------------------|
| 8,237 % fällig am 16.05.2066                                | £ 1.825        | \$ 2.505       | 0,00                              | 4,784 % fällig am 25.02.2036                        | \$ 1.141       | \$ 1.018       | 0,00                              | Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC        |                |                |                                   |
| 9,737 % fällig am 16.05.2066                                | 1.004          | 1.381          | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.06.2037                        | 345            | 318            | 0,00                              | 0,000 % fällig am                                  |                |                |                                   |
| <b>Wachovia Mortgage Loan Trust LLC</b>                     |                |                |                                   | 4,884 % fällig am 25.05.2035                        | 2.574          | 2.168          | 0,00                              | 20.08.2031 (f)                                     | £ 1            | \$ 767         | 0,00                              |
| 1,855 % fällig am 25.08.2036                                | \$ 1.209       | 400            | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.12.2035                        | 2.256          | 1.991          | 0,00                              | 5,624 % fällig am 20.08.2031                       | 2.495          | 3.424          | 0,00                              |
| 4,883 % fällig am 25.01.2037                                | 1.923          | 686            | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.06.2035                        | 279            | 224            | 0,00                              | 6,124 % fällig am 20.08.2031                       | 2.697          | 3.699          | 0,00                              |
| 6,803 % fällig am 20.08.2035                                | 110            | 108            | 0,00                              | 5,159 % fällig am 25.04.2047                        | 3.597          | 3.112          | 0,00                              | 6,824 % fällig am 20.08.2031                       | 1.806          | 2.482          | 0,00                              |
| 7,482 % fällig am 20.10.2035                                | 119            | 117            | 0,00                              | 5,229 % fällig am 25.11.2046                        | 85             | 71             | 0,00                              | 8,474 % fällig am 20.08.2031                       | 1.925          | 2.664          | 0,00                              |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>        |                |                |                                   | 5,319 % fällig am 25.09.2046                        | 3.174          | 2.613          | 0,00                              | 10,974 % fällig am 20.08.2031                      | 3.449          | 4.847          | 0,01                              |
| 3,488 % fällig am 25.01.2037                                | 2.558          | 2.131          | 0,00                              | 5,339 % fällig am 25.04.2046                        | 3.592          | 3.207          | 0,00                              | 13,224 % fällig am 20.08.2031                      | 4.513          | 5.727          | 0,01                              |
| 3,496 % fällig am 25.01.2037                                | 679            | 581            | 0,00                              | 5,339 % fällig am 25.07.2046                        | 5.494          | 3.368          | 0,00                              | <b>Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC</b>    |                |                |                                   |
| 3,826 % fällig am 25.03.2037                                | 837            | 704            | 0,00                              | 5,359 % fällig am 25.08.2046                        | 4.202          | 2.406          | 0,00                              | 2,742 % fällig am 15.12.2032                       | € 1.016        | 1.195          | 0,00                              |
| 4,024 % fällig am 25.06.2037                                | 1.034          | 910            | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.07.2035                        | 823            | 774            | 0,00                              | <b>Driver Australia Ten Trust</b>                  |                |                |                                   |
| 4,036 % fällig am 25.06.2037                                | 1.274          | 1.121          | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                        | 77             | 72             | 0,00                              | 4,843 % fällig am 21.02.2033                       | AUD 31.527     | 20.693         | 0,02                              |
| 4,068 % fällig am 25.12.2046                                | 5.908          | 5.082          | 0,01                              | 5,649 % fällig am 25.04.2047                        | 14.504         | 12.562         | 0,01                              | <b>FACT S.A.</b>                                   |                |                |                                   |
| 4,142 % fällig am 25.12.2036                                | 633            | 562            | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.01.2036                        | 2.394          | 2.029          | 0,00                              | 2,547 % fällig am 22.09.2031                       | € 18.128       | 21.323         | 0,02                              |
| 4,152 % fällig am 25.02.2037                                | 7.187          | 6.704          | 0,01                              | 5,750 % fällig am 25.02.2036                        | 113            | 106            | 0,00                              | <b>Flexicommercial ABS Trust</b>                   |                |                |                                   |
| 4,160 % fällig am 25.09.2036                                | 106            | 89             | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.11.2035                        | 1.804          | 1.789          | 0,00                              | 4,876 % fällig am 14.06.2031                       | AUD 36.000     | 23.594         | 0,02                              |
| 4,179 % fällig am 25.11.2036                                | 3.803          | 3.389          | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.07.2036                        | 3.756          | 3.034          | 0,00                              | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>               |                |                |                                   |
| 4,182 % fällig am 27.02.2034                                | 5              | 5              | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.04.2037                        | 1.832          | 1.638          | 0,00                              | 2,747 % fällig am 20.12.2044                       | € 75.000       | 88.219         | 0,09                              |
| 4,257 % fällig am 25.02.2037                                | 1.479          | 1.332          | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.11.2035                        | 2.936          | 2.066          | 0,00                              | 3,086 % fällig am 22.09.2043                       | 57.149         | 67.522         | 0,07                              |
| 4,312 % fällig am 25.05.2037                                | 827            | 676            | 0,00                              | 6,500 % fällig am 25.07.2036                        | 2.949          | 2.240          | 0,00                              | 4,936 % fällig am 22.09.2043                       | 11.517         | 13.821         | 0,02                              |
| 4,351 % fällig am 25.12.2036                                | 5.529          | 5.075          | 0,01                              | 6,812 % fällig am 25.07.2036                        | 10.374         | 2.257          | 0,00                              | 5,636 % fällig am 22.09.2043                       | 2.439          | 2.941          | 0,00                              |
| 4,358 % fällig am 25.07.2037                                | 3.913          | 3.591          | 0,01                              | 6,949 % fällig am 25.07.2036                        | 1.886          | 1.40           | 0,00                              | <b>Hill FL BV</b>                                  |                |                |                                   |
| 4,376 % fällig am 25.02.2037                                | 3.209          | 2.971          | 0,00                              | 7,000 % fällig am 25.02.2036                        | 2.349          | 1.748          | 0,00                              | 2,611 % fällig am 18.05.2030                       | 341            | 400            | 0,00                              |
| 4,376 % fällig am 25.05.2037                                | 1.092          | 916            | 0,00                              | 7,000 % fällig am 25.05.2036                        | 2.525          | 2.226          | 0,00                              | 2,631 % fällig am 18.10.2032                       | 35.000         | 41.142         | 0,04                              |
| 4,385 % fällig am 25.04.2035                                | 871            | 847            | 0,00                              | <b>Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through</b>  |                |                |                                   | <b>Koromo Italy Compartment</b>                    |                |                |                                   |
| 4,408 % fällig am 25.06.2037                                | 688            | 619            | 0,00                              | <b>Certificates Trust</b>                           |                |                |                                   | 2,614 % fällig am 26.02.2032                       | 50.473         | 59.379         | 0,06                              |
| 4,434 % fällig am 25.09.2036                                | 3.467          | 2.964          | 0,00                              | 4,224 % fällig am 25.01.2035                        | 55             | 51             | 0,00                              | <b>Koromo UK PLC</b>                               |                |                |                                   |
| 4,449 % fällig am 25.02.2037                                | 1.175          | 1.050          | 0,00                              | <b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>           |                |                |                                   | 4,824 % fällig am 23.10.2034                       | £ 29.438       | 40.396         | 0,04                              |
| 4,475 % fällig am 25.12.2036                                | 503            | 448            | 0,00                              | 1,636 % fällig am                                   |                |                |                                   | <b>LT Rahoitus DAC</b>                             |                |                |                                   |
| 4,501 % fällig am 25.05.2046                                | 33             | 27             | 0,00                              | 25.06.2037 (a)                                      | 677            | 71             | 0,00                              | 2,451 % fällig am 18.07.2036                       | € 47.677       | 56.033         | 0,06                              |
| 4,755 % fällig am 25.10.2036                                | 3.441          | 3.165          | 0,00                              | 4,784 % fällig am 25.06.2037                        | 755            | 544            | 0,00                              | <b>Panorama Auto Trust</b>                         |                |                |                                   |
| 4,820 % fällig am 25.08.2036                                | 746            | 673            | 0,00                              | 4,864 % fällig am 25.06.2037                        | 636            | 556            | 0,00                              | 4,705 % fällig am 15.03.2033                       | AUD 46.868     | 30.657         | 0,03                              |
| 4,894 % fällig am 25.04.2045                                | 5.768          | 5.869          | 0,01                              | 6,250 % fällig am 25.07.2037                        | 2.449          | 2.143          | 0,00                              | <b>Pepper SPARKZ Trust</b>                         |                |                |                                   |
| 4,926 % fällig am 25.08.2046                                | 708            | 653            | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.11.2037                        | 1.023          | 920            | 0,00                              | 4,735 % fällig am 15.01.2033                       | 33.147         | 21.715         | 0,02                              |
| 4,967 % fällig am 25.07.2037                                | 3.156          | 2.869          | 0,00                              | <b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>        |                |                |                                   | <b>Plenti Auto ABS</b>                             |                |                |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.07.2045                                | 412            | 404            | 0,00                              | 3,874 % fällig am 15.06.2036                        | 2.600          | 2.372          | 0,00                              | 4,853 % fällig am 12.08.2033                       | 27.775         | 18.215         | 0,02                              |
| 5,054 % fällig am 25.01.2045                                | 559            | 556            | 0,00                              | <b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b> |                |                |                                   | <b>Pulse UK PLC</b>                                |                |                |                                   |
| 5,064 % fällig am 25.03.2035                                | 1.532          | 1.538          | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.06.2037                        | 586            | 532            | 0,00                              | 4,884 % fällig am 27.05.2036                       | £ 35.000       | 48.012         | 0,05                              |
| 5,072 % fällig am 25.08.2046                                | 382            | 347            | 0,00                              | 6,035 % fällig am 25.04.2037                        | 353            | 311            | 0,00                              | <b>Red &amp; Black Auto Italy SRL</b>              |                |                |                                   |
| 5,098 % fällig am 25.03.2037                                | 92             | 86             | 0,00                              | 6,140 % fällig am 25.04.2036                        | 1.325          | 1.314          | 0,00                              | 2,739 % fällig am 28.07.2036                       | € 46.672       | 54.986         | 0,06                              |
| 5,099 % fällig am 25.02.2047                                | 2.024          | 1.854          | 0,00                              | 6,332 % fällig am 25.03.2036                        | 837            | 823            | 0,00                              | <b>Red &amp; Black Auto Lease France</b>           |                |                |                                   |
| 5,099 % fällig am 25.03.2047                                | 392            | 343            | 0,00                              | 6,558 % fällig am 25.08.2036                        | 797            | 740            | 0,00                              | 2,536 % fällig am 27.06.2039                       | 55.000         | 64.640         | 0,07                              |
| 5,134 % fällig am 25.12.2045                                | 1.181          | 1.082          | 0,00                              | 6,644 % fällig am 25.10.2036                        | 76             | 71             | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,148 % fällig am 25.12.2035                                | 4.166          | 3.942          | 0,01                              | 6,655 % fällig am 25.10.2036                        | 1.538          | 1.432          | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,149 % fällig am 25.06.2047                                | 10.172         | 8.462          | 0,01                              | 6,678 % fällig am 25.11.2037                        | 183            | 169            | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,154 % fällig am 25.10.2045                                | 82             | 82             | 0,00                              | 6,726 % fällig am 25.10.2037                        | 70             | 61             | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,159 % fällig am 25.04.2047                                | 171            | 156            | 0,00                              | 6,741 % fällig am 25.04.2036                        | 946            | 958            | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,169 % fällig am 25.04.2047                                | 1.423          | 1.229          | 0,00                              | 6,799 % fällig am 25.09.2036                        | 907            | 874            | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,169 % fällig am 25.05.2047                                | 3.833          | 3.340          | 0,00                              | 6,928 % fällig am 25.12.2036                        | 570            | 555            | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,174 % fällig am 25.01.2045                                | 1.360          | 1.354          | 0,00                              | 7,020 % fällig am 25.08.2035                        | 510            | 501            | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,197 % fällig am 25.07.2047                                | 1.372          | 1.169          | 0,00                              | <b>Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust</b>    |                |                |                                   |                                                    |                |                |                                   |
| 5,209 % fällig am 25.07.2047                                | 10.180         | 8.545          | 0,01                              | 0,731 % fällig am                                   |                |                |                                   |                                                    |                |                |                                   |
| 5,234 % fällig am 25.06.2044                                | 95             | 94             | 0,00                              | 15.03.2047 (a)                                      | 6.006          | 0              | 0,00                              |                                                    |                |                |                                   |
| 5,279 % fällig am 25.10.2046                                | 5.294          | 4.557          | 0,01                              | <b>Winchester PLC</b>                               |                |                |                                   |                                                    |                |                |                                   |
| 5,319 % fällig am 25.09.2046                                | 2.624          | 2.389          | 0,00                              | 5,188 % fällig am 21.10.2056                        | £ 24.839       | 34.094         | 0,04                              | <b>Aames Mortgage Investment Trust</b>             |                |                |                                   |
| 5,323 % fällig am 25.01.2035                                | 1.380          | 1.299          | 0,00                              | <b>Worldwide Plaza Trust</b>                        |                |                |                                   | 5,214 % fällig am 25.10.2035                       | 4.342          | 4.307          | 0,01                              |
| 5,334 % fällig am 25.10.2045                                | 7.020          | 6.077          | 0,01                              | 3,715 % fällig am 10.11.2036                        | \$ 62.600      | 10.188         | 0,01                              | 6,459 % fällig am 25.01.2035                       | 475            | 463            | 0,00                              |
| 5,346 % fällig am 25.07.2034                                | 171            | 148            | 0,00                              | <b>WST Trust</b>                                    |                |                |                                   | <b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>              |                |                |                                   |
| 5,389 % fällig am 25.06.2046                                | 1.473          | 1.352          | 0,00                              | 4,655 % fällig am 18.08.2056                        | AUD 56.908     | 37.329         | 0,04                              | 4,654 % fällig am 25.02.2037                       | 710            | 706            | 0,00                              |
| 5,399 % fällig am 25.02.2046                                | 2.633          | 2.407          | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   | 4,694 % fällig am 25.09.2036                       | 2.251          | 2.242          | 0,00                              |
| 5,414 % fällig am 25.10.2045                                | 255            | 253            | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   | 4,704 % fällig am 25.09.2036                       | 12.825         | 12.238         | 0,01                              |
| 5,434 % fällig am 25.12.2045                                | 4.167          | 4.087          | 0,01                              |                                                     |                |                |                                   | 4,704 % fällig am 25.02.2037                       | 8.675          | 8.222          | 0,01                              |
| 5,447 % fällig am 25.08.2046                                | 1.981          | 1.701          | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   | 4,894 % fällig am 25.12.2035                       | 8.114          | 6.544          | 0,01                              |
| 5,454 % fällig am 25.08.2045                                | 3.159          | 3.140          | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   | 5,304 % fällig am 25.09.2035                       | 3.881          | 3.735          | 0,01                              |
| 5,649 % fällig am 25.01.2047                                | 4.224          | 3.889          | 0,01                              |                                                     |                |                |                                   | 5,454 % fällig am 25.07.2035                       | 2.496          | 2.402          | 0,00                              |
| 5,899 % fällig am 25.09.2046                                | 2.058          | 1.998          | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   | 5,514 % fällig am 25.10.2034                       | 1.436          | 1.379          | 0,00                              |
| 5,899 % fällig am 25.10.2046                                | 1.805          | 1.692          | 0,00                              | <b>Auto ABS Italian Stella Loans SRL</b>            |                |                |                                   | <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b> |                |                |                                   |
| 5,899 % fällig am 25.11.2046                                | 1.657          | 1.468          | 0,00                              | 2,659 % fällig am 29.12.2036                        | € 101.573      | 119.542        | 0,12                              | 4,614 % fällig am 25.07.2036                       | 491            | 120            | 0,00                              |
| <b>Warwick Finance Residential Mortgages PLC</b>            |                |                |                                   | <b>Auto ABS Spanish Loans</b>                       |                |                |                                   | 4,614 % fällig am 25.01.2037                       | 1.669          | 1.007          | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (f)                            | £ 2            | 11.655         | 0,01                              | 2,779 % fällig am 28.09.2038                        | 46.510         | 54.763         | 0,06                              | 4,674 % fällig am 25.08.2036                       | 8.265          | 1.867          | 0,00                              |
| 5,189 % fällig am 21.12.2049                                | 31.247         | 42.974         | 0,05                              | 3,896 % fällig am 28.02.2032                        | 1.950          | 2.280          | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.12.2036                       | 7.467          | 3.896          | 0,01                              |
| 5,708 % fällig am 21.03.2042                                | 1.598          | 2.210          | 0,00                              | 4,596 % fällig am 28.02.2032                        | 3.146          | 3.679          | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.01.2037                       | 1.029          | 621            | 0,00                              |
| 5,889 % fällig am 21.12.2049                                | 12.810         | 17.668         | 0,02                              | <b>Auto1 Car Funding SARL</b>                       |                |                |                                   | 4,694 % fällig am 25.12.2036                       | 23.484         | 12.359         | 0,01                              |
| 6,389 % fällig am 21.12.2049                                | 6.405          | 8.769          | 0,01                              | 2,592 % fällig am 15.12.2033                        | 11.578         | 13.616         | 0,01                              | 4,714 % fällig am 25.07.2036                       | 4.006          | 3.701          | 0,01                              |
| 6,889 % fällig am 21.12.2049                                | 3.660          | 4.988          | 0,01                              | <b>BBVA Consumer Auto</b>                           |                |                |                                   | 4,734 % fällig am 25.07.2036                       | 31.447         | 10.512         | 0,01                              |
| 7,389 % fällig am 21.12.2049                                | 3.660          | 4.947          | 0,01                              | 2,723 % fällig am 19.03.2038                        | 77.966         | 91.861         | 0,09                              | 4,744 % fällig am 25.08.2036                       | 3.267          | 3.172          | 0,00                              |
| <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates</b> |                |                |                                   | <b>Bumper NL BV</b>                                 |                |                |                                   | 4,754 % fällig am 25.12.2036                       | 1.507          | 479            | 0,00                              |
| <b>Trust</b>                                                |                |                |                                   | 2,539 % fällig am 21.03.2036                        | 67.500         | 79.321         | 0,08                              | 4,774 % fällig am 25.11.2036                       | 17.510         | 7.185          | 0,01                              |
| 3,928 % fällig am 25.09.2036                                | \$ 567         | 163            | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   | 4,774 % fällig am 25.01.2037                       | 3.371          | 2.034          | 0,00                              |
| 4,114 % fällig am 25.10.2036                                | 9.039          | 3.120          | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   |                                                    |                |                |                                   |
| 4,183 % fällig am 25.10.2036                                | 3.823          | 1.038          | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   |                                                    |                |                |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.02.2037                                | 579            | 447            | 0,00                              |                                                     |                |                |                                   |                                                    |                |                |                                   |



|                                                                             |          |          | % DES  |                                                      |          |          | % DES  |                                                   |          |          | % DES  |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------|----------|--------|------------------------------------------------------|----------|----------|--------|---------------------------------------------------|----------|----------|--------|
| BESCHREIBUNG                                                                | PARI     | MARKT-   | NETTO- | BESCHREIBUNG                                         | PARI     | MARKT-   | NETTO- | BESCHREIBUNG                                      | PARI     | MARKT-   | NETTO- |
|                                                                             | (000S)   | WERT     | VERMÖ- |                                                      | (000S)   | WERT     | VERMÖ- |                                                   | (000S)   | WERT     | VERMÖ- |
|                                                                             |          | (000S)   | GENS   |                                                      |          | (000S)   | GENS   |                                                   |          | (000S)   | GENS   |
| 4,794 % fällig am 25.02.2037                                                | \$ 5.524 | \$ 2.273 | 0,00   | 5,094 % fällig am 25.03.2035                         | \$ 2.457 | \$ 2.411 | 0,00   | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.               |          |          |        |
| 4,874 % fällig am 25.12.2036                                                | 5.370    | 1.706    | 0,00   | 5,134 % fällig am 25.06.2034                         | 2.255    | 2.264    | 0,00   | 4,162 % fällig am 25.10.2037                      | \$ 1.586 | \$ 1.531 | 0,00   |
| 4,874 % fällig am 25.01.2037                                                | 10.166   | 2.212    | 0,00   | 5,214 % fällig am 25.11.2033                         | 221      | 217      | 0,00   | 4,504 % fällig am 25.05.2037                      | 1.759    | 1.155    | 0,00   |
| 4,914 % fällig am 25.04.2036                                                | 5.299    | 4.901    | 0,01   | 5,334 % fällig am 25.02.2034                         | 108      | 108      | 0,00   | 4,609 % fällig am 25.05.2037                      | 230      | 227      | 0,00   |
| 4,914 % fällig am 25.07.2036                                                | 6.906    | 2.057    | 0,00   | Asset-Backed Pass-Through Certificates Series        |          |          |        | 4,634 % fällig am 25.12.2036                      | 137      | 92       | 0,00   |
| 4,934 % fällig am 25.01.2037                                                | 1.029    | 621      | 0,00   | 5,409 % fällig am 25.07.2035                         | 4.255    | 4.046    | 0,01   | 4,634 % fällig am 25.05.2037                      | 3.827    | 2.511    | 0,00   |
| 4,994 % fällig am 25.06.2037                                                | 1.099    | 1.046    | 0,00   | Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust |          |          |        | 4,694 % fällig am 25.03.2037                      | 6.419    | 5.787    | 0,01   |
| 5,034 % fällig am 25.02.2036                                                | 190      | 189      | 0,00   | 2,906 % fällig am 25.07.2036                         | 480      | 414      | 0,00   | 4,694 % fällig am 25.07.2045                      | 3.693    | 2.563    | 0,00   |
| 5,049 % fällig am 25.12.2035                                                | 3.893    | 3.692    | 0,01   | 3,125 % fällig am 25.03.2036                         | 1.392    | 1.231    | 0,00   | 4,704 % fällig am 25.05.2037                      | 23.042   | 21.905   | 0,02   |
| 5,094 % fällig am 25.11.2035                                                | 599      | 651      | 0,00   | 3,467 % fällig am 25.03.2036                         | 714      | 660      | 0,00   | 4,714 % fällig am 25.12.2036                      | 2.557    | 2.486    | 0,00   |
| 5,174 % fällig am 25.02.2037                                                | 5.417    | 2.229    | 0,00   | 3,809 % fällig am 25.12.2036                         | 1.433    | 1.386    | 0,00   | 4,714 % fällig am 25.01.2037                      | 8.020    | 7.499    | 0,01   |
| 5,214 % fällig am 25.04.2034                                                | 758      | 718      | 0,00   | 3,929 % fällig am 25.12.2036                         | 3.479    | 3.221    | 0,00   | 4,724 % fällig am 25.09.2036                      | 4.497    | 4.364    | 0,01   |
| 5,334 % fällig am 25.12.2034                                                | 2.869    | 2.594    | 0,00   | 4,779 % fällig am 25.11.2036                         | 4.034    | 3.887    | 0,01   | 4,734 % fällig am 25.12.2036                      | 872      | 315      | 0,00   |
| 5,334 % fällig am 25.08.2035                                                | 2.571    | 2.538    | 0,00   | 5,244 % fällig am 25.06.2034                         | 670      | 682      | 0,00   | 4,754 % fällig am 25.09.2036                      | 1.850    | 1.488    | 0,00   |
| 5,379 % fällig am 25.05.2035                                                | 3.000    | 2.759    | 0,00   | 5,334 % fällig am 25.11.2035                         | 3.597    | 3.476    | 0,00   | 4,754 % fällig am 25.12.2036                      | 16.439   | 9.010    | 0,01   |
| 5,409 % fällig am 25.11.2033                                                | 546      | 549      | 0,00   | 5,409 % fällig am 25.11.2033                         | 903      | 917      | 0,00   | 4,784 % fällig am 25.03.2037                      | 1.740    | 1.505    | 0,00   |
| 5,454 % fällig am 25.04.2035                                                | 1.285    | 1.261    | 0,00   | 5,409 % fällig am 25.10.2034                         | 918      | 920      | 0,00   | 4,794 % fällig am 25.01.2037                      | 12.492   | 9.138    | 0,01   |
| Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates      |          |          |        | 5,409 % fällig am 25.06.2035                         | 1.791    | 1.572    | 0,00   | 4,854 % fällig am 25.12.2036                      | 2.823    | 2.795    | 0,00   |
| 4,774 % fällig am 25.01.2037                                                | 1.060    | 795      | 0,00   | 5,454 % fällig am 25.07.2035                         | 1.922    | 1.869    | 0,00   | 4,914 % fällig am 25.08.2036                      | 3.018    | 2.806    | 0,00   |
| 5,079 % fällig am 25.12.2035                                                | 3.458    | 3.252    | 0,00   | 6,279 % fällig am 25.05.2035                         | 2.020    | 1.908    | 0,00   | 4,934 % fällig am 25.08.2036                      | 335      | 333      | 0,00   |
| 5,139 % fällig am 25.10.2035                                                | 1.830    | 1.748    | 0,00   | Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust        |          |          |        | 5,034 % fällig am 25.12.2035                      | 1.403    | 1.355    | 0,00   |
| 5,154 % fällig am 25.06.2035                                                | 3.190    | 3.059    | 0,00   | 5,311 % fällig am 28.04.2036                         | 813      | 813      | 0,00   | 5,064 % fällig am 25.02.2035                      | 1.552    | 1.461    | 0,00   |
| 5,154 % fällig am 25.08.2035                                                | 286      | 281      | 0,00   | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust           |          |          |        | 5,109 % fällig am 25.10.2035                      | 1.108    | 1.091    | 0,00   |
| 5,184 % fällig am 25.03.2035                                                | 6.447    | 5.647    | 0,01   | 4,694 % fällig am 25.02.2037                         | 1.628    | 1.586    | 0,00   | 5,169 % fällig am 25.09.2035                      | 784      | 781      | 0,00   |
| 6,159 % fällig am 25.10.2034                                                | 1.376    | 1.487    | 0,00   | 4,714 % fällig am 25.11.2036                         | 332      | 329      | 0,00   | 6,114 % fällig am 25.07.2035                      | 2.040    | 1.762    | 0,00   |
| Ameriquest Mortgage Securities Trust                                        |          |          |        | 4,714 % fällig am 25.03.2037                         | 1.732    | 1.621    | 0,00   | 7,275 % fällig am 25.10.2036                      | 889      | 517      | 0,00   |
| 4,534 % fällig am 25.10.2036                                                | 20.666   | 6.077    | 0,01   | 4,784 % fällig am 25.06.2047                         | 4.041    | 3.769    | 0,01   | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc. |          |          |        |
| 4,609 % fällig am 25.10.2036                                                | 11.061   | 6.112    | 0,01   | 4,884 % fällig am 25.01.2047                         | 1.584    | 1.556    | 0,00   | 3,387 % fällig am 25.04.2036                      | 2.653    | 2.452    | 0,00   |
| 4,989 % fällig am 25.04.2036                                                | 4.448    | 4.360    | 0,01   | 4,894 % fällig am 25.02.2037                         | 1.302    | 1.255    | 0,00   | 3,685 % fällig am 25.03.2035                      | 7.700    | 6.733    | 0,01   |
| 5,094 % fällig am 25.03.2036                                                | 5.671    | 5.299    | 0,01   | 4,934 % fällig am 25.08.2036                         | 3.082    | 2.866    | 0,00   | 3,685 % fällig am 25.04.2035                      | 562      | 553      | 0,00   |
| Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |          |          |        | 4,934 % fällig am 25.04.2037                         | 39       | 39       | 0,00   | 4,199 % fällig am 25.01.2035                      | 2.085    | 1.484    | 0,00   |
| 3,031 % fällig am 25.06.2033                                                | 869      | 779      | 0,00   | 4,944 % fällig am 25.12.2036                         | 4.057    | 4.027    | 0,01   | 4,209 % fällig am 25.10.2035                      | 0        | 0        | 0,00   |
| 4,391 % fällig am 25.11.2034                                                | 2.264    | 2.222    | 0,00   | 4,954 % fällig am 25.09.2036                         | 1.235    | 1.155    | 0,00   | 4,220 % fällig am 25.11.2034                      | 5.760    | 5.699    | 0,01   |
| 4,500 % fällig am 25.06.2034                                                | 1.380    | 1.316    | 0,00   | 4,974 % fällig am 25.11.2035                         | 1.577    | 1.575    | 0,00   | 4,267 % fällig am 25.01.2037                      | 4.552    | 4.495    | 0,01   |
| 4,987 % fällig am 25.11.2033                                                | 233      | 235      | 0,00   | 5,274 % fällig am 25.08.2036                         | 1.300    | 1.292    | 0,00   | 4,276 % fällig am 25.10.2046                      | 6.037    | 6.036    | 0,01   |
| 5,109 % fällig am 25.01.2036                                                | 2.725    | 2.714    | 0,00   | 5,409 % fällig am 25.11.2034                         | 281      | 282      | 0,00   | 4,406 % fällig am 25.01.2037                      | 13.000   | 12.156   | 0,01   |
| 5,184 % fällig am 25.01.2036                                                | 2.912    | 2.868    | 0,00   | 5,439 % fällig am 25.06.2035                         | 923      | 903      | 0,00   | 4,419 % fällig am 25.07.2036                      | 3.910    | 3.727    | 0,01   |
| 5,304 % fällig am 25.11.2035                                                | 4.638    | 4.371    | 0,01   | 5,454 % fällig am 25.10.2035                         | 1.075    | 1.073    | 0,00   | 4,574 % fällig am 25.07.2037                      | 2.934    | 2.738    | 0,00   |
| 5,364 % fällig am 25.05.2035                                                | 71       | 71       | 0,00   | 5,456 % fällig am 25.08.2034                         | 241      | 245      | 0,00   | 4,574 % fällig am 25.08.2037                      | 2.027    | 1.841    | 0,00   |
| 5,394 % fällig am 25.10.2035                                                | 4.265    | 4.088    | 0,01   | 5,484 % fällig am 25.08.2037                         | 9.276    | 8.294    | 0,01   | 4,604 % fällig am 25.06.2047                      | 12.273   | 11.862   | 0,01   |
| 5,409 % fällig am 25.05.2035                                                | 2.000    | 1.941    | 0,00   | 5,514 % fällig am 25.12.2035                         | 2.335    | 2.237    | 0,00   | 4,614 % fällig am 25.06.2047                      | 356      | 338      | 0,00   |
| 5,409 % fällig am 25.07.2035                                                | 4.385    | 4.248    | 0,01   | 5,620 % fällig am 25.01.2035                         | 1.715    | 1.732    | 0,00   | 4,624 % fällig am 25.11.2037                      | 7.458    | 7.096    | 0,01   |
| 5,409 % fällig am 25.09.2035                                                | 4.000    | 3.525    | 0,01   | 5,745 % fällig am 25.09.2034                         | 961      | 978      | 0,00   | 4,634 % fällig am 25.06.2047                      | 8.790    | 7.771    | 0,01   |
| 5,454 % fällig am 25.09.2034                                                | 80       | 81       | 0,00   | 5,789 % fällig am 25.12.2034                         | 1.757    | 1.753    | 0,00   | 4,654 % fällig am 25.08.2037                      | 14.619   | 13.408   | 0,01   |
| 5,454 % fällig am 25.01.2035                                                | 1.430    | 1.396    | 0,00   | 6,084 % fällig am 25.02.2034                         | 149      | 165      | 0,00   | 4,664 % fällig am 25.07.2037                      | 15.720   | 13.890   | 0,02   |
| 5,484 % fällig am 25.05.2035                                                | 2.510    | 2.307    | 0,00   | Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust         |          |          |        | 4,664 % fällig am 25.10.2047                      | 1.358    | 1.349    | 0,00   |
| 5,529 % fällig am 25.09.2034                                                | 3.520    | 3.301    | 0,00   | 6,434 % fällig am 25.03.2037                         | 2.151    | 2.061    | 0,00   | 4,684 % fällig am 25.06.2047                      | 8.674    | 8.385    | 0,01   |
| 5,994 % fällig am 25.01.2035                                                | 1.132    | 1.074    | 0,00   | BNC Mortgage Loan Trust                              |          |          |        | 4,694 % fällig am 25.12.2036                      | 5.943    | 5.451    | 0,01   |
| 6,084 % fällig am 25.11.2034                                                | 1.246    | 1.146    | 0,00   | 4,204 % fällig am 25.10.2036                         | 5.062    | 3.555    | 0,00   | 4,694 % fällig am 25.04.2046                      | 697      | 661      | 0,00   |
| 6,159 % fällig am 25.08.2035                                                | 2.000    | 1.852    | 0,00   | 4,594 % fällig am 25.03.2037                         | 6.410    | 6.264    | 0,01   | 4,694 % fällig am 25.06.2047                      | 12.582   | 9.949    | 0,01   |
| 6,309 % fällig am 25.07.2034                                                | 1.221    | 1.206    | 0,00   | 4,744 % fällig am 25.05.2037                         | 4.929    | 4.627    | 0,01   | 4,714 % fällig am 25.06.2035                      | 11.204   | 10.196   | 0,01   |
| 7,194 % fällig am 25.05.2034                                                | 1.323    | 1.220    | 0,00   | 4,754 % fällig am 25.11.2036                         | 624      | 611      | 0,00   | 4,714 % fällig am 25.02.2037                      | 311      | 294      | 0,00   |
| Argent Mortgage Loan Trust                                                  |          |          |        | Carrington Mortgage Loan Trust                       |          |          |        | 4,714 % fällig am 25.03.2037                      | 1.849    | 1.690    | 0,00   |
| 4,914 % fällig am 25.05.2035                                                | 6.717    | 6.020    | 0,01   | 4,584 % fällig am 25.04.2036                         | 1.120    | 1.101    | 0,00   | 4,714 % fällig am 25.05.2037                      | 4.477    | 4.263    | 0,01   |
| Argent Securities Trust                                                     |          |          |        | 4,594 % fällig am 25.10.2036                         | 6.335    | 6.173    | 0,01   | 4,714 % fällig am 25.06.2037                      | 10.271   | 9.799    | 0,01   |
| 4,544 % fällig am 25.09.2036                                                | 10.675   | 3.431    | 0,00   | 4,694 % fällig am 25.02.2037                         | 11.165   | 10.810   | 0,01   | 4,714 % fällig am 25.04.2047                      | 1.396    | 1.356    | 0,00   |
| 4,614 % fällig am 25.07.2036                                                | 716      | 193      | 0,00   | 4,734 % fällig am 25.08.2036                         | 5.807    | 5.645    | 0,01   | 4,714 % fällig am 25.06.2047                      | 2.129    | 1.956    | 0,00   |
| 4,654 % fällig am 25.05.2036                                                | 3.838    | 924      | 0,00   | 5,034 % fällig am 25.01.2036                         | 687      | 671      | 0,00   | 4,794 % fällig am 25.11.2047                      | 271      | 346      | 0,00   |
| 4,674 % fällig am 25.09.2036                                                | 10.198   | 3.278    | 0,00   | 5,184 % fällig am 25.10.2035                         | 5.372    | 5.240    | 0,01   | 4,798 % fällig am 25.05.2036                      | 18.985   | 18.764   | 0,02   |
| 4,734 % fällig am 25.06.2036                                                | 13.846   | 9.126    | 0,01   | 5,199 % fällig am 25.12.2035                         | 2.922    | 2.380    | 0,00   | 4,854 % fällig am 25.05.2047                      | 5.455    | 4.820    | 0,01   |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                | 28.844   | 25.920   | 0,03   | 5,229 % fällig am 25.09.2035                         | 1.522    | 1.502    | 0,00   | 4,869 % fällig am 25.01.2045                      | 2.259    | 2.136    | 0,00   |
| 4,754 % fällig am 25.05.2036                                                | 11.001   | 2.649    | 0,00   | 5,424 % fällig am 25.06.2035                         | 3.785    | 3.792    | 0,01   | 4,874 % fällig am 25.05.2037                      | 4.157    | 4.001    | 0,01   |
| 4,784 % fällig am 25.04.2036                                                | 1.432    | 783      | 0,00   | 5,484 % fällig am 25.05.2035                         | 2.808    | 2.724    | 0,00   | 4,874 %                                           |          |          |        |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,139 % fällig am 25.09.2035                         | \$ 1.238       | \$ 1.213                 | 0,00                              | FBR Securitization Trust                      |                |                          |                                   | 6,483 % fällig am 25.03.2037                 | \$ 5.060       | \$ 1.363                 | 0,00                              |
| 5,154 % fällig am 25.07.2034                         | 162            | 169                      | 0,00                              | 5,169 % fällig am 25.11.2035                  | \$ 11.731      | \$ 11.113                | 0,01                              | 6,500 % fällig am 25.10.2037                 | 1.090          | 614                      | 0,00                              |
| 5,154 % fällig am 25.08.2035                         | 1.794          | 1.646                    | 0,00                              | Fieldstone Mortgage Investment Trust          |                |                          |                                   | 6,599 % fällig am 25.03.2037                 | 2.022          | 442                      | 0,00                              |
| 5,171 % fällig am 25.03.2035                         | 2.434          | 2.422                    | 0,00                              | 4,679 % fällig am 25.11.2036                  | 3.023          | 1.887                    | 0,00                              | GSAMP Trust                                  |                |                          |                                   |
| 5,174 % fällig am 25.08.2047                         | 10.769         | 10.528                   | 0,01                              | 4,719 % fällig am 25.11.2036                  | 5.117          | 4.712                    | 0,01                              | 4,534 % fällig am 25.12.2046                 | 277            | 137                      | 0,00                              |
| 5,184 % fällig am 25.03.2034                         | 2.329          | 2.372                    | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.05.2036                  | 8.116          | 6.050                    | 0,01                              | 4,554 % fällig am 25.12.2036                 | 4.514          | 2.238                    | 0,00                              |
| 5,274 % fällig am 25.10.2047                         | 801            | 785                      | 0,00                              | 4,919 % fällig am 25.11.2036                  | 2.416          | 1.508                    | 0,00                              | 4,594 % fällig am 25.08.2036                 | 1.967          | 1.599                    | 0,00                              |
| 5,289 % fällig am 25.08.2034                         | 24             | 24                       | 0,00                              | 5,079 % fällig am 25.02.2036                  | 10.786         | 9.443                    | 0,01                              | 4,594 % fällig am 25.01.2037                 | 14.060         | 8.476                    | 0,01                              |
| 5,334 % fällig am 25.02.2036                         | 3.002          | 2.946                    | 0,00                              | 6,459 % fällig am 25.02.2035                  | 266            | 262                      | 0,00                              | 4,604 % fällig am 25.12.2036                 | 6.609          | 3.277                    | 0,00                              |
| 5,334 % fällig am 25.05.2036                         | 108            | 106                      | 0,00                              | Finance America Mortgage Loan Trust           |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.12.2046                 | 18.044         | 8.918                    | 0,01                              |
| 5,334 % fällig am 25.03.2047                         | 1.351          | 1.044                    | 0,00                              | 5,379 % fällig am 25.11.2034                  | 370            | 343                      | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.09.2036                 | 16.785         | 5.796                    | 0,01                              |
| 5,348 % fällig am 25.02.2036                         | 4.000          | 3.453                    | 0,00                              | 5,454 % fällig am 25.11.2034                  | 266            | 237                      | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.12.2046                 | 4.777          | 2.537                    | 0,00                              |
| 5,409 % fällig am 25.12.2035                         | 110            | 110                      | 0,00                              | First NLC Trust                               |                |                          |                                   | 4,704 % fällig am 25.03.2047                 | 5.528          | 4.227                    | 0,01                              |
| 5,409 % fällig am 25.01.2036                         | 4.587          | 4.518                    | 0,01                              | 4,504 % fällig am 25.08.2037                  | 5.607          | 2.802                    | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.06.2036                 | 1.059          | 1.040                    | 0,00                              |
| 5,424 % fällig am 25.02.2036                         | 2.600          | 2.346                    | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.08.2037                  | 169            | 84                       | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.11.2036                 | 4.465          | 2.073                    | 0,00                              |
| 5,499 % fällig am 25.07.2035                         | 99             | 99                       | 0,00                              | 4,614 % fällig am 25.08.2037                  | 3.041          | 1.520                    | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.03.2047                 | 6.123          | 5.585                    | 0,01                              |
| 5,499 % fällig am 25.10.2035                         | 7.437          | 7.254                    | 0,01                              | 4,714 % fällig am 25.08.2037                  | 42             | 21                       | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.06.2036                 | 5.526          | 3.116                    | 0,00                              |
| 5,505 % fällig am 25.07.2035                         | 2.050          | 2.023                    | 0,00                              | 5,169 % fällig am 25.02.2036                  | 3.497          | 3.132                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.12.2036                 | 875            | 868                      | 0,00                              |
| 5,514 % fällig am 25.05.2036                         | 11.586         | 9.102                    | 0,01                              | Fremont Home Loan Trust                       |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.12.2046                 | 420            | 208                      | 0,00                              |
| 5,529 % fällig am 25.04.2036                         | 6.800          | 6.620                    | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.01.2037                  | 19.404         | 10.048                   | 0,01                              | 4,754 % fällig am 25.04.2036                 | 4.309          | 2.868                    | 0,00                              |
| 5,555 % fällig am 25.07.2035                         | 3.535          | 3.309                    | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.08.2036                  | 6.420          | 2.004                    | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.01.2037                 | 3.049          | 2.988                    | 0,00                              |
| 5,559 % fällig am 25.11.2035                         | 1.246          | 1.234                    | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.11.2036                  | 4.927          | 1.727                    | 0,00                              | 4,804 % fällig am 25.03.2047                 | 3.127          | 2.391                    | 0,00                              |
| 5,574 % fällig am 25.01.2036                         | 2.700          | 2.670                    | 0,00                              | 4,704 % fällig am 25.10.2036                  | 9.688          | 8.813                    | 0,01                              | 4,809 % fällig am 25.10.2046                 | 4.100          | 3.454                    | 0,00                              |
| 5,633 % fällig am 25.06.2035                         | 3.821          | 3.400                    | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.02.2037                  | 11.171         | 8.205                    | 0,01                              | 4,834 % fällig am 25.11.2036                 | 1.090          | 508                      | 0,00                              |
| 5,634 % fällig am 25.11.2035                         | 4.967          | 4.688                    | 0,01                              | 4,734 % fällig am 25.10.2036                  | 11.871         | 4.747                    | 0,01                              | 4,894 % fällig am 25.12.2046                 | 619            | 306                      | 0,00                              |
| 5,805 % fällig am 25.04.2036                         | 342            | 319                      | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.05.2036                  | 7.151          | 4.570                    | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.06.2036                 | 1.862          | 1.026                    | 0,00                              |
| 5,934 % fällig am 25.10.2034                         | 110            | 110                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.02.2036                  | 2.403          | 2.331                    | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.03.2046                 | 78             | 77                       | 0,00                              |
| 5,934 % fällig am 25.02.2035                         | 2.817          | 2.812                    | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.11.2036                  | 10.948         | 3.838                    | 0,01                              | 4,954 % fällig am 25.02.2046                 | 605            | 565                      | 0,00                              |
| 5,934 % fällig am 25.10.2047                         | 5.000          | 4.022                    | 0,01                              | 4,974 % fällig am 25.02.2036                  | 300            | 272                      | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.02.2036                 | 386            | 374                      | 0,00                              |
| 6,084 % fällig am 25.12.2034                         | 783            | 777                      | 0,00                              | 5,049 % fällig am 25.11.2035                  | 5.445          | 5.009                    | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.01.2047                 | 2.692          | 1.380                    | 0,00                              |
| 6,084 % fällig am 25.06.2035                         | 1.248          | 1.238                    | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.01.2036                  | 861            | 832                      | 0,00                              | 5,049 % fällig am 25.01.2036                 | 2.025          | 1.919                    | 0,00                              |
| 6,234 % fällig am 25.02.2035                         | 5.088          | 4.584                    | 0,01                              | 5,109 % fällig am 25.01.2036                  | 6.546          | 5.441                    | 0,01                              | 5,079 % fällig am 25.11.2035                 | 3.555          | 3.450                    | 0,00                              |
| 6,309 % fällig am 25.07.2035                         | 2.539          | 2.504                    | 0,00                              | 5,184 % fällig am 25.06.2035                  | 183            | 186                      | 0,00                              | 5,319 % fällig am 25.07.2045                 | 5.059          | 4.689                    | 0,01                              |
| 6,384 % fällig am 25.08.2035                         | 3.890          | 3.679                    | 0,01                              | 5,214 % fällig am 25.07.2035                  | 1.484          | 1.422                    | 0,00                              | 5,334 % fällig am 25.11.2035                 | 3.173          | 3.098                    | 0,00                              |
| 6,534 % fällig am 25.08.2035                         | 461            | 371                      | 0,00                              | 5,304 % fällig am 25.05.2034                  | 786            | 768                      | 0,00                              | 5,409 % fällig am 25.03.2035                 | 988            | 944                      | 0,00                              |
| 6,834 % fällig am 25.10.2034                         | 534            | 525                      | 0,00                              | 5,364 % fällig am 25.07.2035                  | 2.103          | 1.766                    | 0,00                              | 5,409 % fällig am 25.04.2035                 | 1.562          | 1.476                    | 0,00                              |
| Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust         |                |                          |                                   | 5,394 % fällig am 25.04.2035                  | 1.943          | 1.675                    | 0,00                              | 7,809 % fällig am 25.02.2047                 | 1.500          | 1.479                    | 0,00                              |
| 4,626 % fällig am 15.05.2036                         | 471            | 453                      | 0,00                              | 5,454 % fällig am 25.01.2035                  | 2.590          | 2.359                    | 0,00                              | Home Equity Asset Trust                      |                |                          |                                   |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. |                |                          |                                   | 5,484 % fällig am 25.11.2034                  | 1.303          | 1.228                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.11.2036                 | 693            | 681                      | 0,00                              |
| 5,784 % fällig am 25.05.2044                         | 15             | 16                       | 0,00                              | 5,499 % fällig am 25.06.2035                  | 2.617          | 2.579                    | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.10.2036                 | 3.313          | 2.095                    | 0,00                              |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC    |                |                          |                                   | 6,189 % fällig am 25.05.2034                  | 23             | 33                       | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.07.2036                 | 3.250          | 3.082                    | 0,00                              |
| 2,821 % fällig am 25.04.2037                         | 11.858         | 5.514                    | 0,01                              | GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.04.2036                 | 2.529          | 2.419                    | 0,00                              |
| 3,084 % fällig am 25.05.2036                         | 2.988          | 2.019                    | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.12.2035                  | 1.536          | 1.491                    | 0,00                              | 5,109 % fällig am 25.02.2036                 | 2.245          | 2.203                    | 0,00                              |
| 3,100 % fällig am 25.08.2035                         | 1.336          | 1.268                    | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.10.2035                  | 665            | 655                      | 0,00                              | 5,139 % fällig am 25.01.2036                 | 2.039          | 1.951                    | 0,00                              |
| 3,205 % fällig am 25.04.2037                         | 2.952          | 1.689                    | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.12.2035                  | 1.737          | 1.374                    | 0,00                              | 5,274 % fällig am 25.01.2035                 | 591            | 590                      | 0,00                              |
| 3,277 % fällig am 25.03.2037                         | 866            | 305                      | 0,00                              | GE-WMC Mortgage Securities Trust              |                |                          |                                   | 5,289 % fällig am 25.08.2034                 | 62             | 61                       | 0,00                              |
| 3,290 % fällig am 25.03.2034                         | 233            | 256                      | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.08.2036                  | 5.408          | 5.008                    | 0,01                              | 5,379 % fällig am 25.11.2035                 | 438            | 429                      | 0,00                              |
| 3,364 % fällig am 25.07.2036                         | 2.759          | 2.622                    | 0,00                              | GSAA Home Equity Trust                        |                |                          |                                   | 5,379 % fällig am 25.12.2035                 | 620            | 599                      | 0,00                              |
| 3,390 % fällig am 25.04.2037                         | 5.575          | 3.706                    | 0,01                              | 4,534 % fällig am 25.09.2036                  | 3.870          | 863                      | 0,00                              | 5,679 % fällig am 25.05.2035                 | 1.048          | 1.021                    | 0,00                              |
| 3,518 % fällig am 25.02.2037                         | 2.029          | 1.192                    | 0,00                              | 4,534 % fällig am 25.12.2046                  | 2.146          | 1.039                    | 0,00                              | 5,934 % fällig am 25.03.2035                 | 867            | 805                      | 0,00                              |
| 4,353 % fällig am 25.12.2037                         | 267            | 391                      | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.05.2036                  | 6.521          | 1.364                    | 0,00                              | 6,084 % fällig am 25.12.2034                 | 575            | 576                      | 0,00                              |
| 4,654 % fällig am 25.11.2036                         | 9.131          | 4.148                    | 0,01                              | 4,554 % fällig am 25.11.2036                  | 4.869          | 1.183                    | 0,00                              | 6,134 % fällig am 25.11.2034                 | 443            | 439                      | 0,00                              |
| 4,714 % fällig am 25.06.2036                         | 1.609          | 1.087                    | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.03.2036                  | 1.366          | 438                      | 0,00                              | 6,184 % fällig am 25.11.2034                 | 221            | 219                      | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.10.2036                         | 2.443          | 2.067                    | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.12.2046                  | 10.243         | 2.961                    | 0,00                              | Home Equity Loan Trust                       |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.11.2036                         | 2.037          | 926                      | 0,00                              | 4,594 % fällig am 25.02.2037                  | 5.674          | 1.594                    | 0,00                              | 4,664 % fällig am 25.04.2037                 | 278            | 269                      | 0,00                              |
| 4,894 % fällig am 25.11.2036                         | 5.146          | 2.338                    | 0,00                              | 4,614 % fällig am 25.07.2036                  | 1.323          | 254                      | 0,00                              | Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.10.2036                         | 8.733          | 5.997                    | 0,01                              | 4,634 % fällig am 25.03.2037                  | 8.606          | 2.355                    | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.04.2037                 | 5.047          | 3.570                    | 0,00                              |
| 7,809 % fällig am 25.01.2033                         | 189            | 187                      | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.06.2036                  | 4.129          | 775                      | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.11.2036                 | 4.311          | 4.051                    | 0,01                              |
| CSAB Mortgage-Backed Trust                           |                |                          |                                   | 4,774 % fällig am 25.09.2036                  | 5.267          | 1.177                    | 0,00                              | 4,594 % fällig am 25.11.2036                 | 2.926          | 2.651                    | 0,00                              |
| 4,894 % fällig am 25.11.2036                         | 7.606          | 917                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.03.2047                  | 18.412         | 4.924                    | 0,01                              | 4,604 % fällig am 25.04.2037                 | 8.938          | 6.324                    | 0,01                              |
| 5,858 % fällig am 25.05.2037                         | 5.039          | 1.113                    | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.03.2036                  | 10.858         | 3.498                    | 0,00                              | 4,624 % fällig am 25.04.2037                 | 8.572          | 5.804                    | 0,01                              |
| 5,898 % fällig am 25.05.2037                         | 757            | 168                      | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.12.2036                  | 12.514         | 3.273                    | 0,00                              | 4,624 % fällig am 25.07.2037                 | 7.401          | 2.931                    | 0,00                              |
| 6,580 % fällig am 25.09.2036                         | 1.961          | 568                      | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.03.2036                  | 7.768          | 2.615                    | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.07.2037                 | 8.401          | 4.613                    | 0,01                              |
| Ellington Loan Acquisition Trust                     |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.11.2036                  | 7.020          | 2.228                    | 0,00                              | 4,644 % fällig am 25.04.2037                 | 1.086          | 769                      | 0,00                              |
| 5,484 % fällig am 25.05.2037                         | 7.956          | 7.813                    | 0,01                              | 4,934 % fällig am 25.12.2035                  | 3.653          | 2.077                    | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.11.2036                 | 602            | 490                      | 0,00                              |
| 5,534 % fällig am 25.05.2037                         | 6.565          | 6.432                    | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.03.2036                  | 3.007          | 1.461                    | 0,00                              | 4,674 % fällig am 25.04.2037                 | 9.326          | 6.315                    | 0,01                              |
| 5,934 % fällig am 25.05.2037                         | 956            | 945                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.03.2037                  | 170            | 67                       | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.06.2036                 | 1.668          | 1.621                    | 0,00                              |
| Encore Credit Receivables Trust                      |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.05.2047                  | 97             | 59                       | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.08.2036                 | 4.853          | 4.519                    | 0,01                              |
| 5,169 % fällig am 25.07.2035                         | 1.393          | 1.298                    | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.10.2035                  | 1.840          | 1.710                    | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.03.2036                 | 4.686          | 4.419                    | 0,01                              |
| 5,334 % fällig am 25.01.2036                         | 658            | 644                      | 0,00                              | 5,169 % fällig am 25.06.2035                  | 1.745          | 1.715                    | 0,00                              | 5,499 % fällig am 25.08.2035                 | 1.800          | 1.774                    | 0,00                              |
| 5,364 % fällig am 25.11.2035                         | 4.103          | 3.917                    | 0,01                              | 5,194 % fällig am 25.01.2036                  | 465            | 37                       | 0,00                              | 5,679 % fällig am 25.03.2035                 | 1.794          | 1.774                    | 0,00                              |
| 5,409 % fällig am 25.01.2036                         | 3.512          | 3.266                    | 0,00                              | 5,379 % fällig am 25.08.2035                  | 1.404          | 1.362                    | 0,00                              | HSI Asset Securitization Corp. Trust         |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am 25.07.2035                         | 2.138          | 1.871                    | 0,00                              | 5,558 % fällig am 25.05.2035                  | 233            | 223                      | 0,00                              | 4,584 % fällig am 25.12.2036                 | 1.105          | 989                      | 0,00                              |
| EquiFirst Loan Securitization Trust                  |                |                          |                                   | 5,676 % fällig am 25.09.2035                  | 2.938          | 1.960                    | 0,00                              | 4,624 % fällig am 25.01.2037                 | 12.299         | 8.801                    | 0,01                              |
| 4,604 % fällig am 25.04.2037                         | 1.322          | 1.223                    | 0,00                              | 5,788 % fällig am 25.05.2037                  | 5.464          | 2.358                    | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.12.2036                 | 9.753          | 4.115                    | 0,01                              |
| EquiFirst Mortgage Loan Trust                        |                |                          |                                   | 5,917 % fällig am 25.03.2037                  | 2.261          | 409                      | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.10.2036                 | 17.599         | 6.001                    | 0,01                              |
| 5,439 % fällig am 25.04.2035                         | 393            | 389                      | 0,00                              | 6,000 % fällig am 25.10.2037                  | 20             | 18                       | 0,00                              | 4,809 % fällig am 25.05.2037                 | 3.087          | 3.058                    | 0,00                              |
| 6,234 % fällig am 25.04.2035                         | 1.091          | 987                      | 0,                                |                                               |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>IXIS Real Estate Capital Trust</b>      |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.06.2036                            | \$ 200         | \$ 69                    | 0,00                              | 4,989 % fällig am 25.01.2036                                | \$ 2.869       | \$ 2.364                 | 0,00                              |
| 4,494 % fällig am 25.05.2037               | \$ 20.259      | \$ 4.206                 | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.08.2036                            | 3.896          | 1.327                    | 0,00                              | 5,004 % fällig am 25.12.2035                                | 4.481          | 3.896                    | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.01.2037               | 13.872         | 4.701                    | 0,01                              | 4,934 % fällig am 25.11.2035                            | 2.208          | 1.247                    | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.01.2036                                | 1.440          | 1.399                    | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.02.2036               | 3.440          | 945                      | 0,00                              | 5,004 % fällig am 25.01.2036                            | 1.447          | 1.446                    | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.02.2036                                | 82             | 82                       | 0,00                              |
| 4,834 % fällig am 25.03.2036               | 1.287          | 672                      | 0,00                              | 5,134 % fällig am 25.09.2034                            | 1.732          | 1.588                    | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.12.2035                                | 3.484          | 3.255                    | 0,00                              |
| <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.</b> |                |                          |                                   | 5,184 % fällig am 25.10.2035                            | 4.110          | 3.928                    | 0,01                              | 5,094 % fällig am 25.01.2035                                | 2.793          | 2.821                    | 0,00                              |
| 2,924 % fällig am 25.10.2035               | 4.281          | 3.783                    | 0,01                              | 5,259 % fällig am 25.10.2034                            | 185            | 179                      | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.11.2035                                | 5.330          | 5.194                    | 0,01                              |
| 4,944 % fällig am 25.02.2036               | 1.419          | 1.406                    | 0,00                              | 5,439 % fällig am 25.03.2035                            | 1.701          | 1.698                    | 0,00                              | 5,109 % fällig am 25.12.2034                                | 293            | 287                      | 0,00                              |
| 4,974 % fällig am 25.02.2036               | 2.711          | 2.450                    | 0,00                              | 5,584 % fällig am 25.08.2037                            | 5.574          | 4.893                    | 0,01                              | 5,109 % fällig am 25.09.2035                                | 3.563          | 3.417                    | 0,00                              |
| 4,974 % fällig am 25.03.2036               | 5.368          | 5.165                    | 0,01                              | 6,159 % fällig am 25.06.2035                            | 100            | 102                      | 0,00                              | 5,139 % fällig am 25.12.2034                                | 350            | 343                      | 0,00                              |
| 5,019 % fällig am 25.05.2035               | 590            | 585                      | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.11.2035                            | 1.579          | 646                      | 0,00                              | 5,174 % fällig am 25.01.2034                                | 1.236          | 1.254                    | 0,00                              |
| 5,064 % fällig am 25.05.2035               | 5.614          | 5.332                    | 0,01                              | 6,969 % fällig am 25.06.2035                            | 673            | 710                      | 0,00                              | 5,259 % fällig am 25.08.2034                                | 442            | 431                      | 0,00                              |
| 5,139 % fällig am 25.09.2035               | 114            | 113                      | 0,00                              | <b>MASTR Specialized Loan Trust</b>                     |                |                          |                                   | 5,334 % fällig am 25.05.2034                                | 1.125          | 1.184                    | 0,00                              |
| 5,184 % fällig am 25.06.2035               | 2.199          | 2.175                    | 0,00                              | 3,472 % fällig am 25.07.2035                            | 335            | 350                      | 0,00                              | 5,334 % fällig am 25.08.2034                                | 871            | 895                      | 0,00                              |
| <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b> |                |                          |                                   | 4,954 % fällig am 25.06.2046                            | 1.026          | 1.005                    | 0,00                              | 5,349 % fällig am 25.07.2034                                | 521            | 529                      | 0,00                              |
| 4,559 % fällig am 25.11.2036               | 6.434          | 6.880                    | 0,01                              | 5,174 % fällig am 25.01.2037                            | 3.441          | 1.328                    | 0,00                              | 5,364 % fällig am 25.11.2034                                | 115            | 111                      | 0,00                              |
| 4,594 % fällig am 25.12.2036               | 2.833          | 1.474                    | 0,00                              | <b>Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust</b> |                |                          |                                   | 5,364 % fällig am 25.02.2035                                | 2.224          | 2.054                    | 0,00                              |
| 4,614 % fällig am 25.07.2036               | 470            | 218                      | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.04.2037                            | 3.792          | 1.654                    | 0,00                              | 5,364 % fällig am 25.07.2035                                | 1.352          | 1.323                    | 0,00                              |
| 4,644 % fällig am 25.10.2036               | 1.377          | 1.373                    | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.06.2037                            | 444            | 444                      | 0,00                              | 5,379 % fällig am 25.01.2035                                | 1.778          | 1.584                    | 0,00                              |
| 4,664 % fällig am 25.05.2037               | 2.199          | 2.156                    | 0,00                              | 5,114 % fällig am 25.04.2037                            | 10.850         | 4.196                    | 0,01                              | 5,394 % fällig am 25.03.2035                                | 872            | 839                      | 0,00                              |
| 4,704 % fällig am 25.08.2036               | 6.653          | 6.283                    | 0,01                              | 5,434 % fällig am 25.10.2037                            | 6.202          | 5.286                    | 0,01                              | 5,434 % fällig am 25.07.2037                                | 1.372          | 1.362                    | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.12.2036               | 5.176          | 2.697                    | 0,00                              | <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>           |                |                          |                                   | 5,484 % fällig am 25.04.2035                                | 1.561          | 1.462                    | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037               | 7.847          | 7.633                    | 0,01                              | 3,871 % fällig am 25.03.2037                            | 3.429          | 678                      | 0,00                              | 5,484 % fällig am 25.06.2035                                | 2.755          | 2.557                    | 0,00                              |
| 4,839 % fällig am 25.05.2036               | 1.494          | 1.488                    | 0,00                              | 4,242 % fällig am 25.11.2037                            | 7.135          | 3.447                    | 0,00                              | 5,684 % fällig am 25.07.2037                                | 8.600          | 7.649                    | 0,01                              |
| 4,839 % fällig am 25.07.2036               | 1.902          | 1.879                    | 0,00                              | 4,400 % fällig am 25.11.2037                            | 3.302          | 1.033                    | 0,00                              | 6,234 % fällig am 25.05.2034                                | 149            | 149                      | 0,00                              |
| 4,854 % fällig am 25.12.2036               | 5.177          | 2.699                    | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.07.2037                            | 5.742          | 2.210                    | 0,00                              | 7,059 % fällig am 25.03.2034                                | 794            | 869                      | 0,00                              |
| 4,869 % fällig am 25.05.2036               | 3.879          | 3.733                    | 0,01                              | 4,674 % fällig am 25.02.2037                            | 3.759          | 1.062                    | 0,00                              | <b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>                |                |                          |                                   |
| 4,884 % fällig am 25.07.2036               | 3.786          | 3.450                    | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.05.2037                            | 4.614          | 2.271                    | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.12.2036                                | 1.224          | 586                      | 0,00                              |
| 4,944 % fällig am 25.04.2036               | 3.055          | 2.729                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.06.2037                            | 3.453          | 907                      | 0,00                              | 4,604 % fällig am 25.04.2037                                | 14.923         | 7.742                    | 0,01                              |
| 5,004 % fällig am 25.07.2036               | 1.800          | 1.775                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.08.2037                            | 11.648         | 7.381                    | 0,01                              | 4,754 % fällig am 25.04.2036                                | 6.030          | 4.205                    | 0,01                              |
| 5,094 % fällig am 25.07.2036               | 1.998          | 1.892                    | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.07.2037                            | 2.502          | 1.423                    | 0,00                              | 4,784 % fällig am 25.04.2037                                | 189            | 98                       | 0,00                              |
| 5,229 % fällig am 25.01.2037               | 2.513          | 2.275                    | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.04.2047                            | 5.795          | 2.300                    | 0,00                              | 4,944 % fällig am 25.02.2036                                | 5.369          | 5.085                    | 0,01                              |
| 6,630 % fällig am 25.07.2036               | 9.311          | 2.491                    | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.07.2037                            | 3.268          | 692                      | 0,00                              | <b>Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust</b>        |                |                          |                                   |
| 6,910 % fällig am 25.07.2036               | 2.155          | 576                      | 0,00                              | 4,954 % fällig am 25.03.2037                            | 2.472          | 649                      | 0,00                              | 4,534 % fällig am 25.11.2036                                | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>      |                |                          |                                   | 4,954 % fällig am 25.07.2037                            | 5.016          | 1.964                    | 0,00                              | 4,574 % fällig am 25.11.2036                                | 9.975          | 3.210                    | 0,00                              |
| 4,614 % fällig am 25.09.2036               | 10.933         | 2.907                    | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.12.2036                            | 1.672          | 1.618                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                                | 12.914         | 5.070                    | 0,01                              |
| 4,634 % fällig am 25.07.2036               | 6.022          | 2.380                    | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.01.2037                            | 4.457          | 4.207                    | 0,01                              | 4,734 % fällig am 25.11.2036                                | 5.387          | 1.734                    | 0,00                              |
| 4,654 % fällig am 25.11.2036               | 308            | 92                       | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.03.2037                            | 8.267          | 7.712                    | 0,01                              | 4,874 % fällig am 25.11.2036                                | 1.474          | 474                      | 0,00                              |
| 4,674 % fällig am 25.08.2036               | 18.211         | 7.326                    | 0,01                              | 5,334 % fällig am 25.02.2047                            | 188            | 110                      | 0,00                              | <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,724 % fällig am 25.07.2036               | 6.560          | 4.541                    | 0,01                              | 5,364 % fällig am 25.07.2035                            | 2.873          | 2.877                    | 0,00                              | 4,594 % fällig am 25.11.2036                                | 1.331          | 366                      | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.05.2036               | 8.865          | 4.667                    | 0,01                              | 5,409 % fällig am 25.04.2036                            | 194            | 192                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.10.2036                                | 7.641          | 2.127                    | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036               | 2.342          | 928                      | 0,00                              | 5,439 % fällig am 25.06.2036                            | 2.875          | 2.329                    | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.11.2036                                | 4.331          | 1.192                    | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.09.2036               | 678            | 436                      | 0,00                              | 5,514 % fällig am 25.10.2035                            | 52             | 52                       | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.01.2047                                | 3.561          | 1.050                    | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.11.2036               | 12.884         | 9.113                    | 0,01                              | 5,559 % fällig am 25.08.2036                            | 1.075          | 1.240                    | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.04.2037                                | 14.915         | 5.247                    | 0,01                              |
| 4,754 % fällig am 25.10.2036               | 10.764         | 3.149                    | 0,00                              | <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>           |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.02.2037                                | 3.643          | 2.051                    | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.08.2036               | 2.313          | 931                      | 0,00                              | 3,829 % fällig am 25.01.2035                            | 1.619          | 1.482                    | 0,00                              | 6,077 % fällig am 25.10.2046                                | 4.128          | 961                      | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.09.2036               | 9.159          | 2.447                    | 0,00                              | 4,504 % fällig am 25.10.2036                            | 2.644          | 1.370                    | 0,00                              | 6,263 % fällig am 25.01.2047                                | 1.180          | 346                      | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.10.2036               | 27.628         | 8.589                    | 0,01                              | 4,524 % fällig am 25.01.2037                            | 14.763         | 6.799                    | 0,01                              | 6,298 % fällig am 25.10.2036                                | 8.404          | 1.859                    | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.12.2036               | 20.525         | 14.026                   | 0,02                              | 4,534 % fällig am 25.07.2036                            | 6.111          | 2.213                    | 0,00                              | 6,326 % fällig am 25.09.2046                                | 11.016         | 2.386                    | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.05.2046               | 9.866          | 9.409                    | 0,01                              | 4,534 % fällig am 25.10.2036                            | 1.273          | 556                      | 0,00                              | 6,488 % fällig am 25.11.2036                                | 6.184          | 1.351                    | 0,00                              |
| 4,774 % fällig am 25.12.2036               | 81             | 28                       | 0,00                              | 4,544 % fällig am 25.10.2036                            | 5.806          | 3.008                    | 0,00                              | 6,592 % fällig am 25.10.2036                                | 1.690          | 509                      | 0,00                              |
| 4,794 % fällig am 25.03.2046               | 16.641         | 13.029                   | 0,01                              | 4,544 % fällig am 25.12.2036                            | 3.305          | 1.648                    | 0,00                              | <b>Nationstar Home Equity Loan Trust</b>                    |                |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.03.2046               | 2.561          | 906                      | 0,00                              | 4,544 % fällig am 25.02.2037                            | 3.120          | 990                      | 0,00                              | 4,609 % fällig am 25.06.2037                                | 3.405          | 3.332                    | 0,00                              |
| 4,894 % fällig am 25.12.2036               | 1.340          | 462                      | 0,00                              | 4,544 % fällig am 25.03.2037                            | 398            | 170                      | 0,00                              | 5,074 % fällig am 25.04.2037                                | 4.388          | 4.352                    | 0,01                              |
| 4,914 % fällig am 25.08.2036               | 2.851          | 1.149                    | 0,00                              | 4,564 % fällig am 25.01.2037                            | 90             | 41                       | 0,00                              | <b>New Century Home Equity Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,954 % fällig am 25.08.2045               | 441            | 434                      | 0,00                              | 4,564 % fällig am 25.02.2037                            | 41             | 36                       | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.08.2036                                | 3.931          | 3.893                    | 0,01                              |
| 4,994 % fällig am 25.10.2034               | 3.985          | 3.932                    | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.10.2036                            | 16.050         | 7.004                    | 0,01                              | 4,794 % fällig am 25.05.2036                                | 687            | 689                      | 0,00                              |
| 5,034 % fällig am 25.01.2036               | 11.800         | 10.993                   | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.05.2037                            | 20.890         | 17.503                   | 0,02                              | 5,079 % fällig am 25.12.2035                                | 5.819          | 5.597                    | 0,01                              |
| 5,034 % fällig am 25.02.2036               | 9.325          | 8.039                    | 0,01                              | 4,584 % fällig am 25.12.2036                            | 9.771          | 4.872                    | 0,01                              | 5,154 % fällig am 25.03.2035                                | 4.293          | 4.311                    | 0,01                              |
| 5,214 % fällig am 25.08.2035               | 5.508          | 5.422                    | 0,01                              | 4,584 % fällig am 25.02.2037                            | 3.074          | 1.338                    | 0,00                              | 5,169 % fällig am 25.10.2035                                | 6.885          | 5.977                    | 0,01                              |
| 5,229 % fällig am 25.06.2034               | 1.247          | 1.282                    | 0,00                              | 4,594 % fällig am 25.09.2036                            | 481            | 208                      | 0,00                              | 5,174 % fällig am 25.08.2034                                | 1.211          | 1.215                    | 0,00                              |
| 5,484 % fällig am 25.06.2035               | 4.065          | 3.988                    | 0,01                              | 4,594 % fällig am 25.11.2036                            | 4.740          | 2.685                    | 0,00                              | 5,199 % fällig am 25.02.2035                                | 3.066          | 2.969                    | 0,00                              |
| 5,559 % fällig am 25.04.2035               | 2.500          | 2.430                    | 0,00                              | 4,614 % fällig am 25.02.2037                            | 2.168          | 688                      | 0,00                              | 5,319 % fällig am 25.08.2034                                | 356            | 378                      | 0,00                              |
| 5,584 % fällig am 25.09.2034               | 504            | 509                      | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.11.2036                            | 4.400          | 2.493                    | 0,00                              | 5,364 % fällig am 25.11.2034                                | 2.398          | 2.432                    | 0,00                              |
| 5,859 % fällig am 25.02.2035               | 3.929          | 3.644                    | 0,01                              | 4,634 % fällig am 25.05.2037                            | 6.353          | 3.642                    | 0,01                              | 5,379 % fällig am 25.06.2035                                | 286            | 300                      | 0,00                              |
| <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b> |                |                          |                                   | 4,644 % fällig am 25.01.2037                            | 4.706          | 2.168                    | 0,00                              | 5,379 % fällig am 25.09.2035                                | 5.743          | 5.683                    | 0,01                              |
| 4,534 % fällig am 25.10.2036               | 4.930          | 1.608                    | 0,00                              | 4,684 % fällig am 25.07.2036                            | 6.752          | 6.137                    | 0,01                              | 5,409 % fällig am 25.11.2034                                | 2              | 3                        | 0,00                              |
| 4,534 % fällig am 25.11.2036               | 840            | 251                      | 0,00                              | 4,684 % fällig am 25.12.2036                            | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,409 % fällig am 25.06.2035                                | 6.127          | 6.038                    | 0,01                              |
| 4,634 % fällig am 25.08.2036               | 8.035          | 2.720                    | 0,00                              | 4,684 % fällig am 25.03.2037                            | 4.955          | 2.111                    | 0,00                              | 5,439 % fällig am 25.07.2035                                | 7.203          | 7.165                    | 0,01                              |
| 4,634 % fällig am 25.10.2036               | 4.967          | 2.426                    | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.02.2037                            | 534            | 232                      | 0,00                              | 5,499 % fällig am 25.03.2035                                | 342            | 341                      | 0,00                              |
| 4,654 % fällig am 25.11.2036               | 6.558          | 1.960                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.06.2036                            | 3.349          | 1.665                    | 0,00                              | <b>Newcastle Mortgage Securities Trust</b>                  |                |                          |                                   |
| 4,694 % fällig am 25.10.2036               | 472            | 209                      | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                            | 3.234          | 1.177                    | 0,00                              | 4,624 % fällig am 25.04.2037                                | 1.922          | 1.865                    | 0,00                              |
| 4,704 % fällig am 25.08.2036               | 7.081          | 2.596                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.11.2036                            | 6.438          | 3.647                    | 0,01                              | 4,664 % fällig am 25.04.2037                                | 4.211          | 4.179                    | 0,01                              |
| 4,724 % fällig am 25.01.2037               | 21.022         | 5.497                    | 0,01                              | 4,754 % fällig am 25.09.2036                            | 3.864          | 1.666                    | 0,00                              | 5,109 % fällig am 25.03.2036                                | 3.934          | 3.942                    | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.04.2036               | 4.020          | 816                      | 0,00                              | 4,764 % fällig am 25.02.2037                            | 8.034          | 3.496                    | 0,00                              | <b>Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust</b> |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.06.2036               | 3.343          | 1.153                    | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.06.2036                            | 19.432         | 13.055                   | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.03.2036                                | 1.963          |                          |                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 6,492 % fällig am 25.02.2037                                                 | \$ 4.087       | \$ 1.086                 | 0,00                              | 5,194 % fällig am 25.10.2046                                          | \$ 1.602       | \$ 1.565                 | 0,00                              | 5,409 % fällig am 26.12.2034                          | \$ 629         | \$ 574                   | 0,00                              |
| 6,532 % fällig am 25.10.2036                                                 | 2.556          | 528                      | 0,00                              | <b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>                             |                |                          |                                   | 6,184 % fällig am 25.12.2037                          | 6.602          | 5.850                    | 0,01                              |
| <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                                       |                |                          |                                   | 5,174 % fällig am 25.08.2035                                          | 2.449          | 2.185                    | 0,00                              | <b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b> |                |                          |                                   |
| 3,719 % fällig am 25.01.2036                                                 | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,194 % fällig am 25.12.2032                                          | 35             | 33                       | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.12.2036                          | 144            | 31                       | 0,00                              |
| 4,614 % fällig am 25.09.2037                                                 | 3.592          | 3.424                    | 0,00                              | 5,285 % fällig am 25.01.2037                                          | 2.814          | 857                      | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.12.2036                          | 12.246         | 2.635                    | 0,00                              |
| 4,634 % fällig am 25.09.2037                                                 | 6.733          | 6.624                    | 0,01                              | 5,294 % fällig am 25.01.2037                                          | 18.457         | 5.633                    | 0,01                              | 4,694 % fällig am 25.12.2036                          | 5.962          | 5.559                    | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.06.2036                                                 | 2.627          | 1.923                    | 0,00                              | 5,434 % fällig am 25.08.2035                                          | 705            | 703                      | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.05.2037                          | 7              | 5                        | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.09.2036                                                 | 5.401          | 2.100                    | 0,00                              | 5,512 % fällig am 25.04.2037                                          | 8.724          | 1.989                    | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.01.2037                          | 4.335          | 3.716                    | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                                                 | 2.318          | 766                      | 0,00                              | 5,545 % fällig am 25.01.2037                                          | 2.529          | 809                      | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.09.2036                          | 5.372          | 1.803                    | 0,00                              |
| 4,754 % fällig am 25.05.2036                                                 | 1.285          | 1.274                    | 0,00                              | 5,608 % fällig am 25.05.2036                                          | 6.712          | 2.913                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.12.2036                          | 502            | 245                      | 0,00                              |
| 4,774 % fällig am 25.11.2036                                                 | 10.447         | 3.200                    | 0,00                              | 5,612 % fällig am 25.04.2037                                          | 5.992          | 1.391                    | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.05.2037                          | 8.735          | 5.301                    | 0,01                              |
| 4,774 % fällig am 25.01.2037                                                 | 18.426         | 6.102                    | 0,01                              | 5,675 % fällig am 25.06.2037                                          | 421            | 105                      | 0,00                              | 4,874 % fällig am 25.01.2037                          | 835            | 612                      | 0,00                              |
| 4,794 % fällig am 25.03.2037                                                 | 19.940         | 6.587                    | 0,01                              | 5,731 % fällig am 25.11.2036                                          | 4.836          | 1.605                    | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.07.2036                          | 5.628          | 1.848                    | 0,00                              |
| 4,974 % fällig am 25.05.2036                                                 | 400            | 388                      | 0,00                              | 5,742 % fällig am 25.04.2037                                          | 19.235         | 4.569                    | 0,01                              | 4,974 % fällig am 25.03.2036                          | 398            | 365                      | 0,00                              |
| 5,124 % fällig am 25.01.2036                                                 | 5.700          | 5.344                    | 0,01                              | 5,744 % fällig am 25.06.2037                                          | 5.934          | 1.493                    | 0,00                              | 5,079 % fällig am 25.10.2035                          | 2.003          | 1.621                    | 0,00                              |
| 5,154 % fällig am 25.10.2035                                                 | 250            | 252                      | 0,00                              | 5,746 % fällig am 25.05.2036                                          | 2.541          | 1.129                    | 0,00                              | 5,109 % fällig am 25.01.2035                          | 460            | 421                      | 0,00                              |
| 5,169 % fällig am 25.01.2036                                                 | 4.932          | 4.778                    | 0,01                              | 5,761 % fällig am 25.04.2037                                          | 2.781          | 663                      | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.10.2035                          | 3.745          | 3.245                    | 0,00                              |
| 5,259 % fällig am 25.06.2034                                                 | 718            | 713                      | 0,00                              | 5,762 % fällig am 25.08.2036                                          | 8.258          | 2.923                    | 0,00                              | 5,319 % fällig am 25.10.2035                          | 2.927          | 2.566                    | 0,00                              |
| 6,159 % fällig am 25.12.2034                                                 | 698            | 626                      | 0,00                              | 5,797 % fällig am 25.08.2036                                          | 12.841         | 4.573                    | 0,01                              | <b>SG Mortgage Securities Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 6,309 % fällig am 25.03.2035                                                 | 1.625          | 1.607                    | 0,00                              | 5,812 % fällig am 25.11.2036                                          | 8.748          | 2.945                    | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.07.2036                          | 23.097         | 4.796                    | 0,01                              |
| <b>Option One Mortgage Loan Trust</b>                                        |                |                          |                                   | 5,857 % fällig am 25.05.2035                                          | 2.027          | 1.471                    | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.02.2036                          | 3.456          | 1.700                    | 0,00                              |
| 4,534 % fällig am 25.07.2036                                                 | 1.889          | 820                      | 0,00                              | 5,879 % fällig am 25.06.2037                                          | 2.974          | 766                      | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.02.2036                          | 1.818          | 899                      | 0,00                              |
| 4,554 % fällig am 25.03.2037                                                 | 3.817          | 3.725                    | 0,01                              | 5,893 % fällig am 25.06.2037                                          | 28.633         | 7.397                    | 0,01                              | 5,139 % fällig am 25.10.2035                          | 921            | 860                      | 0,00                              |
| 4,564 % fällig am 25.07.2037                                                 | 7.679          | 4.949                    | 0,01                              | 5,906 % fällig am 25.06.2037                                          | 7.657          | 1.983                    | 0,00                              | 5,319 % fällig am 25.10.2035                          | 1.083          | 905                      | 0,00                              |
| 4,574 % fällig am 25.03.2037                                                 | 12.962         | 7.084                    | 0,01                              | 6,011 % fällig am 25.05.2036                                          | 3.091          | 1.436                    | 0,00                              | <b>Soundview Home Loan Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| 4,604 % fällig am 25.05.2037                                                 | 17.821         | 9.561                    | 0,01                              | 6,120 % fällig am 25.11.2036                                          | 11.903         | 4.221                    | 0,01                              | 4,514 % fällig am 25.06.2037                          | 2.879          | 1.896                    | 0,00                              |
| 4,614 % fällig am 25.04.2037                                                 | 616            | 301                      | 0,00                              | 6,166 % fällig am 25.05.2036                                          | 3.374          | 1.608                    | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.11.2036                          | 9.666          | 2.630                    | 0,00                              |
| 4,614 % fällig am 25.07.2037                                                 | 3.196          | 2.060                    | 0,00                              | 6,511 % fällig am 25.07.2034                                          | 874            | 765                      | 0,00                              | 4,584 % fällig am 25.06.2037                          | 15.275         | 10.057                   | 0,01                              |
| 4,624 % fällig am 25.07.2037                                                 | 1.327          | 1.180                    | 0,00                              | 6,998 % fällig am 25.09.2037                                          | 9.079          | 3.600                    | 0,00                              | 4,604 % fällig am 25.07.2037                          | 1.099          | 971                      | 0,00                              |
| 4,634 % fällig am 25.07.2036                                                 | 9.339          | 5.369                    | 0,01                              | 7,238 % fällig am 25.09.2037                                          | 9.244          | 3.664                    | 0,01                              | 4,604 % fällig am 25.08.2037                          | 7.121          | 6.231                    | 0,01                              |
| 4,654 % fällig am 25.04.2037                                                 | 29.561         | 20.456                   | 0,02                              | <b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>                      |                |                          |                                   | 4,614 % fällig am 25.07.2037                          | 5.245          | 4.718                    | 0,01                              |
| 4,654 % fällig am 25.05.2037                                                 | 4.441          | 2.674                    | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.12.2035                                          | 488            | 406                      | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.06.2037                          | 19.795         | 13.465                   | 0,02                              |
| 4,684 % fällig am 25.03.2037                                                 | 2.324          | 1.148                    | 0,00                              | 4,944 % fällig am 25.03.2036                                          | 2.096          | 2.062                    | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.03.2037                          | 3.718          | 3.558                    | 0,00                              |
| 4,714 % fällig am 25.01.2037                                                 | 14.780         | 9.464                    | 0,01                              | 4,974 % fällig am 25.02.2036                                          | 3.029          | 2.941                    | 0,00                              | 4,754 % fällig am 25.01.2037                          | 7.867          | 5.709                    | 0,01                              |
| 4,714 % fällig am 25.02.2037                                                 | 18.287         | 11.552                   | 0,01                              | 5,079 % fällig am 25.02.2036                                          | 500            | 486                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.11.2036                          | 6.447          | 1.755                    | 0,00                              |
| 4,874 % fällig am 25.01.2037                                                 | 6.495          | 3.811                    | 0,01                              | 5,114 % fällig am 25.12.2035                                          | 3.440          | 3.077                    | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.02.2037                          | 31.768         | 9.456                    | 0,01                              |
| 4,974 % fällig am 25.01.2036                                                 | 18.164         | 17.113                   | 0,02                              | 5,379 % fällig am 25.10.2035                                          | 1.284          | 1.121                    | 0,00                              | 4,839 % fällig am 25.12.2036                          | 4.428          | 4.407                    | 0,01                              |
| 5,169 % fällig am 25.05.2035                                                 | 1.800          | 1.743                    | 0,00                              | 5,484 % fällig am 25.08.2035                                          | 1.065          | 1.053                    | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.06.2036                          | 3.752          | 3.204                    | 0,00                              |
| 5,229 % fällig am 25.05.2034                                                 | 1.465          | 1.484                    | 0,00                              | 5,499 % fällig am 25.05.2035                                          | 2.081          | 2.024                    | 0,00                              | 4,884 % fällig am 25.05.2036                          | 7.474          | 6.535                    | 0,01                              |
| 5,304 % fällig am 25.05.2035                                                 | 700            | 597                      | 0,00                              | <b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>                       |                |                          |                                   | 4,899 % fällig am 25.02.2036                          | 3.037          | 2.862                    | 0,00                              |
| 5,364 % fällig am 25.08.2035                                                 | 2.680          | 2.306                    | 0,00                              | 4,654 % fällig am 25.02.2037                                          | 5.523          | 5.395                    | 0,01                              | 4,899 % fällig am 25.06.2036                          | 7.767          | 6.940                    | 0,01                              |
| <b>Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 25.07.2036                                          | 3.207          | 3.140                    | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.07.2036                          | 21.212         | 19.463                   | 0,02                              |
| 5,064 % fällig am 25.12.2035                                                 | 149            | 145                      | 0,00                              | 4,714 % fällig am 25.09.2036                                          | 1.906          | 1.887                    | 0,00                              | 4,934 % fällig am 25.10.2036                          | 9.797          | 9.390                    | 0,01                              |
| 5,124 % fällig am 25.11.2035                                                 | 1.866          | 1.801                    | 0,00                              | 4,849 % fällig am 25.01.2037                                          | 5.897          | 4.989                    | 0,01                              | 4,934 % fällig am 25.11.2036                          | 2.655          | 2.514                    | 0,00                              |
| 5,169 % fällig am 25.11.2035                                                 | 1.250          | 1.075                    | 0,00                              | 4,869 % fällig am 25.06.2036                                          | 2.326          | 2.301                    | 0,00                              | 4,951 % fällig am 25.03.2036                          | 6.465          | 5.710                    | 0,01                              |
| <b>Ownit Mortgage Loan Trust</b>                                             |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.01.2037                                          | 2.791          | 2.717                    | 0,00                              | 4,959 % fällig am 25.03.2036                          | 110            | 110                      | 0,00                              |
| 3,136 % fällig am 25.12.2035                                                 | 1.548          | 867                      | 0,00                              | 4,944 % fällig am 25.04.2036                                          | 4.426          | 4.057                    | 0,01                              | 4,989 % fällig am 25.03.2036                          | 493            | 485                      | 0,00                              |
| 4,654 % fällig am 25.07.2037                                                 | 993            | 898                      | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.07.2036                                          | 2.004          | 1.755                    | 0,00                              | 4,994 % fällig am 25.10.2036                          | 2.694          | 2.670                    | 0,00                              |
| <b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b>    |                |                          |                                   | 4,994 % fällig am 25.04.2036                                          | 571            | 572                      | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.01.2037                          | 2.785          | 2.701                    | 0,00                              |
| 5,154 % fällig am 25.05.2035                                                 | 34             | 34                       | 0,00                              | 5,019 % fällig am 25.03.2036                                          | 583            | 582                      | 0,00                              | 5,124 % fällig am 25.12.2035                          | 8.276          | 7.719                    | 0,01                              |
| 5,169 % fällig am 25.08.2035                                                 | 3.658          | 3.643                    | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.02.2036                                          | 1.050          | 1.048                    | 0,00                              | 5,184 % fällig am 25.10.2035                          | 403            | 370                      | 0,00                              |
| 5,169 % fällig am 25.09.2035                                                 | 7.365          | 7.227                    | 0,01                              | 5,049 % fällig am 25.11.2035                                          | 81             | 77                       | 0,00                              | 5,274 % fällig am 25.08.2035                          | 3.534          | 3.228                    | 0,00                              |
| 5,229 % fällig am 25.07.2035                                                 | 52             | 52                       | 0,00                              | 5,064 % fällig am 25.02.2036                                          | 2.810          | 2.715                    | 0,00                              | 5,334 % fällig am 25.10.2037                          | 14.708         | 11.287                   | 0,01                              |
| 5,379 % fällig am 25.09.2035                                                 | 2.506          | 2.229                    | 0,00                              | 5,094 % fällig am 25.12.2035                                          | 3.656          | 3.592                    | 0,00                              | 5,364 % fällig am 25.11.2035                          | 6              | 6                        | 0,00                              |
| 5,409 % fällig am 25.07.2035                                                 | 5.600          | 4.732                    | 0,01                              | 5,114 % fällig am 25.04.2037                                          | 5.028          | 4.888                    | 0,01                              | 5,384 % fällig am 25.09.2037                          | 1.356          | 1.134                    | 0,00                              |
| 5,439 % fällig am 25.06.2035                                                 | 1.948          | 1.877                    | 0,00                              | 5,114 % fällig am 25.05.2037                                          | 537            | 533                      | 0,00                              | 5,409 % fällig am 25.03.2036                          | 1.892          | 1.797                    | 0,00                              |
| 5,469 % fällig am 25.05.2035                                                 | 3.000          | 2.437                    | 0,00                              | 5,136 % fällig am 25.04.2034                                          | 382            | 376                      | 0,00                              | 5,434 % fällig am 25.09.2037                          | 3.800          | 2.760                    | 0,00                              |
| 5,484 % fällig am 25.06.2035                                                 | 1.992          | 1.718                    | 0,00                              | 5,139 % fällig am 25.09.2035                                          | 713            | 683                      | 0,00                              | 5,469 % fällig am 25.05.2035                          | 445            | 445                      | 0,00                              |
| 5,559 % fällig am 25.03.2035                                                 | 372            | 367                      | 0,00                              | 5,139 % fällig am 25.10.2035                                          | 1.147          | 1.022                    | 0,00                              | 5,514 % fällig am 25.07.2035                          | 237            | 236                      | 0,00                              |
| 5,754 % fällig am 25.01.2036                                                 | 5.397          | 5.174                    | 0,01                              | 5,154 % fällig am 25.01.2036                                          | 3.751          | 3.712                    | 0,01                              | 5,534 % fällig am 25.09.2037                          | 1.224          | 1.024                    | 0,00                              |
| 6,009 % fällig am 25.02.2035                                                 | 6.426          | 6.327                    | 0,01                              | 5,214 % fällig am 25.06.2034                                          | 1.291          | 1.280                    | 0,00                              | <b>Southern Pacific Securities PLC</b>                |                |                          |                                   |
| 6,204 % fällig am 25.10.2034                                                 | 4.239          | 4.058                    | 0,01                              | 5,304 % fällig am 25.11.2035                                          | 2.585          | 2.247                    | 0,00                              | 4,834 % fällig am 25.03.2028                          | 38             | 38                       | 0,00                              |
| 6,234 % fällig am 25.12.2034                                                 | 6.242          | 6.232                    | 0,01                              | 5,394 % fällig am 25.08.2035                                          | 1.209          | 1.200                    | 0,00                              | <b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>         |                |                          |                                   |
| 6,309 % fällig am 25.10.2034                                                 | 1.300          | 1.156                    | 0,00                              | 5,469 % fällig am 25.10.2035                                          | 1.713          | 1.692                    | 0,00                              | 4,694 % fällig am 25.07.2036                          | 618            | 454                      | 0,00                              |
| 6,309 % fällig am 25.12.2034                                                 | 4.436          | 4.194                    | 0,01                              | 5,679 % fällig am 25.03.2035                                          | 688            | 678                      | 0,00                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                          | 469            | 464                      | 0,00                              |
| 6,534 % fällig am 25.09.2034                                                 | 107            | 92                       | 0,00                              | 6,234 % fällig am 25.04.2035                                          | 368            | 358                      | 0,00                              | 4,779 % fällig am 25.07.2036                          | 14.067         | 8.076                    | 0,01                              |
| <b>People's Choice Home Loan Securities Trust</b>                            |                |                          |                                   | 6,384 % fällig am 25.11.2034                                          | 884            | 881                      | 0,00                              | 4,984 % fällig am 25.09.2034                          | 3.062          | 2.973                    | 0,00                              |
| 5,114 % fällig am 25.12.2035                                                 | 1.179          | 1.166                    | 0,00                              | <b>Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust</b> |                |                          |                                   | 5,034 % fällig am 25.04.2036                          | 8.462          | 4.045                    | 0,01                              |
| 5,289 % fällig am 25.08.2035                                                 | 1.505          | 1.474                    | 0,00                              | 5,400 % fällig am 25.12.2035                                          | 1.548          | 238                      | 0,00                              | 5,054 % fällig am 25.01.2036                          | 3.339          | 3.145                    | 0,00                              |
| 5,379 % fällig am 25.05.2035                                                 | 402            | 378                      | 0,00                              | <b>Saxon Asset Securities Trust</b>                                   |                |                          |                                   | 5,064 % fällig am 25.11.2035                          | 4.270          | 4.190                    | 0,01                              |
| 5,409 % fällig am 25.05.2035                                                 | 7.624          | 5.072                    | 0,01                              | 1,788 % fällig am 25.11.2035                                          | 3.734          | 3.396                    | 0,00                              | 5,139 % fällig am 25.03.2034                          | 103            | 107                      | 0,00                              |
| <b>People's Financial Realty Mortgage Securities Trust</b>                   |                |                          |                                   | 1,814 % fällig am 25.05.2035                                          | 3.017          | 2.800                    | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.04.2033                          | 260            | 276                      | 0,00                              |
| 4,674 % fällig am 25.09.2036                                                 | 10.475         | 1.949                    | 0,00                              | 2,070 % fällig am 25.08.2035                                          | 2.740          | 2.929                    | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.04.2035                          | 968            | 958                      | 0,00                              |
| <b>Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust</b>                               |                |                          |                                   | 4,614 % fällig am 25.05.2037                                          | 2.278          | 1.662                    | 0,00                              | 5,154 % fällig am 25.07.2035                          | 211            | 203                      | 0,00                              |
| 4,744 % fällig am 25.06.2047                                                 | 715            | 667                      | 0,00                              | 4,634 % fällig am 25.05.2047                                          | 7.558          | 6.777                    | 0,01                              | 5,154 % fällig am 25.10.2035                          | 73             | 72                       | 0,00                              |
| 4,929 % fällig am 25.07.2036                                                 | 1.751          | 1.673                    | 0,00                              | 4,744 % fällig am 25.09.2037                                          | 6.681          | 6.432                    | 0,01                              | 5,154 % fällig am 25.01.2036                          | 2.650          | 2.579                    | 0,00                              |
| 5,917 % fällig am 25.04.                                                     |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,434 % fällig am 25.09.2034                                         | \$ 2.295       | \$ 2.227                 | 0,00                              | 6,770 % fällig am 25.10.2046                                    | \$ 3.886       | \$ 2.884                 | 0,00                              | Anchorage Capital Europe CLO DAC         |                |                          |                                   |
| 5,559 % fällig am 25.07.2033                                         | 255            | 252                      | 0,00                              | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC               |                |                          |                                   | 3,499 % fällig am 15.10.2038             | € 30.000       | \$ 35.164                | 0,04                              |
| 5,634 % fällig am 25.12.2034                                         | 140            | 140                      | 0,00                              | 2,985 % fällig am 25.12.2036                                    | 3.739          | 3.021                    | 0,00                              | Apidos CLO Ltd.                          |                |                          |                                   |
| 5,709 % fällig am 25.12.2034                                         | 1.302          | 1.263                    | 0,00                              | 3,114 % fällig am 25.01.2037                                    | 14.229         | 3.931                    | 0,01                              | 5,622 % fällig am 16.07.2031             | \$ 1.823       | 1.826                    | 0,00                              |
| 5,814 % fällig am 25.04.2033                                         | 13             | 13                       | 0,00                              | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                             |                |                          |                                   | Aqueduct European CLO DAC                |                |                          |                                   |
| 5,934 % fällig am 25.11.2034                                         | 395            | 433                      | 0,00                              | 4,214 % fällig am 25.01.2037                                    | 2.016          | 997                      | 0,00                              | 3,073 % fällig am 15.08.2034             | € 15.000       | 17.557                   | 0,02                              |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                |                |                          |                                   | 4,219 % fällig am 25.07.2036                                    | 777            | 770                      | 0,00                              | Arbour CLO DAC                           |                |                          |                                   |
| 4,589 % fällig am 25.09.2036                                         | 8.304          | 5.094                    | 0,01                              | 4,262 % fällig am 25.11.2036                                    | 3.711          | 3.378                    | 0,00                              | 2,795 % fällig am 15.09.2031             | 12.055         | 14.151                   | 0,01                              |
| 4,594 % fällig am 25.01.2037                                         | 5.978          | 5.655                    | 0,01                              | 4,694 % fällig am 25.03.2037                                    | 1.682          | 1.665                    | 0,00                              | 2,945 % fällig am 15.06.2034             | 6.800          | 7.986                    | 0,01                              |
| 4,604 % fällig am 25.01.2037                                         | 92             | 92                       | 0,00                              | 4,884 % fällig am 25.01.2037                                    | 193            | 191                      | 0,00                              | 3,069 % fällig am 15.04.2034             | 2.000          | 2.340                    | 0,00                              |
| 4,614 % fällig am 25.03.2036                                         | 278            | 277                      | 0,00                              | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                              |                |                          |                                   | 3,139 % fällig am 15.04.2034             | 6.000          | 7.016                    | 0,01                              |
| 4,654 % fällig am 25.10.2037                                         | 17.010         | 10.712                   | 0,01                              | 4,674 % fällig am 25.04.2037                                    | 14.098         | 3.678                    | 0,00                              | 3,155 % fällig am 15.12.2038             | 28.400         | 33.356                   | 0,03                              |
| 4,664 % fällig am 25.01.2037                                         | 13.455         | 7.678                    | 0,01                              | 4,914 % fällig am 25.04.2037                                    | 3.381          | 888                      | 0,00                              | 3,279 % fällig am 15.10.2034             | 20.000         | 23.436                   | 0,02                              |
| 4,664 % fällig am 25.05.2047                                         | 4.663          | 4.563                    | 0,01                              | 5,154 % fällig am 25.04.2037                                    | 3.279          | 856                      | 0,00                              | 3,293 % fällig am 15.11.2037             | 44.300         | 52.014                   | 0,05                              |
| 4,674 % fällig am 25.01.2037                                         | 3.500          | 3.285                    | 0,00                              | Saxon Asset Securities Trust                                    |                |                          |                                   | 3,473 % fällig am 15.05.2038             | 39.750         | 46.688                   | 0,05                              |
| 4,685 % fällig am 25.02.2035                                         | 1.158          | 1.228                    | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.10.2046                                    | 16.837         | 14.731                   | 0,02                              | Arcano Euro CLO DAC                      |                |                          |                                   |
| 4,694 % fällig am 25.05.2036                                         | 2.067          | 2.033                    | 0,00                              | Structured Asset Investment Loan Trust                          |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 25.07.2039 (c)         | 36.000         | 42.259                   | 0,04                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                                         | 2.446          | 1.636                    | 0,00                              | 4,814 % fällig am 25.03.2036                                    | 405            | 402                      | 0,00                              | Ares European CLO DAC                    |                |                          |                                   |
| 4,744 % fällig am 25.08.2046                                         | 3.421          | 3.131                    | 0,00                              | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust           |                |                          |                                   | 3,059 % fällig am 15.10.2031             | 5.170          | 6.060                    | 0,01                              |
| 4,854 % fällig am 25.02.2037                                         | 120            | 118                      | 0,00                              | 4,774 % fällig am 25.12.2036                                    | 138            | 138                      | 0,00                              | 3,086 % fällig am 20.04.2032             | 4.607          | 5.410                    | 0,01                              |
| 4,864 % fällig am 25.03.2037                                         | 3.297          | 2.417                    | 0,00                              | 5,054 % fällig am 25.12.2036                                    | 11.110         | 6.578                    | 0,01                              | 3,183 % fällig am 17.04.2032             | 7.526          | 8.842                    | 0,01                              |
| 4,869 % fällig am 25.07.2036                                         | 4.988          | 4.944                    | 0,01                              | 6,234 % fällig am 25.08.2037                                    | 989            | 984                      | 0,00                              | 3,229 % fällig am 15.01.2036             | 4.200          | 4.922                    | 0,01                              |
| 4,894 % fällig am 25.02.2037                                         | 8.200          | 8.047                    | 0,01                              | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust           |                |                          |                                   | 3,266 % fällig am 21.10.2034             | 13.101         | 15.374                   | 0,02                              |
| 4,934 % fällig am 25.11.2037                                         | 9.653          | 7.961                    | 0,01                              | 4,854 % fällig am 25.03.2037                                    | 789            | 786                      | 0,00                              | 4,036 % fällig am 21.10.2034             | 3.000          | 3.534                    | 0,00                              |
| 4,959 % fällig am 25.07.2036                                         | 1.149          | 1.129                    | 0,00                              |                                                                 |                |                          |                                   | Armada Euro CLO DAC                      |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.05.2031                                         | 256            | 182                      | 0,00                              |                                                                 |                |                          |                                   | 3,091 % fällig am 28.07.2034             | 6.583          | 7.703                    | 0,01                              |
| 5,054 % fällig am 25.02.2037                                         | 3.698          | 3.642                    | 0,01                              |                                                                 |                |                          |                                   | Atlas Senior Loan Fund Ltd.              |                |                          |                                   |
| 5,071 % fällig am 25.08.2034                                         | 35             | 35                       | 0,00                              | FERTIGHAUS ABS SONSTIGE                                         |                |                          |                                   | 5,717 % fällig am 24.10.2031             | \$ 2.477       | 2.481                    | 0,00                              |
| 5,109 % fällig am 25.04.2035                                         | 313            | 304                      | 0,00                              | Conseco Finance Securitizations Corp.                           |                |                          |                                   | Aurium CLO DAC                           |                |                          |                                   |
| 5,109 % fällig am 25.06.2035                                         | 82             | 80                       | 0,00                              | 6,193 % fällig am 01.09.2033                                    | 811            | 812                      | 0,00                              | 2,922 % fällig am 16.04.2030             | € 27.419       | 32.198                   | 0,03                              |
| 5,364 % fällig am 25.05.2035                                         | 127            | 137                      | 0,00                              | 7,100 % fällig am 01.02.2033                                    | 28             | 28                       | 0,00                              | 2,944 % fällig am 22.06.2034             | 48.700         | 57.038                   | 0,06                              |
| 5,439 % fällig am 25.11.2035                                         | 295            | 294                      | 0,00                              | 8,060 % fällig am 01.09.2029                                    | 14.402         | 1.998                    | 0,00                              | 2,973 % fällig am 15.05.2034             | 2.000          | 2.340                    | 0,00                              |
| 5,574 % fällig am 25.02.2035                                         | 228            | 232                      | 0,00                              | Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust                  |                |                          |                                   | 3,111 % fällig am 28.10.2034             | 20.000         | 23.360                   | 0,02                              |
| 6,415 % fällig am 25.05.2031                                         | 963            | 705                      | 0,00                              | 6,630 % fällig am 15.04.2040                                    | 1.076          | 1.085                    | 0,00                              | Avoca CLO DAC                            |                |                          |                                   |
| 6,459 % fällig am 25.07.2035                                         | 1.430          | 1.553                    | 0,00                              |                                                                 |                |                          |                                   | 3,075 % fällig am 12.01.2031             | 6.078          | 7.135                    | 0,01                              |
| 7,059 % fällig am 25.11.2035                                         | 2.270          | 2.234                    | 0,00                              | FERTIGHAUS SEQUENTIELL                                          |                |                          |                                   | 3,179 % fällig am 15.07.2034             | 11.700         | 13.691                   | 0,01                              |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates |                |                          |                                   | Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust          |                |                          |                                   | 3,239 % fällig am 15.10.2034             | 35.500         | 41.626                   | 0,04                              |
| 5,259 % fällig am 25.01.2035                                         | 298            | 311                      | 0,00                              | 7,180 % fällig am 15.12.2015                                    | 980            | 69                       | 0,00                              | Avoca Static CLO DAC                     |                |                          |                                   |
| Terwin Mortgage Trust                                                |                |                          |                                   | 7,440 % fällig am 15.01.2020                                    | 10.140         | 742                      | 0,00                              | 3,249 % fällig am 15.01.2035             | 23.107         | 27.126                   | 0,03                              |
| 4,452 % fällig am 25.08.2036                                         | 1.084          | 192                      | 0,00                              | 7,575 % fällig am 15.06.2030                                    | 936            | 67                       | 0,00                              | Bain Capital Credit CLO Ltd.             |                |                          |                                   |
| 4,774 % fällig am 25.07.2037                                         | 3.473          | 3.393                    | 0,00                              | Conseco Finance Corp.                                           |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 22.04.2035 (c)         | \$ 45.000      | 45.000                   | 0,05                              |
| 5,234 % fällig am 25.09.2036                                         | 2.941          | 1.172                    | 0,00                              | 6,920 % fällig am 01.12.2030                                    | 698            | 705                      | 0,00                              | 5,269 % fällig am 23.04.2035             | 54.300         | 54.137                   | 0,05                              |
| 5,374 % fällig am 25.11.2033                                         | 5              | 5                        | 0,00                              | 7,060 % fällig am 01.02.2031                                    | 895            | 829                      | 0,00                              | 5,299 % fällig am 21.10.2034             | 49.600         | 49.363                   | 0,05                              |
| Truman Capital Mortgage Loan Trust                                   |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 01.03.2030                                    | 12.221         | 3.465                    | 0,01                              | 5,335 % fällig am 24.07.2034             | 45.500         | 45.312                   | 0,05                              |
| 5,154 % fällig am 25.03.2036                                         | 1.144          | 1.064                    | 0,00                              | 7,860 % fällig am 01.03.2030                                    | 4.514          | 1.336                    | 0,00                              | 5,359 % fällig am 21.10.2034             | 41.100         | 41.145                   | 0,04                              |
| WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust                            |                |                          |                                   | Conseco Finance Securitizations Corp.                           |                |                          |                                   | 5,469 % fällig am 20.10.2034             | 37.800         | 37.892                   | 0,04                              |
| 4,564 % fällig am 25.07.2047                                         | 3.712          | 2.153                    | 0,00                              | 7,770 % fällig am 01.09.2031                                    | 469            | 477                      | 0,00                              | 5,489 % fällig am 23.10.2034             | 36.000         | 36.025                   | 0,04                              |
| 4,604 % fällig am 25.05.2037                                         | 2.936          | 2.603                    | 0,00                              | 7,970 % fällig am 01.05.2032                                    | 1.887          | 257                      | 0,00                              | 5,491 % fällig am 16.07.2034             | 17.200         | 17.188                   | 0,02                              |
| 4,604 % fällig am 25.07.2047                                         | 315            | 236                      | 0,00                              | 8,260 % fällig am 01.12.2030                                    | 13.372         | 2.373                    | 0,00                              | 5,719 % fällig am 20.10.2034             | 1.200          | 1.201                    | 0,00                              |
| 4,624 % fällig am 25.04.2037                                         | 23.383         | 8.567                    | 0,01                              | 8,310 % fällig am 01.05.2032                                    | 20.172         | 2.868                    | 0,00                              | 5,741 % fällig am 16.07.2034             | 2.800          | 2.810                    | 0,00                              |
| 4,659 % fällig am 25.05.2037                                         | 642            | 602                      | 0,00                              | IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates |                |                          |                                   | 5,879 % fällig am 23.10.2034             | 7.600          | 7.608                    | 0,01                              |
| 4,684 % fällig am 25.05.2037                                         | 3.433          | 3.050                    | 0,00                              | 6,750 % fällig am 25.02.2028                                    | 5              | 5                        | 0,00                              | 5,911 % fällig am 16.07.2034             | 20.650         | 20.696                   | 0,02                              |
| 4,684 % fällig am 25.07.2047                                         | 3.228          | 1.873                    | 0,00                              | Oakwood Mortgage Investors, Inc.                                |                |                          |                                   | 5,919 % fällig am 20.10.2034             | 5.000          | 5.019                    | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.01.2037                                         | 17.438         | 14.995                   | 0,02                              | 5,050 % fällig am 15.11.2019                                    | 89             | 84                       | 0,00                              | Bain Capital Euro CLO DAC                |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.04.2037                                         | 740            | 271                      | 0,00                              |                                                                 |                |                          |                                   | 2,976 % fällig am 20.01.2032             | € 10.563       | 12.373                   | 0,01                              |
| Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust                    |                |                          |                                   |                                                                 |                |                          |                                   | 3,016 % fällig am 20.04.2032             | 975            | 1.146                    | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.05.2036                                         | 717            | 556                      | 0,00                              | ABS SONSTIGE                                                    |                |                          |                                   | 3,159 % fällig am 15.07.2034             | 10.000         | 11.710                   | 0,01                              |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust                |                |                          |                                   | Accunia European CLO DAC                                        |                |                          |                                   | 3,179 % fällig am 15.04.2032             | 6.995          | 8.211                    | 0,01                              |
| 4,779 % fällig am 25.01.2037                                         | 2.618          | 2.605                    | 0,00                              | 3,133 % fällig am 20.01.2031                                    | € 4.596        | 5.405                    | 0,01                              | Ballyrock CLO Ltd.                       |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.04.2037                                         | 1.381          | 1.361                    | 0,00                              | 3,243 % fällig am 20.04.2033                                    | 15.611         | 18.318                   | 0,02                              | 5,792 % fällig am 25.07.2037             | \$ 37.300      | 37.532                   | 0,04                              |
| 4,914 % fällig am 25.07.2036                                         | 2.300          | 2.270                    | 0,00                              | Adagio CLO DAC                                                  |                |                          |                                   | Barings Euro CLO DAC                     |                |                          |                                   |
| 4,944 % fällig am 25.05.2036                                         | 3.566          | 3.554                    | 0,00                              | 3,209 % fällig am 15.04.2032                                    | 26.679         | 31.282                   | 0,03                              | 3,239 % fällig am 15.10.2034             | € 5.300        | 6.186                    | 0,01                              |
| 5,034 % fällig am 25.04.2037                                         | 2.000          | 1.452                    | 0,00                              | AGL CLO Ltd.                                                    |                |                          |                                   | 3,259 % fällig am 15.10.2034             | 16.600         | 19.411                   | 0,02                              |
| 5,174 % fällig am 25.04.2034                                         | 161            | 161                      | 0,00                              | 5,399 % fällig am 02.12.2034                                    | \$ 45.300      | 45.320                   | 0,05                              | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd. |                |                          |                                   |
| 5,434 % fällig am 25.10.2034                                         | 541            | 553                      | 0,00                              | 5,658 % fällig am 20.07.2034                                    | 45.800         | 45.917                   | 0,05                              | 5,699 % fällig am 11.04.2045             | \$ 15.400      | 15.391                   | 0,02                              |
| 6,159 % fällig am 25.11.2035                                         | 1.641          | 1.641                    | 0,00                              | AlbaCore Euro CLO DAC                                           |                |                          |                                   | 5,709 % fällig am 11.04.2045             | 17.200         | 17.195                   | 0,02                              |
| 6,534 % fällig am 25.11.2035                                         | 2.472          | 2.439                    | 0,00                              | 2,965 % fällig am 15.12.2034                                    | € 3.226        | 3.791                    | 0,00                              | 5,781 % fällig am 11.04.2043             | 12.324         | 12.312                   | 0,01                              |
| 6,834 % fällig am 25.12.2034                                         | 998            | 998                      | 0,00                              | 3,269 % fällig am 15.07.2035                                    | 31.000         | 36.438                   | 0,04                              | 5,806 % fällig am 11.04.2043             | 18.394         | 18.390                   | 0,02                              |
| 6,984 % fällig am 25.04.2035                                         | 170            | 173                      | 0,00                              | 3,316 % fällig am 18.10.2034                                    | 14.400         | 16.874                   | 0,02                              | BBAM European CLO DAC                    |                |                          |                                   |
| 8,184 % fällig am 25.04.2035                                         | 357            | 380                      | 0,00                              | ALESCO Preferred Funding Ltd.                                   |                |                          |                                   | 3,106 % fällig am 22.07.2034             | € 17.000       | 19.903                   | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 4,905 % fällig am 23.09.2037                                    | \$ 6.062       | 5.592                    | 0,01                              | 3,199 % fällig am 15.01.2036             | 16.775         | 19.625                   | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 4,945 % fällig am 23.06.2036                                    | 14.930         | 14.556                   | 0,01                              | 3,299 % fällig am 15.10.2034             | 19.500         | 22.921                   | 0,02                              |
|                                                                      |                |                          |                                   | 4,965 % fällig am 23.12.2035                                    | 7.552          | 7.469                    | 0,01                              | Betony CLO Ltd.                          |                |                          |                                   |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust                              |                |                          |                                   | 4,985 % fällig am 23.09.2037                                    | 2.000          | 1.700                    | 0,00                              | 5,621 % fällig am 30.04.2031             | \$ 6.217       | 6.226                    | 0,01                              |
| 4,754 % fällig am 25.01.2037                                         | 9.907          | 5.456                    | 0,01                              | 5,035 % fällig am 23.12.2036                                    | 4.873          | 4.385                    | 0,00                              | Bilbao CLO DAC                           |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.01.2037                                         | 3.266          | 1.799                    | 0,00                              | 5,335 % fällig am 23.09.2038                                    | 6.271          | 6.004                    | 0,01                              | 3,071 % fällig am 20.08.2035             | € 20.000       | 23.389                   | 0,02                              |
| BNC Mortgage Loan Trust                                              |                |                          |                                   |                                                                 |                |                          |                                   | Black Diamond CLO DAC                    |                |                          |                                   |
| 4,684 % fällig am 25.07.2037                                         | 6.400          | 5.711                    | 0,01                              |                                                                 |                |                          |                                   | 3,123 % fällig am 15.05.2032             | 782            | 918                      | 0,00                              |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                    |                |                          |                                   |                                                                 |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| 5,989 % fällig am 25.10.2046                                         | 28             | 31                       | 0,00                              |                                                                 |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Blackrock European CLO DAC</b>                                 |                |                          |                                   | 3,141 % fällig am 20.08.2034                        | € 5.000        | \$ 5.867                 | 0,01                              | 3,186 % fällig am 20.10.2032                             | € 11.140       | \$ 13.075                | 0,01                              |
| 3,116 % fällig am 19.07.2035                                      | € 44.100       | \$ 51.540                | 0,05                              | 3,158 % fällig am 25.04.2036                        | 5.000          | 5.856                    | 0,01                              | 3,186 % fällig am 21.10.2034                             | 20.000         | 23.389                   | 0,02                              |
| 3,156 % fällig am 20.01.2036                                      | 37.000         | 43.341                   | 0,04                              | 3,391 % fällig am 23.10.2034                        | 40.643         | 47.768                   | 0,05                              | <b>Hayfin Emerald CLO DAC</b>                            |                |                          |                                   |
| 3,243 % fällig am 17.07.2034                                      | 38.250         | 44.804                   | 0,05                              | <b>CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC</b>       |                |                          |                                   | 2,899 % fällig am 27.05.2034                             | 13.564         | 15.832                   | 0,02                              |
| <b>BlueMountain EUR CLO DAC</b>                                   |                |                          |                                   | 2,983 % fällig am 15.08.2033                        | 33.358         | 39.043                   | 0,04                              | 3,079 % fällig am 15.04.2034                             | 9.750          | 11.414                   | 0,01                              |
| 3,109 % fällig am 15.04.2034                                      | 5.000          | 5.846                    | 0,01                              | <b>DB Master Finance LLC</b>                        |                |                          |                                   | 3,259 % fällig am 15.01.2035                             | 23.000         | 26.860                   | 0,03                              |
| 3,279 % fällig am 15.10.2035                                      | 1.000          | 1.170                    | 0,00                              | 2,045 % fällig am 20.11.2051                        | \$ 6.128       | 5.904                    | 0,01                              | 3,337 % fällig am 17.11.2037                             | 33.400         | 39.163                   | 0,04                              |
| <b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>                              |                |                          |                                   | 2,493 % fällig am 20.11.2051                        | 21.306         | 19.764                   | 0,02                              | 3,586 % fällig am 18.07.2038                             | 25.000         | 29.401                   | 0,03                              |
| 3,189 % fällig am 15.01.2033                                      | 3.997          | 4.688                    | 0,00                              | 2,791 % fällig am 20.11.2051                        | 1.448          | 1.266                    | 0,00                              | 3,898 % fällig am 25.01.2037                             | 22.600         | 26.565                   | 0,03                              |
| <b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>                                       |                |                          |                                   | 4,021 % fällig am 20.05.2049                        | 15.711         | 15.582                   | 0,02                              | 3,914 % fällig am 22.01.2039                             | 30.000         | 35.250                   | 0,04                              |
| 2,929 % fällig am 15.10.2031                                      | 11.640         | 13.639                   | 0,01                              | <b>Deer Park CLO DAC</b>                            |                |                          |                                   | <b>Henley CLO DAC</b>                                    |                |                          |                                   |
| 3,056 % fällig am 22.07.2032                                      | 9.988          | 11.691                   | 0,01                              | 3,289 % fällig am 15.10.2034                        | € 20.000       | 23.435                   | 0,02                              | 3,008 % fällig am 25.01.2034                             | 9.750          | 11.401                   | 0,01                              |
| <b>BNPP IP Euro CLO DAC</b>                                       |                |                          |                                   | <b>Domino's Pizza Master Issuer LLC</b>             |                |                          |                                   | 3,108 % fällig am 25.07.2034                             | 6.000          | 7.023                    | 0,01                              |
| 3,069 % fällig am 15.10.2030                                      | 15.943         | 18.699                   | 0,02                              | 2,662 % fällig am 25.04.2051                        | \$ 18.179      | 16.992                   | 0,02                              | 3,148 % fällig am 25.04.2034                             | 25.000         | 29.316                   | 0,03                              |
| <b>Bosphorus CLO DAC</b>                                          |                |                          |                                   | 3,151 % fällig am 25.04.2051                        | 7.365          | 6.648                    | 0,01                              | 3,158 % fällig am 10.06.2034                             | 12.150         | 14.227                   | 0,01                              |
| 2,899 % fällig am 25.05.2034                                      | 28.650         | 33.494                   | 0,03                              | 3,668 % fällig am 25.10.2049                        | 17.391         | 16.605                   | 0,02                              | <b>Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd.</b> |                |                          |                                   |
| 2,964 % fällig am 12.12.2032                                      | 4.505          | 5.296                    | 0,01                              | <b>Dryden CLO Ltd.</b>                              |                |                          |                                   | 5,832 % fällig am 10.10.2038                             | \$ 20.120      | 20.120                   | 0,02                              |
| <b>Cairn CLO DAC</b>                                              |                |                          |                                   | 5,501 % fällig am 18.04.2031                        | 9.644          | 9.658                    | 0,01                              | <b>Holland Park CLO DAC</b>                              |                |                          |                                   |
| 2,856 % fällig am 31.01.2030                                      | 21.452         | 25.119                   | 0,03                              | 5,538 % fällig am 15.04.2031                        | 1.469          | 1.471                    | 0,00                              | 3,059 % fällig am 14.11.2032                             | € 6.272        | 7.357                    | 0,01                              |
| 3,046 % fällig am 30.10.2030                                      | 1.609          | 1.888                    | 0,00                              | 5,568 % fällig am 15.07.2031                        | 1.306          | 1.309                    | 0,00                              | 3,789 % fällig am 14.11.2032                             | 1.500          | 1.765                    | 0,00                              |
| 3,174 % fällig am 29.10.2034                                      | 15.500         | 18.163                   | 0,02                              | 5,638 % fällig am 15.01.2031                        | 20.285         | 20.321                   | 0,02                              | <b>ICG Euro CLO DAC</b>                                  |                |                          |                                   |
| 3,269 % fällig am 15.07.2034                                      | 33.000         | 38.669                   | 0,04                              | <b>Dryden Euro CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   | 2,150 % fällig am 15.10.2034                             | 6.000          | 6.639                    | 0,01                              |
| 3,729 % fällig am 15.10.2031                                      | 700            | 823                      | 0,00                              | 1,950 % fällig am 18.10.2034                        | € 1.000        | 1.081                    | 0,00                              | <b>Indigo Credit Management DAC</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Camber PLC</b>                                                 |                |                          |                                   | 2,893 % fällig am 15.05.2032                        | 10.498         | 12.309                   | 0,01                              | 3,479 % fällig am 15.07.2038                             | 30.000         | 35.281                   | 0,04                              |
| 5,785 % fällig am 09.11.2053                                      | \$ 33.130      | 3                        | 0,00                              | 2,939 % fällig am 15.04.2033                        | 3.094          | 3.630                    | 0,00                              | <b>Invesco Euro CLO DAC</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Canyon Capital CLO Ltd.</b>                                    |                |                          |                                   | 3,029 % fällig am 15.07.2032                        | 2.699          | 3.173                    | 0,00                              | 3,219 % fällig am 15.07.2034                             | 40.000         | 46.684                   | 0,05                              |
| 5,266 % fällig am 15.10.2034                                      | 38.100         | 38.144                   | 0,04                              | 3,086 % fällig am 20.07.2034                        | 20.000         | 23.386                   | 0,02                              | 3,269 % fällig am 15.01.2035                             | 13.131         | 15.380                   | 0,02                              |
| <b>Capital Four CLO DAC</b>                                       |                |                          |                                   | 3,159 % fällig am 15.04.2034                        | 7.100          | 8.304                    | 0,01                              | 3,296 % fällig am 30.10.2038                             | 29.100         | 34.095                   | 0,03                              |
| 3,299 % fällig am 15.10.2034                                      | € 6.000        | 7.035                    | 0,01                              | 3,216 % fällig am 18.10.2034                        | 10.000         | 11.686                   | 0,01                              | 3,299 % fällig am 15.01.2034                             | 18.300         | 21.440                   | 0,02                              |
| <b>Carbone CLO Ltd.</b>                                           |                |                          |                                   | 3,219 % fällig am 15.01.2034                        | 69.970         | 82.051                   | 0,08                              | <b>Jubilee CLO DAC</b>                                   |                |                          |                                   |
| 5,671 % fällig am 20.01.2031                                      | \$ 1.682       | 1.684                    | 0,00                              | 3,229 % fällig am 15.04.2035                        | 18.000         | 21.072                   | 0,02                              | 3,239 % fällig am 15.10.2035                             | 15.000         | 17.570                   | 0,02                              |
| <b>Carlyle Euro CLO DAC</b>                                       |                |                          |                                   | 3,236 % fällig am 18.04.2033                        | 34.128         | 40.035                   | 0,04                              | <b>KKR CLO Ltd.</b>                                      |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 15.08.2038 (c)                                  | € 34.900       | 40.967                   | 0,04                              | 3,236 % fällig am 18.10.2034                        | 11.000         | 12.876                   | 0,01                              | 5,698 % fällig am 15.01.2031                             | \$ 715         | 716                      | 0,00                              |
| 3,089 % fällig am 15.01.2034                                      | 3.000          | 3.506                    | 0,00                              | 3,243 % fällig am 17.01.2033                        | 10.844         | 12.714                   | 0,01                              | <b>Latitude Australia Personal Loans Series</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.</b>                  |                |                          |                                   | 3,289 % fällig am 15.10.2032                        | 12.245         | 14.364                   | 0,01                              | 4,721 % fällig am 17.09.2033                             | AUD 16.159     | 10.589                   | 0,01                              |
| 5,511 % fällig am 17.04.2031                                      | \$ 3.205       | 3.206                    | 0,00                              | <b>Dryden Senior Loan Fund</b>                      |                |                          |                                   | <b>LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd.</b>      |                |                          |                                   |
| 5,594 % fällig am 27.07.2031                                      | 3.189          | 3.194                    | 0,00                              | 5,488 % fällig am 15.04.2031                        | \$ 7.766       | 7.769                    | 0,01                              | 5,602 % fällig am 16.07.2031                             | \$ 3.128       | 3.130                    | 0,00                              |
| 5,638 % fällig am 15.05.2031                                      | 8.677          | 8.684                    | 0,01                              | <b>Euro-Galaxy CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   | <b>LCM LP</b>                                            |                |                          |                                   |
| 5,658 % fällig am 15.07.2031                                      | 9.051          | 9.073                    | 0,01                              | 2,811 % fällig am 24.04.2034                        | € 8.794        | 10.301                   | 0,01                              | 5,551 % fällig am 20.04.2031                             | 5.107          | 5.113                    | 0,01                              |
| <b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC</b>              |                |                          |                                   | 3,086 % fällig am 30.07.2034                        | 7.000          | 8.188                    | 0,01                              | 5,648 % fällig am 15.10.2031                             | 14.358         | 14.374                   | 0,01                              |
| 3,078 % fällig am 10.11.2035                                      | € 16.300       | 19.075                   | 0,02                              | 3,093 % fällig am 15.02.2034                        | 19.994         | 23.406                   | 0,02                              | <b>Lyra Music Assets Delaware LP</b>                     |                |                          |                                   |
| 3,109 % fällig am 15.04.2034                                      | 16.200         | 18.952                   | 0,02                              | <b>FAB CBO BV</b>                                   |                |                          |                                   | 5,760 % fällig am 22.12.2064                             | 93.865         | 94.398                   | 0,10                              |
| 3,212 % fällig am 16.01.2033                                      | 34.854         | 40.949                   | 0,04                              | 3,484 % fällig am 20.08.2080                        | 179            | 207                      | 0,00                              | <b>Madison Park Euro Funding DAC</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Castlelake Aircraft Structured Trust</b>                       |                |                          |                                   | <b>Fair Oaks Loan Funding DAC</b>                   |                |                          |                                   | 2,898 % fällig am 25.10.2030                             | € 2.617        | 3.056                    | 0,00                              |
| 5,783 % fällig am 15.02.2050                                      | \$ 27.159      | 27.577                   | 0,03                              | 3,129 % fällig am 15.04.2034                        | 11.720         | 13.721                   | 0,01                              | 3,029 % fällig am 15.01.2032                             | 19.605         | 22.945                   | 0,02                              |
| <b>CBAM Ltd.</b>                                                  |                |                          |                                   | 3,159 % fällig am 15.04.2034                        | 20.000         | 23.430                   | 0,02                              | 3,099 % fällig am 15.04.2032                             | 16.216         | 18.992                   | 0,02                              |
| 5,561 % fällig am 17.04.2031                                      | 5.911          | 5.922                    | 0,01                              | 3,249 % fällig am 15.01.2035                        | 20.000         | 23.457                   | 0,02                              | 3,111 % fällig am 27.07.2034                             | 33.009         | 38.737                   | 0,04                              |
| <b>CIFC European Funding CLO DAC</b>                              |                |                          |                                   | 3,279 % fällig am 15.10.2034                        | 32.450         | 38.034                   | 0,04                              | 3,159 % fällig am 15.07.2035                             | 19.270         | 22.588                   | 0,02                              |
| 3,179 % fällig am 15.04.2033                                      | € 9.740        | 11.432                   | 0,01                              | <b>FACT Ponant</b>                                  |                |                          |                                   | <b>Man Euro CLO DAC</b>                                  |                |                          |                                   |
| 3,186 % fällig am 18.08.2035                                      | 32.392         | 37.953                   | 0,04                              | 2,564 % fällig am 27.09.2038                        | 19.103         | 22.454                   | 0,02                              | 4,029 % fällig am 15.10.2036                             | 22.120         | 26.037                   | 0,03                              |
| 3,269 % fällig am 23.11.2034                                      | 31.000         | 36.372                   | 0,04                              | <b>FTA Consumo Santander</b>                        |                |                          |                                   | <b>MAPS Ltd.</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>CIFC Funding Ltd.</b>                                          |                |                          |                                   | 3,563 % fällig am 20.07.2038                        | 5.351          | 6.308                    | 0,01                              | 4,212 % fällig am 15.05.2043                             | \$ 4.662       | 4.655                    | 0,00                              |
| 5,644 % fällig am 22.01.2031                                      | \$ 5.488       | 5.493                    | 0,01                              | 3,913 % fällig am 20.07.2038                        | 4.488          | 5.291                    | 0,01                              | <b>Marzio Finance SRL</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>Clarinda Park CLO DAC</b>                                      |                |                          |                                   | <b>Galaxy CLO Ltd.</b>                              |                |                          |                                   | 2,649 % fällig am 30.06.2050                             | € 39.537       | 46.482                   | 0,05                              |
| 3,043 % fällig am 15.02.2034                                      | € 24.200       | 28.402                   | 0,03                              | 5,531 % fällig am 20.04.2031                        | \$ 451         | 452                      | 0,00                              | 2,759 % fällig am 28.09.2049                             | 36.742         | 43.300                   | 0,04                              |
| <b>Commonbond Student Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   | 5,551 % fällig am 20.04.2031                        | 3.441          | 3.441                    | 0,00                              | 2,809 % fällig am 28.05.2049                             | 6.435          | 7.595                    | 0,01                              |
| 2,550 % fällig am 25.05.2041                                      | \$ 1.151       | 1.098                    | 0,00                              | <b>GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos</b> |                |                          |                                   | <b>METAL Ltd.</b>                                        |                |                          |                                   |
| 5,284 % fällig am 25.05.2041                                      | 59             | 59                       | 0,00                              | 2,948 % fällig am 25.02.2034                        | € 28.006       | 32.990                   | 0,03                              | 4,581 % fällig am 15.10.2042                             | \$ 22.189      | 14.756                   | 0,02                              |
| <b>Concord Music Royalties LLC</b>                                |                |                          |                                   | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>                |                |                          |                                   | <b>Mila BV</b>                                           |                |                          |                                   |
| 5,644 % fällig am 20.10.2074                                      | 34.800         | 34.965                   | 0,04                              | 2,866 % fällig am 22.09.2043                        | 42.804         | 50.474                   | 0,05                              | 2,778 % fällig am 16.09.2041                             | € 23.000       | 27.054                   | 0,03                              |
| <b>Contego CLO DAC</b>                                            |                |                          |                                   | <b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b>       |                |                          |                                   | <b>MMcaps Funding Ltd.</b>                               |                |                          |                                   |
| 3,069 % fällig am 15.04.2034                                      | € 20.000       | 23.374                   | 0,02                              | 3,256 % fällig am 20.07.2034                        | 12.000         | 14.087                   | 0,01                              | 4,941 % fällig am 01.12.2035                             | \$ 321         | 321                      | 0,00                              |
| 3,141 % fällig am 24.01.2034                                      | 11.067         | 12.975                   | 0,01                              | <b>Goldentree Loan Management US, CLO Ltd.</b>      |                |                          |                                   | <b>Montmartre Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization CBO Ltd.</b> |                |                          |                                   | 5,419 % fällig am 20.10.2034                        | \$ 21.000      | 21.015                   | 0,02                              | 3,239 % fällig am 15.07.2034                             | € 1.200        | 1.410                    | 0,00                              |
| 7,770 % fällig am 16.02.2041                                      | \$ 54.641      | 914                      | 0,00                              | <b>Golub Capital Partners CLO Ltd.</b>              |                |                          |                                   | <b>Nassau Euro CLO DAC</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>Crosthwaite Park CLO DAC</b>                                   |                |                          |                                   | 5,592 % fällig am 25.10.2034                        | 33.600         | 33.637                   | 0,03                              | 3,025 % fällig am 15.12.2034                             | 20.000         | 23.442                   | 0,02                              |
| 2,825 % fällig am 15.03.2034                                      | € 4.407        | 5.174                    | 0,01                              | <b>Goodgreen Trust</b>                              |                |                          |                                   | <b>Nassau Ltd.</b>                                       |                |                          |                                   |
| <b>Cumulus Static CLO DAC</b>                                     |                |                          |                                   | 3,930 % fällig am 15.10.2053                        | 8.744          | 8.106                    | 0,01                              | 5,668 % fällig am 15.07.2031                             | \$ 9.292       | 9.301                    | 0,01                              |
| 3,343 % fällig am 15.11.2033                                      | 21.932         | 25.810                   | 0,03                              | <b>Greenwood Park CLO Ltd.</b>                      |                |                          |                                   | <b>National Collegiate Student Loan Trust</b>            |                |                          |                                   |
| <b>CVC Cordatus Loan Fund DAC</b>                                 |                |                          |                                   | 5,528 % fällig am 15.04.2031                        | 788            | 789                      | 0,00                              | 4,744 % fällig am 25.05.2032                             | 2.046          | 2.038                    | 0,00                              |
| 2,824 % fällig am 22.06.2034                                      | 5.000          | 5.842                    | 0,01                              | <b>Griffith Park CLO DAC</b>                        |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 27.10.2031                             | 547            | 548                      | 0,00                              |
| 2,886 % fällig am 21.07.2030                                      | 14.684         | 17.267                   | 0,02                              | 2,795 % fällig am 21.11.2031                        | € 6.592        | 7.720                    | 0,01                              | 4,784 % fällig am 25.03.2033                             | 3.397          | 3.355                    | 0,00                              |
| 2,910 % fällig am 22.05.2032                                      | 17.584         | 20.649                   | 0,02                              | <b>Grosvenor Place CLO DAC</b>                      |                |                          |                                   | 4,804 % fällig am 25.06.2033                             | 953            | 938                      | 0,00                              |
| 3,067 % fällig am 18.11.2033                                      | 16.000         | 18.753                   | 0,02                              | 0,000 % fällig am 15.01.2039                        | 31.600         | 37.070                   | 0,04                              | <b>Navient Private Education Loan Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 3,074 % fällig am 23.12.2033                                      | 33.430         | 39.296                   | 0,04                              | <b>Harvest CLO DAC</b>                              |                |                          |                                   | 4,100 % fällig am 16.12.2058                             | 1.818          | 1.800                    | 0,00                              |
| 3,129 % fällig am 15.07.2034                                      | 11.032         | 12.914                   | 0,01                              | 2,997 % fällig am 18.11.2030                        | 3.315          | 3.892                    | 0,00                              | 5,876 % fällig am 16.07.2040                             | 5.879          | 5.908                    | 0,01                              |
| 3,134 % fällig am 29.07.2034                                      | 11.000         | 12.865                   | 0,01                              | 3,129 % fällig am 15.01.2032                        | 28.093         | 32.961                   | 0,03                              | 6,576 % fällig am 15.12.2045                             | 1.377          | 1.382                    | 0,00                              |



| BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | % DES                    |                          | BESCHREIBUNG | PARI<br>(000S) | % DES                    |                          | BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000S) | % DES                    |                          |      |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|--------------|----------------|--------------------------|--------------------------|----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|------|
|                                                                         |                | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |              |                | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                                                                            |                | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |      |
| Nelnet Student Loan Trust<br>4,874 % fällig am 27.09.2066               | \$             | 2.829                    | 2.830                    | 0,00         |                |                          |                          | Voya Euro CLO DAC<br>3,199 % fällig am 15.04.2033                          | €              | 5.729                    | 6.720                    | 0,01 |
| Neuberger Berman Loan Advisers<br>3,078 % fällig am 25.10.2034          | €              | 15.825                   | 18.481                   | 0,02         |                |                          |                          | 3,239 % fällig am 15.07.2035                                               | 28.837         | 33.824                   | 0,03                     |      |
| North Westerly ESG CLO DAC<br>3,071 % fällig am 05.07.2032              |                | 9.335                    | 10.952                   | 0,01         |                |                          |                          | 3,249 % fällig am 15.10.2034                                               | 20.000         | 23.459                   | 0,02                     |      |
| Ocean Trails CLO<br>5,299 % fällig am 20.07.2034                        | \$             | 39.000                   | 39.006                   | 0,04         |                |                          |                          | 3,319 % fällig am 15.04.2035                                               | 4.000          | 4.702                    | 0,00                     |      |
| 5,566 % fällig am 15.10.2034                                            |                | 1.000                    | 1.001                    | 0,00         |                |                          |                          | Whitehouse Ltd.<br>5,768 % fällig am 15.10.2031                            | \$             | 4.351                    | 4.357                    | 0,00 |
| OCP Euro CLO DAC<br>3,116 % fällig am 22.09.2034                        | €              | 518                      | 609                      | 0,00         |                |                          |                          | Wind River CLO Ltd.<br>5,581 % fällig am 18.07.2031                        | 534            | 535                      | 0,00                     |      |
| 3,156 % fällig am 24.04.2035                                            |                | 35.000                   | 40.895                   | 0,04         |                |                          |                          | Wingstop Funding LLC<br>5,858 % fällig am 05.12.2054                       | 25.000         | 25.520                   | 0,03                     |      |
| 3,279 % fällig am 15.07.2032                                            |                | 4.433                    | 5.202                    | 0,01         |                |                          |                          |                                                                            |                | 6.100.167                | 6,16                     |      |
| OZLM Ltd.<br>5,581 % fällig am 20.04.2031                               | \$             | 168                      | 168                      | 0,00         |                |                          |                          | SICHERHEITEN WHOLE LOANS                                                   |                |                          |                          |      |
| Palmer Square BDC CLO Ltd.<br>5,856 % fällig am 15.07.2037              |                | 36.800                   | 36.938                   | 0,04         |                |                          |                          | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>4,934 % fällig am 25.05.2037 |                |                          |                          |      |
| Palmer Square European CLO DAC<br>1,970 % fällig am 15.04.2035          | €              | 6.000                    | 6.585                    | 0,01         |                |                          |                          | 5,199 % fällig am 25.07.2036                                               | 6              | 6                        | 0,00                     |      |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,113 % fällig am 15.05.2033 |                | 20.702                   | 24.327                   | 0,02         |                |                          |                          | 5,634 % fällig am 25.06.2036                                               | 616            | 631                      | 0,00                     |      |
| 3,113 % fällig am 15.08.2033                                            |                | 30.521                   | 35.829                   | 0,04         |                |                          |                          | 6,276 % fällig am 25.10.2036                                               | 62             | 62                       | 0,00                     |      |
| 3,133 % fällig am 15.05.2034                                            |                | 39.786                   | 46.671                   | 0,05         |                |                          |                          | 6,384 % fällig am 25.11.2039                                               | 481            | 530                      | 0,00                     |      |
| 3,143 % fällig am 15.05.2034                                            |                | 27.049                   | 31.726                   | 0,03         |                |                          |                          | 6,500 % fällig am 25.10.2036                                               | 2.305          | 809                      | 0,00                     |      |
| 3,170 % fällig am 15.10.2034                                            |                | 49.900                   | 58.414                   | 0,06         |                |                          |                          | 7,584 % fällig am 25.12.2042                                               | 1.127          | 1.337                    | 0,00                     |      |
| 3,259 % fällig am 15.01.2033                                            |                | 12.576                   | 14.773                   | 0,02         |                |                          |                          | Citigroup Mortgage Loan Trust Inc.<br>4,834 % fällig am 25.11.2046         | 2.806          | 2.761                    | 0,00                     |      |
| 3,843 % fällig am 15.08.2033                                            |                | 12.200                   | 14.359                   | 0,01         |                |                          |                          | 4,854 % fällig am 25.01.2037                                               | 1.758          | 1.751                    | 0,00                     |      |
| 3,870 % fällig am 15.10.2034                                            |                | 5.000                    | 5.883                    | 0,01         |                |                          |                          | 4,869 % fällig am 25.11.2036                                               | 2.854          | 2.837                    | 0,00                     |      |
| 3,993 % fällig am 15.05.2034                                            |                | 6.350                    | 7.477                    | 0,01         |                |                          |                          | 4,884 % fällig am 25.10.2036                                               | 845            | 845                      | 0,00                     |      |
| 4,033 % fällig am 15.05.2034                                            |                | 35.600                   | 41.877                   | 0,04         |                |                          |                          | 4,884 % fällig am 25.01.2037                                               | 434            | 421                      | 0,00                     |      |
| 4,179 % fällig am 15.01.2033                                            |                | 1.700                    | 1.999                    | 0,00         |                |                          |                          | 4,899 % fällig am 25.08.2036                                               | 2.116          | 1.880                    | 0,00                     |      |
| Penta CLO DAC<br>3,128 % fällig am 25.07.2034                           |                | 17.500                   | 20.531                   | 0,02         |                |                          |                          | 4,914 % fällig am 25.11.2036                                               | 975            | 914                      | 0,00                     |      |
| Pepper Iberia Consumer<br>2,789 % fällig am 25.04.2037                  |                | 19.400                   | 22.751                   | 0,02         |                |                          |                          | 4,929 % fällig am 25.10.2036                                               | 400            | 393                      | 0,00                     |      |
| Pikes Peak CLO<br>5,466 % fällig am 15.07.2034                          | \$             | 25.000                   | 25.018                   | 0,03         |                |                          |                          | 5,109 % fällig am 25.03.2037                                               | 4.534          | 4.541                    | 0,01                     |      |
| 5,489 % fällig am 11.10.2034                                            |                | 25.000                   | 25.024                   | 0,03         |                |                          |                          | 5,214 % fällig am 25.01.2036                                               | 85             | 87                       | 0,00                     |      |
| PK ALIFT Loan Funding LP<br>5,052 % fällig am 15.10.2039                |                | 26.676                   | 26.626                   | 0,03         |                |                          |                          | 5,830 % fällig am 25.11.2034                                               | 173            | 173                      | 0,00                     |      |
| Plenti PL & Green ABS Trust<br>4,935 % fällig am 11.04.2036             | AUD            | 16.171                   | 10.617                   | 0,01         |                |                          |                          | 6,352 % fällig am 25.05.2036                                               | 948            | 343                      | 0,00                     |      |
| Project Silver<br>3,967 % fällig am 15.07.2044                          | \$             | 14.062                   | 13.580                   | 0,01         |                |                          |                          | 6,851 % fällig am 25.05.2036                                               | 478            | 172                      | 0,00                     |      |
| Providus CLO DAC<br>3,056 % fällig am 20.04.2034                        | €              | 2.314                    | 2.711                    | 0,00         |                |                          |                          | 7,250 % fällig am 25.05.2036                                               | 10.267         | 5.093                    | 0,01                     |      |
| 3,071 % fällig am 20.05.2034                                            |                | 20.000                   | 23.333                   | 0,02         |                |                          |                          | First Franklin Mortgage Loan Trust<br>4,549 % fällig am 25.07.2036         | 819            | 803                      | 0,00                     |      |
| 3,186 % fällig am 18.07.2034                                            |                | 5.500                    | 6.447                    | 0,01         |                |                          |                          | 4,554 % fällig am 25.11.2036                                               | 5.712          | 5.490                    | 0,01                     |      |
| 3,439 % fällig am 15.10.2038                                            |                | 25.000                   | 29.387                   | 0,03         |                |                          |                          | 4,554 % fällig am 25.12.2036                                               | 6.407          | 6.176                    | 0,01                     |      |
| Raptor Aircraft Finance LLC<br>4,213 % fällig am 23.08.2044             | \$             | 41.117                   | 37.262                   | 0,04         |                |                          |                          | 4,594 % fällig am 25.10.2036                                               | 1.196          | 1.192                    | 0,00                     |      |
| Rockford Tower CLO Ltd.<br>5,684 % fällig am 20.05.2031                 |                | 4.130                    | 4.139                    | 0,00         |                |                          |                          | 4,594 % fällig am 25.11.2036                                               | 1.548          | 1.558                    | 0,00                     |      |
| 5,691 % fällig am 20.10.2031                                            |                | 4.743                    | 4.757                    | 0,00         |                |                          |                          | 4,634 % fällig am 25.03.2037                                               | 7.643          | 3.611                    | 0,01                     |      |
| Rockford Tower Europe CLO DAC<br>3,036 % fällig am 20.04.2034           | €              | 3.623                    | 4.235                    | 0,00         |                |                          |                          | 4,654 % fällig am 25.12.2037                                               | 398            | 384                      | 0,00                     |      |
| 3,561 % fällig am 24.04.2037                                            |                | 42.400                   | 49.797                   | 0,05         |                |                          |                          | 4,714 % fällig am 25.12.2036                                               | 12.540         | 5.085                    | 0,01                     |      |
| Romark Ltd.<br>5,561 % fällig am 20.04.2031                             | \$             | 12.713                   | 12.727                   | 0,01         |                |                          |                          | 4,734 % fällig am 25.08.2036                                               | 879            | 852                      | 0,00                     |      |
| RRE Loan Management DAC<br>3,149 % fällig am 15.04.2035                 | €              | 28.000                   | 32.879                   | 0,03         |                |                          |                          | 4,734 % fällig am 25.03.2037                                               | 580            | 275                      | 0,00                     |      |
| 3,229 % fällig am 15.01.2037                                            |                | 15.000                   | 17.583                   | 0,02         |                |                          |                          | 4,744 % fällig am 25.07.2036                                               | 3.080          | 3.008                    | 0,00                     |      |
| Sabadell Consumo FT<br>2,699 % fällig am 22.10.2035                     |                | 51.008                   | 60.030                   | 0,06         |                |                          |                          | 4,744 % fällig am 25.09.2036                                               | 4.643          | 4.314                    | 0,01                     |      |
| Sapphire Aviation Finance Ltd.<br>4,250 % fällig am 15.03.2040          | \$             | 861                      | 861                      | 0,00         |                |                          |                          | 4,754 % fällig am 25.04.2036                                               | 4.664          | 4.568                    | 0,01                     |      |
| Saranac CLO Ltd.<br>6,454 % fällig am 22.06.2030                        |                | 537                      |                          | 0,00         |                |                          |                          | 4,754 % fällig am 25.06.2036                                               | 4.402          | 4.360                    | 0,01                     |      |
| SC Germany S.A. Compartment Consumer<br>2,564 % fällig am 14.01.2038    | €              | 15.945                   | 18.756                   | 0,02         |                |                          |                          | 4,754 % fällig am 25.12.2037                                               | 6.866          | 6.284                    | 0,01                     |      |
| 2,592 % fällig am 14.05.2038                                            |                | 47.344                   | 55.734                   | 0,06         |                |                          |                          | 4,854 % fällig am 25.12.2037                                               | 10.141         | 9.281                    | 0,01                     |      |
| Sculptor European CLO DAC<br>3,026 % fällig am 18.04.2034               |                | 14.000                   | 16.393                   | 0,02         |                |                          |                          | 4,914 % fällig am 25.08.2036                                               | 5.737          | 5.584                    | 0,01                     |      |
| 3,055 % fällig am 14.01.2032                                            |                | 15.398                   | 18.055                   | 0,02         |                |                          |                          | 4,914 % fällig am 25.10.2036                                               | 12.218         | 7.991                    | 0,01                     |      |
| 3,129 % fällig am 15.04.2034                                            |                | 10.900                   | 12.742                   | 0,01         |                |                          |                          | 5,034 % fällig am 25.02.2036                                               | 3.389          | 3.175                    | 0,00                     |      |
| 3,329 % fällig am 15.10.2034                                            |                | 31.950                   | 37.425                   | 0,04         |                |                          |                          | 5,109 % fällig am 25.11.2035                                               | 739            | 732                      | 0,00                     |      |
| 3,361 % fällig am 27.04.2038                                            |                | 25.000                   | 29.390                   | 0,03         |                |                          |                          | 5,124 % fällig am 25.01.2036                                               | 3.122          | 2.920                    | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,154 % fällig am 25.08.2034                                               | 689            | 645                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,154 % fällig am 25.11.2035                                               | 2.038          | 1.911                    | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,184 % fällig am 25.12.2035                                               | 3.220          | 3.141                    | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,244 % fällig am 25.10.2035                                               | 2.914          | 3.344                    | 0,01                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,334 % fällig am 25.07.2035                                               | 768            | 764                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,379 % fällig am 25.06.2034                                               | 636            | 624                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,379 % fällig am 25.03.2035                                               | 324            | 342                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,379 % fällig am 25.09.2035                                               | 4.053          | 3.737                    | 0,01                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,709 % fällig am 25.07.2034                                               | 712            | 707                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,859 % fällig am 25.10.2034                                               | 280            | 281                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 6,234 % fällig am 25.09.2034                                               | 1.213          | 1.311                    | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | GSAMP Trust<br>3,610 % fällig am 25.11.2034                                | 899            | 864                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 5,484 % fällig am 25.06.2034                                               | 654            | 653                      | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | Household Capital RMBS<br>0,000 % fällig am 21.07.2087                     | AUD 22.500     | 14.751                   | 0,02                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | Lehman XS Trust<br>4,634 % fällig am 25.02.2037                            | \$ 9.174       | 8.242                    | 0,01                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 4,744 % fällig am 25.03.2037                                               | 1.681          | 1.564                    | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 4,754 % fällig am 25.05.2036                                               | 2.720          | 2.353                    | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 4,774 % fällig am 25.10.2036                                               | 1.453          | 1.310                    | 0,00                     |      |
|                                                                         |                |                          |                          |              |                |                          |                          | 4,774 % fällig am 25.12.2036                                               | 3.072          | 2.975                    | 0,00                     |      |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,794 % fällig am 25.06.2036                       | \$ 3           |                          | 0,00                              | Korea Development Bank                           |                |                          |                                   | 49,053 % fällig am 20.05.2026           | TRY 37.500     | \$ 947                   | 0,00                              |
| 4,854 % fällig am 25.06.2046                       | 3.410          | 3.212                    | 0,00                              | 4,000 % fällig am 08.09.2025                     | \$ 28.000      | \$ 27.974                | 0,03                              | 49,053 % fällig am 19.08.2026           | 27.100         | 684                      | 0,00                              |
| 4,894 % fällig am 25.02.2037                       | 2.584          | 2.069                    | 0,00                              | Korea National Oil Corp.                         |                |                          |                                   | 49,053 % fällig am 17.05.2028           | 6.207.700      | 151.318                  | 0,15                              |
| 4,954 % fällig am 25.05.2046                       | 1.367          | 1.224                    | 0,00                              | 4,125 % fällig am 30.09.2027                     | 24.100         | 24.007                   | 0,02                              | Türkiye İhracat Kredi Bankası A/S       |                |                          |                                   |
| 4,954 % fällig am 25.02.2047                       | 1.707          | 1.519                    | 0,00                              | Magyar Export-Import Bank                        |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 03.07.2028            | \$ 18.400      | 18.437                   | 0,02                              |
| 4,984 % fällig am 25.01.2036                       | 1.726          | 1.542                    | 0,00                              | 4,500 % fällig am 27.11.2031                     | € 89.000       | 106.252                  | 0,11                              | Ukraine Government International Bond   |                |                          |                                   |
| 5,014 % fällig am 25.09.2036                       | 2.721          | 2.707                    | 0,00                              | Mexico Government International Bond             |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 01.02.2030            | 547            | 264                      | 0,00                              |
| 6,260 % fällig am 25.11.2035                       | 2.461          | 1.072                    | 0,00                              | 2,750 % fällig am                                |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 01.02.2034            | 2.044          | 793                      | 0,00                              |
| 6,390 % fällig am 25.04.2036                       | 12             | 16                       | 0,00                              | 27.11.2031 (h)                                   | MXN 6.979.705  | 327.435                  | 0,33                              | 0,000 % fällig am 01.02.2035            | 1.727          | 820                      | 0,00                              |
| 6,734 % fällig am 25.12.2037                       | 741            | 722                      | 0,00                              | 3,000 % fällig am                                |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 01.02.2036            | 1.439          | 680                      | 0,00                              |
| RAAC Trust                                         |                |                          |                                   | 03.12.2026 (h)                                   | 898.965        | 46.606                   | 0,05                              | 1,750 % fällig am 01.02.2034            | 2.537          | 1.319                    | 0,00                              |
| 5,034 % fällig am 25.06.2044                       | 859            | 784                      | 0,00                              | 4,000 % fällig am                                |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 01.02.2035            | 3.538          | 1.815                    | 0,00                              |
| 5,294 % fällig am 25.03.2037                       | 0              | 0                        | 0,00                              | 30.11.2028 (h)                                   | 3.252.509      | 168.792                  | 0,17                              | 1,750 % fällig am 01.02.2036            | 3.936          | 1.969                    | 0,00                              |
| 5,734 % fällig am 25.06.2047                       | 2.055          | 2.009                    | 0,00                              | 4,000 % fällig am                                |                |                          |                                   | Venezuela Government International Bond |                |                          |                                   |
| Residential Asset Mortgage Products Trust          |                |                          |                                   | 24.08.2034 (h)                                   | 4.024.046      | 198.180                  | 0,20                              | 6,000 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 4,784 % fällig am 25.10.2036                       | 3.057          | 2.985                    | 0,00                              | 4,625 % fällig am 04.05.2033                     | € 66.200       | 77.685                   | 0,08                              | 09.12.2020 ^                            | 9.289          | 1.301                    | 0,00                              |
| 5,214 % fällig am 25.07.2035                       | 26             | 26                       | 0,00                              | 5,850 % fällig am                                |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.09.2035                       | 923            | 893                      | 0,00                              | 02.07.2032 (c)                                   | \$ 29.400      | 29.790                   | 0,03                              | 31.03.2038 ^                            | 14.228         | 2.513                    | 0,00                              |
| 5,409 % fällig am 25.07.2035                       | 1.106          | 1.060                    | 0,00                              | 7,500 % fällig am 26.05.2033                     | MXN 236.300    | 11.459                   | 0,01                              | 7,650 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am 25.05.2035                       | 271            | 276                      | 0,00                              | 7,750 % fällig am 29.05.2031                     | 3.844.000      | 194.200                  | 0,20                              | 21.04.2025 ^                            | 28.167         | 4.580                    | 0,00                              |
| 5,559 % fällig am 25.06.2035                       | 2.300          | 2.245                    | 0,00                              | 7,750 % fällig am 23.11.2034                     | 3.012.590      | 145.906                  | 0,15                              | 7,750 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 5,589 % fällig am 25.02.2035                       | 1.147          | 1.141                    | 0,00                              | 8,500 % fällig am 01.03.2029                     | 3.207.000      | 169.527                  | 0,17                              | 13.10.2019 ^                            | 5.850          | 871                      | 0,00                              |
| 5,634 % fällig am 25.01.2035                       | 1.924          | 1.832                    | 0,00                              | 8,500 % fällig am 31.05.2029                     | 1.375.000      | 72.653                   | 0,07                              | 8,250 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust     |                |                          |                                   | Peru Government International Bond               |                |                          |                                   | 13.10.2024 ^                            | 35.331         | 5.812                    | 0,01                              |
| 4,594 % fällig am 25.08.2036                       | 2.637          | 859                      | 0,00                              | 5,350 % fällig am 12.08.2040                     | PEN 12.700     | 3.077                    | 0,00                              | 9,000 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.05.2036                       | 6.767          | 3.489                    | 0,01                              | 5,400 % fällig am 12.08.2034                     | 102.521        | 27.349                   | 0,03                              | 07.05.2023 ^                            | 13.516         | 2.178                    | 0,00                              |
| 4,714 % fällig am 25.09.2036                       | 3.264          | 3.012                    | 0,00                              | 5,940 % fällig am 12.02.2029                     | 13.761         | 4.071                    | 0,00                              | 9,250 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.03.2036                       | 2.428          | 1.518                    | 0,00                              | 6,150 % fällig am 12.08.2032                     | 1.247.840      | 363.753                  | 0,37                              | 15.09.2027 ^                            | 34.519         | 7.033                    | 0,01                              |
| 4,754 % fällig am 25.09.2036                       | 1.440          | 1.015                    | 0,00                              | 6,900 % fällig am 12.08.2037                     | 240.317        | 69.027                   | 0,07                              | 9,250 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.10.2036                       | 1.017          | 338                      | 0,00                              | 6,950 % fällig am 12.08.2031                     | 958.139        | 293.603                  | 0,30                              | 07.05.2028 ^                            | 39.817         | 7.059                    | 0,01                              |
| 4,774 % fällig am 25.08.2036                       | 11.664         | 3.798                    | 0,01                              | 7,300 % fällig am 12.08.2033                     | 882.000        | 271.222                  | 0,27                              | 11,750 % fällig am                      |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.11.2035                       | 3.035          | 2.548                    | 0,00                              | 7,600 % fällig am 12.08.2039                     | 331.200        | 99.579                   | 0,10                              | 21.10.2026 ^                            | 3.990          | 806                      | 0,00                              |
| 5,394 % fällig am 25.01.2036                       | 470            | 445                      | 0,00                              | Poland Government International Bond             |                |                          |                                   | 23.08.2022 ^                            | 6.170          | 1.121                    | 0,00                              |
| Specialty Underwriting & Residential Finance Trust |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 12.02.2030                     | \$ 87.700      | 89.520                   | 0,09                              |                                         | 7.801.276      | 7,88                     |                                   |
| 4,554 % fällig am 25.04.2037                       | 684            | 502                      | 0,00                              | Republic of Greece Government International Bond |                |                          |                                   | AKTIEN                                  |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.04.2037                       | 2.575          | 1.893                    | 0,00                              | 3,750 % fällig am 30.01.2028                     | € 4.618        | 5.643                    | 0,01                              | STAMMAKTIONEN                           |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.09.2037                       | 3.017          | 1.032                    | 0,00                              | 3,900 % fällig am 30.01.2033                     | 9.948          | 12.385                   | 0,01                              | KOMMUNIKATIONSDIENSTE                   |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.09.2037                       | 6.128          | 5.719                    | 0,01                              | 4,000 % fällig am 30.01.2037                     | 6.211          | 7.699                    | 0,01                              | Clear Channel Outdoor                   |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.06.2037                       | 1.700          | 1.001                    | 0,00                              | 4,200 % fällig am 30.01.2042                     | 3.488          | 4.302                    | 0,00                              | Holdings, Inc. (e)                      | 26.868.244     | 31.436                   | 0,03                              |
| 4,734 % fällig am 25.11.2037                       | 8.028          | 4.415                    | 0,01                              | Romania Government International Bond            |                |                          |                                   | iHeartMedia, Inc. 'A' (e)               | 6.332.872      | 11.146                   | 0,01                              |
| 4,784 % fällig am 25.04.2037                       | 368            | 271                      | 0,00                              | 1,750 % fällig am 13.07.2030                     | 6.300          | 6.360                    | 0,01                              | iHeartMedia, Inc. 'B' (e)               | 4.913.662      | 7.610                    | 0,01                              |
| 5,134 % fällig am 25.03.2037                       | 1.864          | 953                      | 0,00                              | 2,000 % fällig am 14.04.2033                     | 22.700         | 20.456                   | 0,02                              | Incora (e)(l)                           | 339.313        | 11.464                   | 0,01                              |
| 5,409 % fällig am 25.12.2035                       | 697            | 692                      | 0,00                              | 2,124 % fällig am 16.07.2031                     | 37.610         | 36.780                   | 0,04                              | Intelsat Emergence S.A. (l)             | 4.659.508      | 160.738                  | 0,16                              |
| 5,604 % fällig am 25.12.2035                       | 618            | 614                      | 0,00                              | 2,750 % fällig am 14.04.2041                     | 22.800         | 16.712                   | 0,02                              | Windstream Holdings, Inc. (e)           | 2.022.886      | 39.652                   | 0,04                              |
|                                                    |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 03.04.2034                     | 9.700          | 9.499                    | 0,01                              |                                         | 262.046        | 0,26                     |                                   |
|                                                    |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 07.02.2034                     | 15.850         | 15.914                   | 0,02                              | FINANZWERTE                             |                |                          |                                   |
|                                                    | 215.698        | 0,22                     |                                   | 5,125 % fällig am 24.09.2031                     | 78.000         | 90.498                   | 0,09                              | Adler Group S.A. (e)                    | 250.790        | 0                        | 0,00                              |
|                                                    | 10.429.326     | 10,53                    |                                   | 5,250 % fällig am 10.03.2030                     | 137.400        | 164.879                  | 0,17                              | Cairo Mezz PLC (e)                      | 3.408.327      | 1.726                    | 0,00                              |
| STAATSEMISSIONEN                                   |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 30.05.2032                     | 103.100        | 119.264                  | 0,12                              | Corestate Capital Holding               |                |                          |                                   |
| Argentina Government International Bond            |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 22.03.2031                     | 89.900         | 105.993                  | 0,11                              | S.A. (e)(l)                             | 2.109.837      | 0                        | 0,00                              |
| 0,750 % fällig am 09.07.2030                       | 274.986        | 201.349                  | 0,20                              | 5,500 % fällig am 18.09.2028                     | 63.500         | 77.741                   | 0,08                              | MNSN Holdings, Inc. (e)(l)              | 263            | 1                        | 0,00                              |
| 1,000 % fällig am 09.07.2029                       | 16.397         | 13.708                   | 0,01                              | 5,625 % fällig am 22.02.2036                     | 40.350         | 45.140                   | 0,04                              | UBS Group AG                            | 126.509        | 4.282                    | 0,01                              |
| 3,500 % fällig am 09.07.2041                       | 198.256        | 123.414                  | 0,12                              | 5,625 % fällig am 30.05.2037                     | 109.600        | 121.261                  | 0,12                              |                                         | 6.009          | 0,01                     |                                   |
| 4,125 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 10.09.2034                     | 133.600        | 158.412                  | 0,16                              | GESUNDHEITSWESSEN                       |                |                          |                                   |
| 09.07.2035 (m)                                     | 278.448        | 185.203                  | 0,19                              | 6,375 % fällig am 18.09.2033                     | 103.900        | 125.717                  | 0,13                              | AMSURG Corp. (e)(l)                     | 3.513.233      | 158.611                  | 0,16                              |
| 4,125 % fällig am 09.07.2046                       | 7.867          | 5.156                    | 0,01                              | Russia Government International Bond             |                |                          |                                   | INDUSTRIEWERTE                          |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 09.01.2038                       | 115.791        | 82.487                   | 0,08                              | 1,850 % fällig am 20.11.2032                     | 2.800          | 0                        | 0,00                              | DreamWell Ltd. (e)(l)                   | 421            | 3                        | 0,00                              |
| Australia Government International Bond            |                |                          |                                   | 5,100 % fällig am 28.03.2035                     | \$ 20.000      | 0                        | 0,00                              | Serta Simmons Bedding                   |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 21.06.2051                       | 204.800        | 73.008                   | 0,07                              | 5,250 % fällig am 23.06.2047                     | 345.400        | 0                        | 0,00                              | LLC (e)(l)                              | 421            | 0                        | 0,00                              |
| Bank Gospodarstwa Krajowego                        |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 04.04.2042                     | 98.400         | 68.880                   | 0,07                              |                                         |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 18.03.2030                       | € 66.100       | 78.708                   | 0,08                              | 5,875 % fällig am 16.09.2043                     | 26.600         | 18.206                   | 0,02                              |                                         |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 13.03.2035                       | 28.100         | 33.020                   | 0,03                              | Saudi Arabia Government International Bond       |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 09.07.2034                       | \$ 47.900      | 49.358                   | 0,05                              | 3,375 % fällig am 05.03.2032                     | € 7.100        | 8.307                    | 0,01                              |                                         |                |                          |                                   |
| Bulgaria Government International Bond             |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 05.03.2037                     | 28.700         | 32.852                   | 0,03                              |                                         |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 07.05.2034                       | € 66.600       | 79.079                   | 0,08                              | 5,125 % fällig am 13.01.2028                     | \$ 45.700      | 46.474                   | 0,05                              |                                         |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038                       | 68.100         | 81.508                   | 0,08                              | Serbia Government International Bond             |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| Egypt Government International Bond                |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 15.05.2027                     | € 17.100       | 20.003                   | 0,02                              |                                         |                |                          |                                   |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028                      | GP12.282.700   | 244.546                  | 0,25                              | South Africa Government International Bond       |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| Hungary Government International Bond              |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 28.02.2031                     | ZAR 3.636.900  | 188.273                  | 0,19                              |                                         |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 22.03.2040                       | € 14.700       | 16.894                   | 0,02                              | 8,000 % fällig am 31.01.2030                     | 582.800        | 32.249                   | 0,03                              |                                         |                |                          |                                   |
| Israel Government International Bond               |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 31.01.2037                     | 1.777.400      | 87.065                   | 0,09                              |                                         |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 31.08.2025                       | ILS 23.400     | 6.921                    | 0,01                              | 8,875 % fällig am 28.02.2035                     | 5.746.800      | 301.966                  | 0,30                              |                                         |                |                          |                                   |
| 3,800 % fällig am 13.05.2060                       | \$ 27.811      | 18.161                   | 0,02                              | 9,000 % fällig am 31.01.2040                     | 396.800        | 19.307                   | 0,02                              |                                         |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 30.10.2026                       | € 517.000      | 624.079                  | 0,63                              | 10,500 % fällig am 21.12.2026                    | 4.456.000      | 260.147                  | 0,26                              |                                         |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 19.02.2030                       | \$ 125.100     | 127.643                  | 0,13                              | Turkey Government International Bond             |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 19.02.2035                       | 122.900        | 125.143                  | 0,13                              | 5,250 % fällig am 13.03.2030                     | \$ 155.000     | 147.769                  | 0,15                              |                                         |                |                          |                                   |
| Japan Government International Bond                |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 24.10.2028                     | 28.900         | 29.035                   | 0,03                              |                                         |                |                          |                                   |
| 2,400 % fällig am 20.03.2045                       | ¥10.094.000    | 70.352                   | 0,07                              | 7,625 % fällig am 26.04.2029                     | 94.000         | 98.536                   | 0,10                              |                                         |                |                          |                                   |
| 2,400 % fällig am 20.03.2055                       | 2.618.000      | 16.651                   | 0,02                              | 47,469 % fällig am 06.09.2028                    | TRY 297.400    | 7.177                    | 0,01                              |                                         |                |                          |                                   |





## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrech-<br>nungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                                          | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsge-<br>schäfte, zum<br>Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsge-<br>schäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|-------------------------|------------|----------------------------|-----------------------|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|
|                         | 2,730 %    | 18.06.2025                 | 03.07.2025            | CAD 900.000   | Province of Ontario 2,900 % fällig am 02.12.2046 - 02.06.2049                            | \$ (322.407)               | \$ 659.582                          | \$ 660.592                                                          | 0,67                              |
|                         | 2,730      | 24.06.2025                 | 08.07.2025            | 500.000       | Province of Quebec 4,400 % fällig am 01.12.2055                                          | (365.169)                  |                                     |                                                                     |                                   |
|                         |            |                            |                       |               | Province of Alberta 3,050 % fällig am 01.12.2048                                         | (21.252)                   | 366.435                             | 366.958                                                             | 0,37                              |
|                         |            |                            |                       |               | Province of Ontario 2,150 % - 5,600 % fällig am 02.06.2031 - 02.12.2054                  | (283.488)                  |                                     |                                                                     |                                   |
|                         | 2,730      | 25.06.2025                 | 09.07.2025            | 4.000.000     | Province of Quebec 1,900 % fällig am 01.09.2030                                          | (69.569)                   |                                     |                                                                     |                                   |
|                         |            |                            |                       |               | Province of Alberta 3,300 % fällig am 01.12.2046                                         | (135.937)                  | 2.931.476                           | 2.935.665                                                           | 2,97                              |
|                         |            |                            |                       |               | Province of British Columbia ,950 % fällig am 18.06.2050                                 | (164.240)                  |                                     |                                                                     |                                   |
|                         |            |                            |                       |               | Province of Ontario ,900 % - 4,600 % fällig am 02.06.2039 - 02.12.2055                   | (1.581.316)                |                                     |                                                                     |                                   |
|                         |            |                            |                       |               | Province of Quebec 2,850 % - 5,000 % fällig am 01.12.2041 - 01.12.2057                   | (1.122.531)                |                                     |                                                                     |                                   |
| MEI                     | 2,670      | 27.06.2025                 | 11.07.2025            | 500.000       | Canada Government International Bond 2,500 % - 3,500 % fällig am 01.02.2027 - 01.09.2030 | (373.711)                  | 366.435                             | 366.947                                                             | 0,37                              |
|                         | 2,680      | 17.06.2025                 | 03.07.2025            | 153.584       | Canada Government International Bond 4,000 % fällig am 01.05.2026                        | (115.180)                  | 112.557                             | 112.737                                                             | 0,11                              |
|                         | 2,680      | 19.06.2025                 | 03.07.2025            | 96.416        | Canada Government International Bond 4,000 % fällig am 01.05.2026                        | (72.306)                   | 70.660                              | 70.759                                                              | 0,07                              |
| TOR                     | 2,700      | 27.06.2025                 | 11.07.2025            | 290.000       | Province of Alberta 3,900 % fällig am 01.12.2033                                         | (48.897)                   | 212.532                             | 212.832                                                             | 0,21                              |
|                         |            |                            |                       |               | Province of British Columbia 2,800 % - 5,620 % fällig am 17.08.2028 - 18.06.2050         | (124.369)                  |                                     |                                                                     |                                   |
|                         |            |                            |                       |               | Province of Quebec 5,000 % fällig am 01.12.2041                                          | (45.271)                   |                                     |                                                                     |                                   |
|                         | 2,710      | 20.06.2025                 | 07.07.2025            | 340.000       | Province of Alberta 1,650 % - 2,050 % fällig am 01.06.2030 - 01.06.2031                  | (256.156)                  | 249.176                             | 249.605                                                             | 0,25                              |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                            |                       |               |                                                                                          | \$ (11.388.893)            | \$ 11.050.325                       | \$ 11.066.458                                                       | 11,16                             |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Short | 03.2026     | 1.289                | \$ 4.874                                 | 0,01                 |
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2027     | 33.453               | 6.021                                    | 0,01                 |
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2028     | 15.122               | 3.795                                    | 0,00                 |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Short | 09.2025     | 8.824                | 22.281                                   | 0,02                 |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2026     | 33.453               | (4.940)                                  | (0,01)               |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2027     | 15.122               | 3.520                                    | 0,00                 |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Long  | 06.2026     | 32.247               | (13.325)                                 | (0,01)               |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Long  | 06.2027     | 15.122               | 2.980                                    | 0,00                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Short | 12.2025     | 986                  | 4.552                                    | 0,01                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2026     | 33.453               | 1.785                                    | 0,00                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2027     | 15.122               | 3.588                                    | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures  | Long  | 09.2025     | 8.348                | 5.198                                    | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025     | 7.791                | 2.997                                    | 0,00                 |
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025     | 12.626               | 11.221                                   | 0,01                 |
| Euro-Schatz September Futures                        | Short | 09.2025     | 46                   | 10                                       | 0,00                 |
| US Treasury 2-Year Note September Futures            | Short | 09.2025     | 24.235               | (20.592)                                 | (0,02)               |
| US Treasury 5-Year Note September Futures            | Long  | 09.2025     | 35.730               | 42.818                                   | 0,04                 |
| US Treasury 10-Year Note September Futures           | Long  | 09.2025     | 89.770               | 165.014                                  | 0,17                 |
| US Treasury 10-Year Ultra September Futures          | Long  | 09.2025     | 407                  | 969                                      | 0,00                 |
| US Treasury Long-Term Bond September Futures         | Short | 09.2025     | 7.004                | (27.993)                                 | (0,03)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 38.031               | 174.269                                  | 0,18                 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025     | 57.612               | 170.747                                  | 0,17                 |
|                                                      |       |             |                      | \$ 559.789                               | 0,56                 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                               | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------|-----------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 1.029                | \$ (341) | \$ (32)   | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,000       | 25.07.2025    | 3.809                | (1.701)  | (119)     | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,500       | 25.07.2025    | 1.035                | (338)    | (65)      | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 110,250       | 25.07.2025    | 1.039                | (259)    | (130)     | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,000       | 25.07.2025    | 1.029                | (353)    | (772)     | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,500       | 25.07.2025    | 4.844                | (1.924)  | (2.573)   | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,750       | 25.07.2025    | 1.039                | (323)    | (455)     | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                  | € 117,250     | 25.07.2025    | 409                  | (90)     | (86)      | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                 | 118,500       | 25.07.2025    | 409                  | (75)     | (53)      | 0,00                 |

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld    | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|------------|------------|----------------------|
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 129,000     | 25.07.2025    | 272                  | \$ (124)   | \$ (108)   | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500       | 25.07.2025    | 272                  | (144)      | (45)       | 0,00                 |
|                                                                |               |               |                      | \$ (5.672) | \$ (4.438) | 0,00                 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                      |            | \$ 555.351 | 0,56                 |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF(1)**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-----------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Ford Motor Co.  | (5,000) %                   | 20.06.2026       | \$ 2.200                  | \$ 28                                    | 0,00                 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

| Referenzeinheit              | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Airbus Finance BV            | 1,000 %                     | 20.06.2028       | € 13.400                  | \$ 64                                    | 0,00                 |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                       | 20.12.2025       | \$ 103.500                | (368)                                    | 0,00                 |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                       | 20.06.2026       | 9.400                     | (87)                                     | 0,00                 |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                       | 20.06.2028       | 29.400                    | 651                                      | 0,00                 |
| Bank Of America Corp.        | 1,000                       | 20.12.2025       | 107.400                   | (353)                                    | 0,00                 |
| Bank Of America Corp.        | 1,000                       | 20.12.2026       | 131.400                   | (389)                                    | 0,00                 |
| Barclays Bank PLC            | 1,000                       | 20.12.2025       | € 147.900                 | (182)                                    | 0,00                 |
| BNP Paribas S.A.             | 1,000                       | 20.12.2025       | 39.400                    | (59)                                     | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.12.2025       | \$ 11.700                 | 94                                       | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.06.2026       | 35.600                    | 124                                      | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.12.2029       | 700                       | 15                                       | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.06.2030       | 24.400                    | 248                                      | 0,00                 |
| Citigroup, Inc.              | 1,000                       | 20.12.2025       | 35.600                    | (91)                                     | 0,00                 |
| Deutsche Bank AG             | 1,000                       | 20.12.2029       | € 148.900                 | 1.960                                    | 0,00                 |
| Deutsche Bank AG             | 1,000                       | 20.12.2031       | 18.100                    | 298                                      | 0,00                 |
| Ford Motor Co.               | 5,000                       | 20.06.2026       | \$ 3.300                  | (229)                                    | 0,00                 |
| Ford Motor Co.               | 5,000                       | 20.12.2026       | 4.400                     | (286)                                    | 0,00                 |
| Ford Motor Co.               | 5,000                       | 20.06.2027       | 3.300                     | (70)                                     | 0,00                 |
| Ford Motor Co.               | 5,000                       | 20.12.2028       | 15.700                    | (460)                                    | 0,00                 |
| Ford Motor Credit Co. LLC    | 5,000                       | 20.12.2025       | 25.300                    | (493)                                    | 0,00                 |
| Ford Motor Credit Co. LLC    | 5,000                       | 20.06.2027       | 11.500                    | (362)                                    | 0,00                 |
| General Electric Co.         | 1,000                       | 20.06.2026       | 53.500                    | (10)                                     | 0,00                 |
| General Electric Co.         | 1,000                       | 20.12.2026       | 6.700                     | 4                                        | 0,00                 |
| Goldman Sachs Group, Inc.    | 1,000                       | 20.06.2026       | 69.200                    | 41                                       | 0,00                 |
| Morgan Stanley               | 1,000                       | 20.12.2025       | 34.700                    | 12                                       | 0,00                 |
| Morgan Stanley               | 1,000                       | 20.06.2026       | 180.000                   | 144                                      | 0,00                 |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                       | 20.12.2025       | € 25.100                  | (14)                                     | 0,00                 |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                       | 20.06.2026       | 41.400                    | 3.715                                    | 0,01                 |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                       | 20.12.2026       | 114.700                   | 7.487                                    | 0,01                 |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                       | 20.06.2027       | 18.100                    | 1.962                                    | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.06.2026       | \$ 6.700                  | (104)                                    | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.12.2026       | 32.300                    | (428)                                    | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.06.2028       | 36.150                    | 659                                      | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.12.2028       | 7.100                     | 145                                      | 0,00                 |
| Electricite de France        | 1,000                       | 20.06.2030       | € 33.300                  | (30)                                     | 0,00                 |
|                              |                             |                  |                           | \$ 13.608                                | 0,02                 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-35 5-Year Index | (1,000) %                   | 20.12.2025       | \$ 107.200                | \$ 2.125                                 | 0,00                 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.EM-34 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.12.2025       | \$ 218.224                | \$ 12.433                                | 0,01                 |
| CDX.EM-35 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2026       | 1.380                     | 52                                       | 0,00                 |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2026       | 493.028                   | 40.350                                   | 0,04                 |
| CDX.EM-37 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2027       | 6.958                     | 600                                      | 0,00                 |
| CDX.EM-38 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2027       | 62.500                    | 5.459                                    | 0,01                 |
| CDX.EM-39 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2028       | 9.100                     | 626                                      | 0,00                 |
| CDX.EM-40 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2028       | 151.600                   | 6.450                                    | 0,01                 |
| CDX.EM-41 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2029       | 48.800                    | 1.412                                    | 0,00                 |
| CDX.EM-42 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2029       | 69.200                    | 988                                      | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.EM-43 5-Year Index             | 1,000 %                        | 20.06.2030       | \$ 53.300                 | \$ 612                                          | 0,00                         |
| CDX.HY-35 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2025       | 8.160                     | (567)                                           | 0,00                         |
| CDX.HY-36 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2026       | 409.056                   | 1.443                                           | 0,00                         |
| CDX.HY-37 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2026       | 146.592                   | (477)                                           | 0,00                         |
| CDX.HY-38 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2027       | 26.592                    | 1.682                                           | 0,00                         |
| CDX.HY-39 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2027       | 27.839                    | 1.054                                           | 0,00                         |
| CDX.HY-40 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2028       | 19.502                    | 1.377                                           | 0,00                         |
| CDX.HY-41 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2028       | 6.039                     | 96                                              | 0,00                         |
| CDX.HY-43 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2029       | 1.058.100                 | 2.867                                           | 0,01                         |
| CDX.HY-44 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2030       | 2.485.100                 | 70.110                                          | 0,07                         |
| CDX.IG-37 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2026       | 1.400                     | (14)                                            | 0,00                         |
| CDX.IG-38 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2027       | 400                       | 2                                               | 0,00                         |
| CDX.IG-39 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2027       | 200                       | 1                                               | 0,00                         |
| CDX.IG-40 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2028       | 1.300                     | 8                                               | 0,00                         |
| CDX.IG-41 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2028       | 6.900                     | 43                                              | 0,00                         |
| CDX.IG-43 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2029       | 233.500                   | (174)                                           | 0,00                         |
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2030       | 1.862.000                 | 9.132                                           | 0,01                         |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | € 618.600                 | 1.912                                           | 0,00                         |
|                                    |                                |                  |                           | <b>\$ 157.477</b>                               | <b>0,16</b>                  |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex           | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag   | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|--------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 0,500 %         | 16.09.2030       | £ 254.700    | \$ (1.154)                                      | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2030       | 2.551.400    | (912)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2035       | 904.800      | (5.960)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,700           | 28.03.2034       | 24.100       | 677                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 20.09.2026       | ¥ 48.830.000 | (3.018)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 15.03.2029       | 344.670.000  | 27.022                                          | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,020           | 20.09.2028       | 395.820.000  | 65.321                                          | 0,07                         |
| Zahlung                                     | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,176           | 27.04.2027       | 22.270.000   | (1.470)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400           | 15.06.2032       | 31.750.700   | 6.524                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500           | 15.03.2042       | 15.498.000   | 11.144                                          | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,700           | 18.09.2029       | 264.680.000  | 4.803                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,711           | 27.04.2042       | 5.408.000    | 4.238                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000           | 18.09.2034       | 136.260.000  | 1.461                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,250           | 18.06.2035       | 21.746.000   | 4.069                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,500           | 16.06.2026       | \$ 1.090.500 | (7.004)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,500           | 16.06.2028       | 2.503.737    | (86.407)                                        | (0,09)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,550           | 15.01.2031       | 4.567.800    | 754.258                                         | 0,76                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,674           | 05.08.2030       | 62.900       | 9.649                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,678           | 29.07.2030       | 65.200       | 9.974                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,711           | 28.07.2030       | 69.000       | 10.455                                          | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,715           | 27.07.2030       | 200.000      | 30.266                                          | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,750           | 30.03.2031       | 963.600      | 153.581                                         | 0,16                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,750           | 16.06.2031       | 3.358.883    | (228.284)                                       | (0,23)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,800           | 15.01.2051       | 1.479.300    | 835.120                                         | 0,84                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,928           | 06.05.2026       | 150.100      | 5.220                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,975           | 17.06.2052       | 52.200       | 22.656                                          | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,990           | 24.06.2052       | 75.000       | 32.253                                          | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000           | 15.06.2027       | 386.590      | 5.798                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000           | 15.06.2029       | 495.770      | 19.814                                          | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000           | 16.12.2030       | 120.615      | 15.970                                          | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,035           | 28.06.2052       | 25.900       | 11.096                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,144           | 04.11.2050       | 49.600       | (23.950)                                        | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,150           | 30.03.2051       | 191.500      | 19.788                                          | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,215           | 13.10.2050       | 83.500       | (40.358)                                        | (0,04)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,235           | 12.05.2028       | 75.400       | 5.530                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250           | 15.12.2026       | 1.654.500    | (85.224)                                        | (0,09)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250           | 15.06.2032       | 15.560       | 1.572                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250           | 15.06.2032       | 635.270      | (35.600)                                        | (0,03)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250           | 16.06.2051       | 1.456.600    | 53.967                                          | 0,05                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,280           | 24.03.2028       | 423.400      | (24.737)                                        | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,306           | 02.11.2051       | 48.000       | 19.812                                          | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,317           | 16.12.2050       | 33.800       | (15.240)                                        | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,350           | 20.01.2027       | 109.100      | 4.527                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,360           | 15.02.2027       | 387.430      | 15.705                                          | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,360           | 20.07.2031       | 91.400       | 12.431                                          | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,370           | 19.07.2031       | 61.300       | 8.297                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,380           | 04.01.2027       | 212.800      | (8.382)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,405           | 07.09.2031       | 154.300      | 20.745                                          | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,418           | 20.01.2027       | 71.900       | (2.772)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,420           | 24.02.2027       | 269.100      | 10.378                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,425           | 18.01.2027       | 146.000      | (5.455)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,443           | 18.01.2027       | 157.300      | (5.789)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450           | 17.02.2027       | 361.600      | 13.889                                          | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450           | 16.07.2031       | 137.000      | 18.213                                          | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,485           | 13.01.2051       | 78.100       | (34.369)                                        | (0,03)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500           | 15.12.2028       | 473.684      | (43.506)                                        | (0,04)                       |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex       | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,500 %         | 12.01.2029       | \$ 85.443  | \$ 6.409                                        | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,500           | 05.10.2031       | 89.100     | (11.771)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,518           | 20.01.2029       | 43.100     | (3.106)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,535           | 15.10.2031       | 88.600     | (11.563)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,535           | 22.10.2031       | 59.100     | (7.671)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,545           | 26.10.2031       | 58.900     | (7.602)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,550           | 20.01.2027       | 485.100    | (16.566)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,570           | 11.01.2027       | 121.400    | (4.315)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,570           | 12.01.2027       | 76.200     | (2.689)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,573           | 28.02.2027       | 96.300     | (3.834)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,580           | 16.02.2027       | 150.400    | (5.034)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,595           | 13.01.2051       | 82.600     | (34.755)                                        | (0,03)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,600           | 16.01.2026       | 943.900    | 13.138                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,600           | 15.02.2027       | 1.549.700  | (50.298)                                        | (0,05)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,618           | 09.02.2029       | 27.100     | (1.853)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,620           | 18.04.2027       | 153.700    | (5.449)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,630           | 20.01.2029       | 60.000     | (4.070)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,630           | 26.01.2029       | 72.000     | (4.827)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,650           | 24.02.2027       | 897.000    | (27.359)                                        | (0,03)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,650           | 08.02.2032       | 91.900     | (10.687)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,655           | 24.01.2032       | 72.000     | (8.869)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,700           | 17.02.2027       | 1.446.200  | (43.112)                                        | (0,04)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,700           | 12.01.2029       | 310.700    | (19.769)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,730           | 24.02.2032       | 86.300     | (9.578)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,735           | 12.01.2032       | 57.800     | (6.842)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,750           | 15.06.2029       | 190.144    | 940                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,750           | 15.06.2032       | 209.290    | 4.677                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,750           | 15.06.2032       | 96.400     | (4.489)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,765           | 16.03.2032       | 30.400     | (3.260)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,770           | 14.02.2032       | 81.500     | (8.885)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,783           | 22.04.2027       | 114.300    | (3.664)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,785           | 12.08.2051       | 76.100     | 31.486                                          | 0,03                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,788           | 03.05.2027       | 114.800    | (3.601)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,815           | 24.01.2052       | 14.400     | (5.631)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,817           | 05.04.2032       | 318.600    | (32.857)                                        | (0,03)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,867           | 26.01.2052       | 14.400     | (5.489)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,872           | 06.04.2032       | 160.000    | (15.925)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,928           | 25.03.2027       | 159.500    | (5.068)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,945           | 23.06.2051       | 127.800    | 48.733                                          | 0,05                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 1,988           | 09.02.2032       | 22.000     | 2.171                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,000           | 21.12.2027       | 193.480    | (4.970)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,000           | 21.12.2029       | 910.590    | (17.980)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,000           | 18.02.2032       | 133.700    | (12.983)                                        | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,000           | 21.12.2032       | 1.477.810  | (746)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,000           | 15.12.2051       | 324.000    | 38.182                                          | 0,04                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,008           | 09.02.2032       | 36.700     | 3.655                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,185           | 21.04.2029       | 96.000     | (4.277)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,243           | 07.08.2026       | 291.100    | 7.421                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,300           | 17.01.2026       | 678.900    | 13.294                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,370           | 21.06.2027       | 159.400    | (2.818)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,385           | 08.06.2032       | 26.800     | 1.625                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,430           | 30.09.2027       | 230.020    | 8.728                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,450           | 04.10.2027       | 221.690    | 8.234                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,451           | 08.06.2032       | 90.600     | 5.223                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,468           | 27.07.2028       | 79.800     | (1.907)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,537           | 24.07.2053       | 20.300     | (3.757)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,550           | 21.07.2053       | 20.300     | (3.727)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,590           | 23.07.2026       | 616.200    | 11.915                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,605           | 28.06.2027       | 158.600    | (5.400)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,620           | 24.07.2025       | 869.400    | 11.751                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,675           | 24.07.2028       | 81.100     | (1.372)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,680           | 11.07.2032       | 27.300     | (1.619)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,690           | 11.07.2032       | 27.300     | (1.594)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,700           | 21.07.2028       | 79.700     | (1.277)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,850           | 30.08.2027       | 137.400    | (3.105)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,880           | 30.09.2027       | 657.200    | (11.373)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,900           | 04.10.2027       | 633.400    | (10.623)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 2,955           | 04.10.2027       | 141.800    | (2.190)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,000           | 19.03.2030       | 1.423.210  | (28.070)                                        | (0,03)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,000           | 21.06.2030       | 2.179.420  | 11.838                                          | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,000           | 21.06.2033       | 710.885    | 18.624                                          | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,050           | 07.09.2027       | 69.900     | (1.116)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,050           | 08.09.2029       | 69.900     | (1.376)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,050           | 06.09.2032       | 104.600    | (3.697)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,080           | 23.02.2053       | 29.400     | (4.111)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,100           | 09.09.2029       | 70.000     | (1.214)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,231           | 18.09.2034       | 56.700     | 2.642                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,232           | 10.09.2034       | 28.250     | 1.360                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,240           | 16.09.2034       | 28.400     | 1.333                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,248           | 18.09.2034       | 56.300     | 2.543                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 21.06.2028       | 126.300    | (1.348)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 21.06.2028       | 1.919.560  | 9.791                                           | 0,01                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex       | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag   | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|------------------|--------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250 %         | 18.06.2030       | \$ 9.400.600 | \$ 42.229                                       | 0,04                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 19.03.2032       | 1.087.280    | (20.772)                                        | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 18.06.2032       | 152.030      | 686                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 18.06.2035       | 94.960       | 1.097                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250           | 18.06.2055       | 2.636.600    | 4.611                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,278           | 16.09.2034       | 112.900      | 4.920                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300           | 28.02.2029       | 232.300      | 1.890                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300           | 30.06.2031       | 165.600      | 2.655                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300           | 06.03.2033       | 54.100       | (971)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300           | 15.11.2053       | 58.140       | 7.055                                           | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,328           | 30.04.2031       | 53.440       | 493                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,340           | 23.02.2030       | 86.000       | (276)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,350           | 14.12.2032       | 28.200       | 661                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,368           | 15.11.2049       | 26.380       | 2.676                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,370           | 01.03.2033       | 52.300       | (629)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,370           | 12.07.2053       | 40.100       | (4.103)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,375           | 15.10.2034       | 59.900       | (1.576)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,385           | 17.10.2034       | 60.400       | (1.543)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,395           | 17.10.2034       | 90.400       | (2.230)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,400           | 23.02.2033       | 49.800       | (505)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,400           | 17.10.2034       | 30.200       | (734)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,405           | 01.03.2033       | 53.700       | (519)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,410           | 05.09.2034       | 56.600       | 1.817                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,420           | 24.05.2033       | 88.200       | (674)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,425           | 01.03.2033       | 53.900       | (469)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,430           | 27.02.2033       | 53.600       | (445)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,431           | 30.04.2031       | 89.340       | 296                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,446           | 23.10.2034       | 60.700       | (1.258)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,450           | 07.03.2033       | 109.100      | (786)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,450           | 11.10.2034       | 59.800       | (1.188)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,463           | 23.10.2034       | 60.200       | (1.149)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,464           | 15.11.2049       | 35.220       | 3.023                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,465           | 30.10.2034       | 122.100      | (2.256)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,470           | 22.02.2030       | 102.500      | 298                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,470           | 04.09.2034       | 28.400       | 761                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,481           | 29.10.2034       | 60.600       | (1.044)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,495           | 30.10.2034       | 61.000       | (972)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500           | 21.06.2026       | 195.110      | 114                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500           | 22.06.2030       | 175.800      | 1.249                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500           | 20.12.2030       | 44.830       | (1.012)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500           | 20.12.2030       | 4.093.815    | 92.190                                          | 0,09                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500           | 22.05.2033       | 5.163.180    | (75.243)                                        | (0,08)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500           | 21.06.2033       | 117.200      | (137)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500           | 20.12.2033       | 290.730      | 4.448                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,510           | 30.11.2028       | 53.670       | 88                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,514           | 04.09.2034       | 56.400       | 1.298                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,515           | 30.11.2028       | 80.530       | 119                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,515           | 06.11.2034       | 348.700      | (4.767)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,525           | 02.03.2030       | 37.900       | 185                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,525           | 04.09.2034       | 56.800       | 1.251                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,527           | 15.11.2049       | 14.210       | 1.072                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,532           | 20.08.2034       | 56.300       | 1.229                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,555           | 28.08.2034       | 56.700       | 1.115                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,555           | 05.03.2054       | 21.800       | (1.261)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,558           | 21.08.2034       | 56.000       | 1.085                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,565           | 28.08.2034       | 56.700       | 1.061                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,569           | 14.08.2034       | 56.300       | 1.048                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,594           | 09.01.2034       | 53.500       | 272                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,595           | 19.08.2034       | 112.000      | 1.840                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,599           | 28.08.2034       | 56.600       | 893                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,600           | 17.01.2034       | 51.000       | 465                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,610           | 12.12.2032       | 56.700       | 310                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,611           | 28.08.2034       | 125.700      | 1.902                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,613           | 22.08.2034       | 56.200       | 829                                             | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620           | 30.11.2029       | 1.801.325    | (16.720)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620           | 31.01.2034       | 26.100       | 40                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,643           | 28.08.2034       | 56.600       | 680                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,645           | 07.08.2034       | 56.300       | 698                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,648           | 08.01.2034       | 52.100       | 285                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650           | 10.07.2033       | 60.400       | (176)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650           | 05.03.2034       | 54.400       | 227                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,655           | 24.01.2034       | 26.500       | 104                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,665           | 24.01.2034       | 53.000       | 248                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,670           | 08.01.2034       | 52.900       | 204                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,679           | 13.08.2034       | 56.300       | 535                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,684           | 03.01.2034       | 26.000       | 70                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,685           | 24.01.2034       | 53.200       | 334                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700           | 06.06.2033       | 3.050.720    | (42.094)                                        | (0,04)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700           | 05.03.2034       | 27.300       | 208                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,710           | 05.03.2034       | 54.100       | 450                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,715           | 07.08.2034       | 56.300       | 389                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,725           | 07.02.2034       | 26.000       | 273                                             | 0,00                         |



| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,730 %         | 03.08.2033       | \$ 30.800  | \$ 154                                          | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735           | 07.08.2033       | 33.100     | 192                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735           | 23.01.2034       | 26.700     | 274                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,738           | 23.01.2034       | 15.900     | 167                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 13.12.2027       | 141.600    | (205)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2028       | 1.360.714  | (17.829)                                        | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2029       | 1.448.430  | 3.555                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2029       | 2.398.330  | (39.020)                                        | (0,04)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2029       | 3.913.260  | 69.143                                          | 0,07                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2031       | 1.468.420  | (24.644)                                        | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2031       | 1.027.700  | 5.867                                           | 0,01                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 15.05.2032       | 1.831.573  | (26.182)                                        | (0,03)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 12.07.2033       | 57.200     | 311                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 02.01.2034       | 26.000     | (70)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 20.06.2034       | 674.050    | 23.061                                          | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 18.12.2034       | 435.920    | 4.592                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750           | 07.05.2035       | 126.800    | 1.254                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,760           | 23.08.2033       | 97.900     | 818                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,783           | 07.02.2034       | 20.700     | 311                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,795           | 06.08.2034       | 56.600     | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800           | 10.03.2028       | 104.800    | 1.074                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800           | 22.08.2030       | 24.500     | 328                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800           | 30.08.2033       | 49.300     | 576                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,810           | 02.01.2034       | 26.000     | (193)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,830           | 12.10.2053       | 15.600     | (250)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,840           | 08.01.2035       | 62.200     | 886                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,842           | 26.12.2033       | 26.000     | (257)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,850           | 05.08.2034       | 56.600     | (273)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,850           | 08.01.2035       | 31.200     | 471                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,854           | 29.12.2033       | 52.000     | (565)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,860           | 21.02.2034       | 106.200    | 2.190                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,865           | 20.11.2034       | 178.300    | 3.071                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,866           | 14.11.2034       | 177.500    | 3.026                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870           | 05.03.2035       | 31.200     | (347)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870           | 17.10.2053       | 15.700     | (146)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,874           | 05.03.2035       | 62.400     | (717)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880           | 10.07.2034       | 112.500    | (813)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880           | 16.10.2053       | 15.700     | (117)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,884           | 25.03.2035       | 62.800     | (820)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,890           | 03.03.2035       | 31.200     | (389)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,896           | 08.01.2035       | 62.300     | 1.203                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,899           | 11.03.2035       | 184.800    | (2.543)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 30.08.2033       | 49.400     | 957                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 10.04.2034       | 55.300     | 1.298                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 15.04.2034       | 27.100     | 638                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900           | 08.01.2035       | 62.000     | 1.205                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,905           | 12.03.2035       | 62.200     | (914)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,908           | 04.03.2035       | 62.300     | (885)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,930           | 24.03.2035       | 125.200    | (2.116)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,933           | 06.01.2035       | 62.700     | 1.422                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,940           | 22.02.2029       | 159.500    | 3.130                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950           | 13.09.2033       | 146.600    | 3.507                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950           | 19.12.2033       | 51.500     | (944)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950           | 16.04.2034       | 55.100     | 1.493                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970           | 27.02.2029       | 54.000     | 1.124                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970           | 15.01.2035       | 31.200     | 793                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,994           | 02.07.2034       | 83.200     | (1.401)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,000           | 26.02.2035       | 90.250     | (2.000)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,015           | 30.12.2034       | 62.900     | 1.867                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030           | 04.10.2033       | 103.700    | 3.189                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030           | 15.12.2033       | 51.700     | (1.262)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,060           | 02.07.2034       | 55.100     | (1.233)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,071           | 15.01.2035       | 62.600     | 2.134                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,078           | 29.04.2034       | 55.300     | 2.020                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,080           | 17.04.2034       | 55.300     | 2.054                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,080           | 05.06.2034       | 56.200     | (1.688)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,085           | 22.04.2034       | 55.300     | 2.107                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,090           | 30.04.2034       | 166.400    | 7.136                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,090           | 22.01.2035       | 62.800     | 2.246                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,100           | 21.01.2035       | 31.400     | 1.153                                           | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,100           | 15.11.2052       | 594.295    | (14.524)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,105           | 24.04.2034       | 84.800     | 3.311                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,130           | 03.05.2034       | 55.000     | 2.225                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150           | 12.10.2033       | 49.900     | 2.045                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150           | 22.04.2034       | 56.400     | 2.407                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,165           | 27.09.2033       | 115.400    | 4.832                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,170           | 03.10.2033       | 81.600     | 3.444                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,175           | 10.10.2033       | 50.000     | 2.124                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,200           | 18.10.2033       | 39.900     | 1.772                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,220           | 20.10.2033       | 50.300     | 2.320                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,230           | 23.10.2033       | 25.100     | 1.180                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250           | 20.03.2029       | 208.940    | 610                                             | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250 %         | 20.03.2031       | \$ 239.020 | \$ 1.351                                        | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,250           | 22.11.2033       | 51.700     | (2.125)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,255           | 23.10.2033       | 25.100     | 1.231                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,393           | 25.10.2033       | 23.500     | 1.405                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,435           | 01.11.2033       | 26.400     | 1.688                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,450           | 31.10.2033       | 29.800     | 1.927                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 4,450           | 01.11.2033       | 51.700     | 3.373                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 9,874           | 02.01.2026       | 453.700    | (4.659)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 9,899           | 02.01.2026       | 229.400    | (2.333)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 9,939           | 02.01.2026       | 366.700    | (3.656)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 9,998           | 04.01.2027       | 669.600    | (9.310)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,037          | 04.01.2027       | 163.900    | (2.243)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,041          | 04.01.2027       | 696.800    | (9.562)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,052          | 02.01.2026       | 857.800    | (8.224)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,072          | 04.01.2027       | 388.330    | (4.511)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,085          | 02.01.2026       | 851.400    | (8.071)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,090          | 04.01.2027       | 1.313.900  | (17.752)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,098          | 04.01.2027       | 1.174.240  | (13.511)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,105          | 02.01.2026       | 843.500    | (7.969)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,138          | 04.01.2027       | 326.900    | (4.343)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,165          | 04.01.2027       | 595.440    | (6.686)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,170          | 04.01.2027       | 993.630    | (11.138)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,183          | 04.01.2027       | 1.784.770  | (19.899)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,203          | 04.01.2027       | 1.390.590  | (15.395)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,210          | 04.01.2027       | 200.330    | (2.212)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,256          | 04.01.2027       | 1.389.360  | (15.080)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,328          | 04.01.2027       | 1.084.260  | (11.451)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,250          | 04.01.2027       | 32.000     | (376)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,275          | 04.01.2027       | 16.100     | (186)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,290          | 04.01.2027       | 16.200     | (186)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,731          | 04.01.2027       | 8.300      | (70)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,746          | 04.01.2027       | 35.900     | (299)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,901          | 04.01.2027       | 85.800     | (624)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,291          | 02.01.2029       | 1.153.900  | 1.830                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,354          | 02.01.2029       | 2.301.600  | 2.641                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927          | 04.01.2027       | 1.761.500  | (1.002)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 14,009          | 04.01.2027       | 1.254.000  | (290)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,000           | 16.06.2047       | 2.600      | (79)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 1,300           | 16.06.2047       | 2.500      | (81)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,400           | 20.06.2029       | 6.300      | 169                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2025       | 1.042.300  | 22.067                                          | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 3-Month NZD-BBR                     | 4,750           | 19.06.2029       | 486.100    | 11.621                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,000           | 03.01.2031       | 295.900    | 445                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,001           | 06.01.2031       | 295.900    | 447                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,010           | 07.01.2031       | 288.500    | 442                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,030           | 07.01.2031       | 288.500    | 458                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,053           | 07.01.2031       | 288.500    | 475                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,058           | 07.01.2031       | 288.500    | 479                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,063           | 08.01.2031       | 880.400    | 1.472                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,080           | 08.01.2031       | 409.900    | 705                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,203           | 10.01.2031       | 1.472.900  | 3.009                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,360           | 07.08.2028       | 550.900    | 1.188                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,380           | 04.08.2028       | 275.800    | 604                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,400           | 07.08.2028       | 550.900    | 1.224                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410           | 31.07.2028       | 252.300    | 565                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410           | 04.08.2028       | 664.400    | 1.487                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410           | 07.08.2028       | 162.900    | 365                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,415           | 31.07.2028       | 201.400    | 453                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,415           | 04.08.2028       | 275.800    | 619                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,420           | 31.07.2028       | 753.500    | 1.699                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,421           | 04.08.2028       | 281.900    | 636                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,426           | 01.08.2028       | 304.400    | 689                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,428           | 31.07.2028       | 501.600    | 1.137                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,460           | 01.08.2028       | 513.900    | 1.192                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,460           | 02.08.2028       | 520.900    | 1.209                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,464           | 02.08.2028       | 522.200    | 1.216                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,543           | 04.08.2028       | 280.700    | 689                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,550           | 03.08.2028       | 554.000    | 1.366                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 2,750           | 17.06.2026       | 72.880     | (90)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,000           | 21.03.2027       | 1.179.040  | (24.743)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,000           | 18.09.2029       | 1.733.400  | 1.905                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 20.03.2034       | 662.900    | 19.583                                          | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 18.09.2034       | 53.300     | 633                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 18.06.2035       | 3.047.150  | 30.638                                          | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,329           | 30.12.2025       | 13.200     | 210                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,500           | 17.06.2050       | 126.900    | 65.857                                          | 0,07                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,650           | 12.04.2027       | 331.900    | (8.635)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,700           | 11.04.2027       | 113.000    | (2.916)                                         | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,830           | 09.12.2052       | 1.064.900  | 117.509                                         | 0,12                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,000           | 13.05.2027       | 243.100    | (4.725)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,000           | 18.05.2027       | 116.300    | (2.281)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 1,750           | 21.09.2027       | 355.500    | 704                                             | 0,00                         |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermö-<br>gens |
|------------------------------------------------|------------------------|-----------------|------------------|-------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,000 %         | 21.09.2032       | € 170.580   | \$ (8.726)                                      | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,220           | 08.01.2035       | 38.200      | (1.346)                                         | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250           | 17.09.2030       | 3.150.100   | 35.421                                          | 0,04                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250           | 17.09.2035       | 145.500     | (1.379)                                         | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,250           | 17.09.2055       | 2.311.125   | 144.878                                         | 0,15                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,280           | 04.03.2030       | 38.700      | (6)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,300           | 25.09.2029       | 59.700      | (916)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,350           | 29.04.2030       | 51.100      | (195)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,360           | 07.10.2029       | 60.200      | (1.144)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,380           | 31.12.2034       | 32.200      | (76)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,390           | 01.10.2034       | 36.000      | 205                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,400           | 09.04.2030       | 63.100      | (381)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,400           | 12.02.2035       | 38.800      | 835                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,410           | 05.11.2034       | 115.600     | 213                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,420           | 07.03.2035       | 37.800      | (536)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,450           | 05.05.2035       | 38.200      | 667                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,460           | 01.04.2035       | 37.800      | (404)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,510           | 09.04.2035       | 37.900      | 426                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,520           | 27.03.2035       | 37.800      | (166)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,520           | 09.04.2035       | 37.900      | 399                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,547           | 09.03.2033       | 127.800     | 3.742                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,550           | 16.04.2035       | 38.000      | 272                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,580           | 29.08.2034       | 36.000      | (552)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,590           | 19.08.2034       | 35.600      | (575)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,610           | 24.03.2035       | 37.800      | 193                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,650           | 14.08.2029       | 47.600      | (1.699)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,700           | 13.08.2029       | 35.400      | (1.360)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,750           | 05.03.2034       | 35.500      | 888                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,760           | 04.03.2034       | 34.900      | 899                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,770           | 16.04.2029       | 58.000      | 1.654                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,770           | 29.04.2034       | 35.100      | 912                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,780           | 02.05.2029       | 58.700      | 1.703                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,827           | 06.05.2029       | 59.600      | 1.852                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,860           | 24.04.2029       | 46.900      | 1.527                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,950           | 12.06.2029       | 46.100      | 1.694                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,270           | 21.08.2033       | 35.300      | 3.304                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,300           | 03.10.2033       | 105.000     | 10.061                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,370           | 09.10.2028       | 62.900      | 4.458                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,450           | 20.10.2028       | 61.700      | 4.591                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 7,498           | 25.12.2025       | MXN 772.200 | (149)                                           | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 28-Day MXN-TIIE        | 7,498           | 15.01.2032       | 772.200     | (1.085)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,990           | 18.12.2029       | 446.400     | 1.226                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,020           | 17.12.2029       | 595.900     | 1.673                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,108           | 13.03.2030       | 2.323.000   | 7.149                                           | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,135           | 27.12.2029       | 546.800     | 1.665                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,150           | 31.12.2029       | 559.600     | 1.722                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,000           | 15.09.2031       | £ 53.800    | (7.337)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,020           | 15.10.2031       | 69.900      | (8.947)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,055           | 15.09.2031       | 49.800      | (6.613)                                         | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,066           | 15.09.2031       | 96.800      | (11.099)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,140           | 15.10.2031       | 135.400     | (14.890)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,250           | 15.11.2031       | 135.600     | (10.711)                                        | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,400           | 15.10.2031       | 60.700      | (4.884)                                         | 0,00                         |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                 |                  |             | \$ 1.616.546                                    | 1,63                         |
|                                                |                        |                 |                  |             | \$ 1.789.784                                    | 1,81                         |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### DEISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung             | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten    | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------|-----------|----------------------|
| GLM        | Put - OTC EUR versus USD | \$ 1,150      | 27.08.2025    | 499.900                   | \$ 3.114  | \$ 2.547  | 0,00                 |
|            | Put - OTC EUR versus USD | 1,150         | 29.08.2025    | 1.999.600                 | 12.506    | 10.452    | 0,01                 |
|            |                          |               |               |                           | \$ 15.620 | \$ 12.999 | 0,01                 |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten    | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|-----------|-----------|----------------------|
| GLM        | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 2,110 %       | 26.07.2032    | 59.200                    | \$ 9.590  | \$ 3.901  | 0,00                 |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 2,110         | 26.07.2032    | 85.900                    | 13.916    | 26.905    | 0,03                 |
| MYC        | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 2,170         | 19.07.2032    | 68.100                    | 10.801    | 4.536     | 0,01                 |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 2,170         | 19.07.2032    | 76.800                    | 12.180    | 23.509    | 0,02                 |
|            | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 2,400         | 20.07.2027    | 68.100                    | 8.986     | 1.374     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 2,400         | 20.07.2027    | 76.800                    | 10.134    | 20.751    | 0,02                 |
|            |                                       |                         |                                   |               |               |                           | \$ 65.607 | \$ 80.976 | 0,08                 |
|            |                                       |                         |                                   |               |               |                           |           |           |                      |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|---------------|---------------|---------------------------|------------|-----------|----------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850 %       | 16.07.2025    | 352.700                   | \$ (485)   | \$ (25)   | 0,00                 |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900         | 16.07.2025    | 772.800                   | (873)      | (53)      | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 1,000         | 16.07.2025    | 373.200                   | (383)      | (23)      | 0,00                 |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850         | 16.07.2025    | 351.800                   | (429)      | (25)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900         | 16.07.2025    | 373.200                   | (448)      | (25)      | 0,00                 |
|            |                                  |                     |               |               |                           | \$ (2.618) | \$ (151)  | 0,00                 |

##### DEISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------|---------------|---------------|---------------------------|------------|-----------|----------------------|
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39        | 11.08.2025    | 11.600                    | \$ (363)   | \$ (8)    | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750        | 11.08.2025    | 11.600                    | (255)      | (60)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 40,575        | 19.08.2025    | 17.600                    | (617)      | (91)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 52,725        | 19.08.2025    | 17.600                    | (383)      | (94)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600        | 12.11.2025    | 12.600                    | (479)      | (69)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900        | 12.11.2025    | 12.600                    | (351)      | (233)     | 0,00                 |
|            |                           |               |               |                           | \$ (2.448) | \$ (555)  | 0,00                 |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,555 %       | 24.07.2025    | 63.700                    | \$ (202) | \$ (230)  | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,637         | 18.07.2025    | 63.500                    | (201)    | (318)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,700         | 21.07.2025    | 63.600                    | (202)    | (492)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,770         | 09.07.2025    | 63.900                    | (204)    | (584)     | (0,01)               |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,905         | 24.07.2025    | 63.700                    | (202)    | (118)     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,037         | 18.07.2025    | 63.500                    | (201)    | (27)      | 0,00                 |
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,050         | 21.07.2025    | 63.600                    | (202)    | (29)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,120         | 09.07.2025    | 63.900                    | (204)    | (1)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,564         | 24.07.2025    | 63.600                    | (213)    | (243)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,605         | 23.07.2025    | 63.500                    | (229)    | (299)     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,914         | 24.07.2025    | 63.600                    | (194)    | (110)     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,955         | 23.07.2025    | 63.500                    | (213)    | (75)      | 0,00                 |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                            | 2,380         | 03.07.2025    | 26.100                    | (69)     | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                            | 2,460         | 16.07.2025    | 38.900                    | (120)    | (43)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                           | 2,640         | 03.07.2025    | 26.100                    | (69)     | (32)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                           | 2,720         | 16.07.2025    | 38.900                    | (120)    | (64)      | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,525         | 28.07.2025    | 64.000                    | (210)    | (212)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,583         | 23.07.2025    | 31.900                    | (112)    | (131)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,653         | 14.07.2025    | 63.400                    | (189)    | (276)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,680         | 07.07.2025    | 32.200                    | (115)    | (120)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,695         | 17.07.2025    | 63.400                    | (184)    | (441)     | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,775         | 07.07.2025    | 63.800                    | (196)    | (566)     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,875         | 28.07.2025    | 64.000                    | (210)    | (163)     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,933         | 23.07.2025    | 31.900                    | (112)    | (45)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,030         | 07.07.2025    | 32.200                    | (115)    | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,053         | 14.07.2025    | 63.400                    | (189)    | (9)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,095         | 17.07.2025    | 63.400                    | (184)    | (13)      | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,125         | 07.07.2025    | 63.800                    | (196)    | 0         | 0,00                 |

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbe-<br>trag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------|---------------|---------------|--------------------------------|------------|----------------|-----------------------------------|
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,772 %       | 10.07.2025    | 63.400                         | \$ (208)   | \$ (604)       | 0,00                              |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,122         | 10.07.2025    | 63.400                         | (208)      | (2)            | 0,00                              |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,664         | 14.07.2025    | 63.400                         | (189)      | (302)          | 0,00                              |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,669         | 07.07.2025    | 64.800                         | (243)      | (215)          | 0,00                              |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,697         | 16.07.2025    | 63.400                         | (183)      | (428)          | 0,00                              |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,715         | 02.07.2025    | 64.800                         | (232)      | (268)          | 0,00                              |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                               | 3,725         | 03.07.2025    | 64.800                         | (244)      | (345)          | 0,00                              |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,019         | 07.07.2025    | 64.800                         | (243)      | (1)            | 0,00                              |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,064         | 14.07.2025    | 63.400                         | (189)      | (8)            | 0,00                              |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,065         | 02.07.2025    | 64.800                         | (232)      | 0              | 0,00                              |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,075         | 03.07.2025    | 64.800                         | (244)      | 0              | 0,00                              |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                              | 4,097         | 16.07.2025    | 63.400                         | (183)      | (10)           | 0,00                              |
|            |                                       |                         |                                      |               |               |                                | \$ (7.455) | \$ (6.825)     | (0,01)                            |

## ZINSCAPS

|            |                                                     |                               |               |               |                           |             |             | % des Nettovermögens |
|------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|-------------|-------------|----------------------|
| Kontrahent | Beschreibung                                        | Variabler Zinssatzindex       | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld     | Marktwert   |                      |
| FAR        | Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,022 %       | 08.08.2026    | 291.100                   | \$ (5.021)  | \$ (5.943)  | (0,01)               |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,022         | 08.08.2026    | 291.100                   | (5.021)     | (153)       | 0,00                 |
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026         | 23.07.2025    | 869.400                   | (7.615)     | (3.817)     | 0,00                 |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026         | 23.07.2025    | 869.400                   | (7.615)     | 0           | 0,00                 |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026         | 23.07.2026    | 616.200                   | (10.898)    | (10.453)    | (0,01)               |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026         | 23.07.2026    | 616.200                   | (10.897)    | (411)       | 0,00                 |
|            |                                                     |                               |               |               |                           | \$ (47.067) | \$ (20.777) | (0,02)               |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|----------------|-----------------------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | \$ 92,469     | 07.07.2025    | 32.700                    | \$ (179) | \$ 0           | 0,00                              |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469        | 07.07.2025    | 32.700                    | (153)    | (12)           | 0,00                              |
|            |                                                                               |               |               |                           |          |                | \$ (332) \$ (12) 0,00             |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|------------|--------------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|-----------|-----------------------------------|
| BOA        | South Africa Government International Bond | 1,000 %                        | 20.12.2026       | \$ 5.500                  | \$ (241)                                 | \$ 262                                          | \$ 21     | 0,00                              |
| BPS        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027       | 14.700                    | (705)                                    | 664                                             | (41)      | 0,00                              |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2027       | 2.900                     | (259)                                    | 237                                             | (22)      | 0,00                              |
|            | Romania Government International Bond      | 1,000                          | 20.12.2025       | 32.000                    | 42                                       | 4                                               | 46        | 0,00                              |
| CBK        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2026       | 42.900                    | (1.989)                                  | 1.972                                           | (17)      | 0,00                              |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027       | 10.600                    | (381)                                    | 351                                             | (30)      | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2026       | 31.000                    | (203)                                    | 391                                             | 188       | 0,00                              |
| GST        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027       | 17.600                    | (687)                                    | 638                                             | (49)      | 0,00                              |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2027       | 8.200                     | (731)                                    | 669                                             | (62)      | 0,00                              |
|            | Equinix, Inc.                              | 5,000                          | 20.06.2027       | 9.000                     | 1.258                                    | (512)                                           | 746       | 0,00                              |
|            | Indonesia Government International Bond    | 1,000                          | 20.06.2030       | 15.100                    | 35                                       | 121                                             | 156       | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2027       | 2.400                     | (101)                                    | 123                                             | 22        | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2028       | 9.800                     | (103)                                    | 175                                             | 72        | 0,00                              |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 3,750                          | 24.12.2025       | 38.165                    | 0                                        | 62                                              | 62        | 0,00                              |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 4,850                          | 07.05.2026       | 602.880                   | 0                                        | 7.397                                           | 7.397     | 0,01                              |
|            | SoftBank Group Corp.                       | 1,000                          | 20.06.2026       | 43.500                    | (370)                                    | 180                                             | (190)     | 0,00                              |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2025       | 10.200                    | (565)                                    | 599                                             | 34        | 0,00                              |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026       | 4.800                     | (215)                                    | 234                                             | 19        | 0,00                              |
| JPM        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2026       | 2.200                     | (101)                                    | 100                                             | (1)       | 0,00                              |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027       | 3.500                     | (135)                                    | 125                                             | (10)      | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2026       | 33.200                    | (259)                                    | 460                                             | 201       | 0,00                              |
| MYC        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027       | 21.700                    | (781)                                    | 721                                             | (60)      | 0,00                              |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2027       | 24.900                    | (2.220)                                  | 2.031                                           | (189)     | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2025       | 5.300                     | (73)                                     | 92                                              | 19        | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2026       | 56.100                    | (326)                                    | 666                                             | 340       | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2026       | 44.400                    | 68                                       | 270                                             | 338       | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2027       | 40.600                    | (137)                                    | 508                                             | 371       | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2028       | 17.300                    | (334)                                    | 498                                             | 164       | 0,00                              |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2028       | 74.600                    | (787)                                    | 1.335                                           | 548       | 0,00                              |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026       | 124.200                   | (5.441)                                  | 5.925                                           | 484       | 0,00                              |
|            |                                            |                                |                  |                           | \$ (15.741)                              | \$ 26.298                                       | \$ 10.557 | 0,01                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | ABX.HE.AA.6-1 Index              | 0,320 %                     | 25.07.2045       | \$ 592                    | \$ (204)                              | \$ 160                                   | \$ (44)   | 0,00                 |
|            | ABX.HE.AAA.6-2 Index             | 0,110                       | 25.05.2046       | 25.802                    | (6.748)                               | 4.724                                    | (2.024)   | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AS.6 INDEX               | 1,000                       | 11.05.2063       | 80                        | 0                                     | 0                                        | 0         | 0,00                 |
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000                       | 20.12.2029       | € 57.588                  | 11.302                                | 1.156                                    | 12.458    | 0,01                 |
| BRC        | ABX.HE.AAA.6-2 Index             | 0,110                       | 25.05.2046       | \$ 2.029                  | (529)                                 | 370                                      | (159)     | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.13 INDEX             | 0,500                       | 16.12.2072       | 100.000                   | (1.840)                               | 2.202                                    | 362       | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AS.6 INDEX               | 1,000                       | 11.05.2063       | 552                       | (19)                                  | 19                                       | 0         | 0,00                 |
| DUB        | PRIMEX.ARM.2-AAA Index           | 4,580                       | 25.12.2037       | 170                       | 7                                     | (5)                                      | 2         | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.10 INDEX             | 0,500                       | 17.11.2059       | 233.645                   | (4.705)                               | 5.707                                    | 1.002     | 0,00                 |
|            | ABX.HE.AAA.6-2 Index             | 0,110                       | 25.05.2046       | 666                       | (164)                                 | 112                                      | (52)      | 0,00                 |
| GST        | CMBX.NA.AAA.10 INDEX             | 0,500                       | 17.11.2059       | 1.169.250                 | (14.905)                              | 19.918                                   | 5.013     | 0,01                 |
|            | CMBX.NA.AAA.11 INDEX             | 0,500                       | 18.11.2054       | 912.039                   | 2.357                                 | 3.146                                    | 5.503     | 0,01                 |
|            | CMBX.NA.AAA.13 INDEX             | 0,500                       | 16.12.2072       | 86.300                    | (1.494)                               | 1.806                                    | 312       | 0,00                 |
| JPS        | CMBX.NA.AAA.15 INDEX             | 0,500                       | 18.11.2064       | 473.700                   | (13.688)                              | 11.975                                   | (1.713)   | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.10 INDEX             | 0,500                       | 17.11.2059       | 171.400                   | (2.957)                               | 3.692                                    | 735       | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.11 INDEX             | 0,500                       | 18.11.2054       | 171.700                   | (1.351)                               | 2.387                                    | 1.036     | 0,00                 |
| MEI        | CMBX.NA.AAA.12 INDEX             | 0,500                       | 17.08.2061       | 45.500                    | (336)                                 | 577                                      | 241       | 0,00                 |
| MYC        | CMBX.NA.AAA.10 INDEX             | 0,500                       | 17.11.2059       | 66.700                    | (1.419)                               | 1.705                                    | 286       | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.11 INDEX             | 0,500                       | 18.11.2054       | 364.800                   | (3.092)                               | 5.293                                    | 2.201     | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.12 INDEX             | 0,500                       | 17.08.2061       | 923.900                   | (14.119)                              | 19.014                                   | 4.895     | 0,01                 |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.13 INDEX             | 0,500                       | 16.12.2072       | 379.100                   | 507                                   | 864                                      | 1.371     | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.14 INDEX             | 0,500                       | 16.12.2072       | 171.300                   | (4.147)                               | 4.213                                    | 66        | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.15 INDEX             | 0,500                       | 18.11.2064       | 74.400                    | (631)                                 | 362                                      | (269)     | 0,00                 |
| UAG        | CMBX.NA.AS.6 INDEX               | 1,000                       | 11.05.2063       | 48                        | (2)                                   | 2                                        | 0         | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.10 INDEX             | 0,500                       | 17.11.2059       | 810.495                   | (7.907)                               | 11.382                                   | 3.475     | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.11 INDEX             | 0,500                       | 18.11.2054       | 664.561                   | (913)                                 | 4.923                                    | 4.010     | 0,00                 |
| UAG        | CMBX.NA.AAA.12 INDEX             | 0,500                       | 17.08.2061       | 1.548.700                 | (13.824)                              | 22.029                                   | 8.205     | 0,01                 |
|            | CMBX.NA.AAA.13 INDEX             | 0,500                       | 16.12.2072       | 88.800                    | 0                                     | 321                                      | 321       | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.10 INDEX             | 0,500                       | 17.11.2059       | 15.500                    | (445)                                 | 511                                      | 66        | 0,00                 |
|            |                                  |                             |                  |                           | \$ (81.266)                           | \$ 128.565                               | \$ 47.299 | 0,05                 |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier                              | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|------------|----------------|-----------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|------------|------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| BPS        | Erhalt         | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 349.915                           | 1,199 %            | \$ 77.800  | 22.09.2025       | \$ 0                                  | \$ (406)                                 | \$ (406)   | 0,00                 |
|            | Erhalt         | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 116.760                           | 4,310              | 25.950     | 22.09.2025       | 0                                     | (152)                                    | (152)      | 0,00                 |
| JPM        | Erhalt         | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 730.517                           | 1,199              | 162.450    | 22.09.2025       | 0                                     | (821)                                    | (821)      | 0,00                 |
| MYC        | Erhalt         | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 982.063                           | 1,199              | 218.100    | 22.09.2025       | 0                                     | (1.391)                                  | (1.391)    | 0,00                 |
|            | Erhalt         | iBoxx USD Liquid Investment Grade Index | 35.416                            | 4,310              | 7.880      | 22.09.2025       | 0                                     | (37)                                     | (37)       | 0,00                 |
|            |                |                                         |                                   |                    |            |                  | \$ 0                                  | \$ (2.807)                               | \$ (2.807) | 0,00                 |

### TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier                                   | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|------------|----------------|----------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|------------|------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|------------|----------------------|
| MYC        | Erhalt         | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | 0                                 | 4,480 %            | \$ 400.000 | 30.06.2025       | \$ 0                                  | \$ (726)                                 | \$ (726)   | 0,00                 |
|            | Erhalt         | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | 0                                 | 4,370              | 450.000    | 03.07.2025       | 0                                     | (214)                                    | (214)      | 0,00                 |
|            | Erhalt         | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | 0                                 | 4,480              | 550.000    | 10.07.2025       | 0                                     | (643)                                    | (643)      | 0,00                 |
|            | Erhalt         | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | 0                                 | 4,470              | 375.000    | 21.07.2025       | 0                                     | (1.909)                                  | (1.909)    | 0,00                 |
|            |                |                                              |                                   |                    |            |                  | \$ 0                                  | \$ (3.492)                               | \$ (3.492) | 0,00                 |

### DEWISENTERMIKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                 | 1.534.635             | \$ 213.005                    | \$ 0                          | \$ (1.469)                                    | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 7.131                 | 9.786                         | 13                            | 13                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 172.187               | CAD 234.888                   | 0                             | (44)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 7.513.539           | € 6.417.031           | 19.089                        | 0                             | 19.089                                        | 0,02                 |
|            | 07.2025          | 43.930              | NZD 72.997            | 383                           | 0                             | 383                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD                 | 234.495               | \$ 172.187                    | 41                            | 41                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 2.179.335             | 303.098                       | 0                             | (2.292)                                       | 0,00                 |
|            | 08.2025          | €                   | 6.416.050             | 7.528.888                     | 0                             | (19.020)                                      | (0,02)               |
|            | 08.2025          | NZD                 | 72.997                | 43.977                        | 0                             | (384)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 9.787                 | £ 7.131                       | 0                             | (13)                                          | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte Wertabnahme | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | AUD                 | 96.865                | \$                            | 63.087                        | \$ 0                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 2.439                 |                               | 1.768                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 5.629                 |                               | 7.640                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PEN                 | 73.400                |                               | 20.203                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 115.814               | BRL                           | 663.312                       | 5.720                                         | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 4.707                 | €                             | 4.164                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 52.204                | IDR                           | 851.701.419                   | 250                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 61                    | ILS                           | 214                           | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 120.299               | KRW                           | 163.990.616                   | 954                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 23.262                | SGD                           | 29.787                        | 125                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 519.873               | \$                            | 72.668                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | PEN                 | 143.280               |                               | 38.905                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 29.717                |                               | 23.262                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 35.810                |                               | 1.098                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 10.2025          | PEN                 | 66.947                |                               | 18.121                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 1.481.563             |                               | 1.077.857                     | 0                                             | (0,01)               |
|            | 07.2025          | €                   | 6.349                 | £                             | 5.412                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 5.333                 | €                             | 6.349                         | 145                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 902.174               | \$                            | 665                           | 0                                             | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | NOK                 | 141.740               |                               | 14.008                        | 2                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 233.020               |                               | 24.269                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 63.953                |                               | 1.935                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 6.788.395             |                               | 208.903                       | 0                                             | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 87.450                | BRL                           | 490.892                       | 2.493                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 79                    | CAD                           | 109                           | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 51.522                | €                             | 45.190                        | 1.525                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 113.625               | IDR                           | 1.853.536.943                 | 533                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 8.507                 | THB                           | 278.621                       | 73                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 14.372                | TRY                           | 603.593                       | 720                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 97.132                | TWD                           | 2.843.543                     | 783                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 570.658               | \$                            | 79.894                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £                   | 5.423                 | €                             | 6.349                         | 37                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | PEN                 | 36.634                | \$                            | 9.883                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 7.149.209             |                               | 218.841                       | 0                                             | (0,03)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 595                   | CNH                           | 4.330                         | 12                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 86.521                | INR                           | 7.520.436                     | 960                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 4.286                 | TRY                           | 178.311                       | 46                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 10.716                | TWD                           | 350.810                       | 1.478                                         | 0,00                 |
|            | 09.2025          |                     | 15.997                | PEN                           | 57.924                        | 293                                           | 0,00                 |
|            | 05.2026          |                     | 14.622                | KWD                           | 4.456                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 06.2026          |                     | 10.548                |                               | 3.221                         | 1                                             | 0,00                 |
|            | 06.2027          |                     | 5.109                 |                               | 1.550                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 05.2029          | KWD                 | 21.985                | \$                            | 75.580                        | 3.306                                         | 0,00                 |
|            | 07.2029          |                     | 2.919                 |                               | 10.040                        | 436                                           | 0,00                 |
|            | 05.2030          |                     | 16.336                |                               | 56.257                        | 2.247                                         | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | CAD                 | 35.833                |                               | 26.074                        | 3                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 39.925                |                               | 54.123                        | 47                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 602.687               |                               | 173.104                       | 0                                             | (0,01)               |
|            | 07.2025          | KRW                 | 10.165.877            |                               | 7.440                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 109.402               |                               | 10.759                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 3.208                 |                               | 1.933                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PEN                 | 36.536                |                               | 9.898                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 121                   |                               | 95                            | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TRY                 | 1.553.055             |                               | 37.762                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 5.086                 | AUD                           | 7.805                         | 29                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 400.170               | BRL                           | 2.276.606                     | 16.955                                        | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 76.836                | €                             | 67.440                        | 2.328                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 158.042               | £                             | 117.190                       | 2.549                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 39                    | IDR                           | 640.827                       | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 85.839                | ILS                           | 289.810                       | 222                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.013                 | ¥                             | 433.370                       | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 242                   | KRW                           | 332.724                       | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 9.733                 | PLN                           | 36.467                        | 356                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 477.331               | TRY                           | 19.592.068                    | 8.075                                         | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 18                    | TWD                           | 535                           | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 17.772                | ZAR                           | 319.919                       | 206                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 1.033.318             | \$                            | 57.008                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | PEN                 | 84.011                |                               | 22.745                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 1.604.367             |                               | 49.289                        | 0                                             | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 300.000               | BRL                           | 1.721.610                     | 13.011                                        | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 14                    | CNH                           | 103                           | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 86.033                | TRY                           | 3.587.277                     | 988                                           | 0,00                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 18.155                | \$                            | 4.977                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | \$                  | 873                   | MXN                           | 16.665                        | 2                                             | 0,00                 |
|            | 10.2025          | PEN                 | 99.850                | \$                            | 27.275                        | 0                                             | 0,00                 |
| BSH        | 07.2025          |                     | 319.950               |                               | 85.947                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 68                    | AUD                           | 106                           | 1                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 65.211                | PEN                           | 235.498                       | 1.148                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | PEN                 | 7.426                 | \$                            | 2.010                         | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 200.000               | BRL                           | 1.143.020                     | 7.816                                         | 0,01                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 348.292               | \$                            | 95.276                        | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | \$                  | 150.000               | MXN                           | 2.891.796                     | 1.837                                         | 0,00                 |
|            | 09.2025          |                     | 9.910                 | PEN                           | 35.955                        | 201                                           | 0,00                 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |          |        |  |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|----------|--------|--|
| CBK        | 10.2025          | PEN                 | 81.612                | \$                            | 22.089                          | \$                                            | (834)                | 0,00     |        |  |
|            | 11.2025          |                     | 273.805               |                               | 74.356                          |                                               | (2.524)              | 0,00     |        |  |
|            | 12.2025          |                     | 448.191               |                               | 123.386                         |                                               | (2.362)              | 0,00     |        |  |
|            | 07.2025          | BRL                 | 192.380               |                               | 34.902                          |                                               | (346)                | 0,00     |        |  |
|            | 07.2025          | CAD                 | 2.034.004             |                               | 1.487.157                       |                                               | (3.856)              | 0,00     |        |  |
|            | 07.2025          | €                   | 81.869                |                               | 93.994                          |                                               | (2.108)              | 0,00     |        |  |
|            | 07.2025          | £                   | 7.479                 |                               | 10.155                          |                                               | (94)                 | 0,00     |        |  |
|            | 07.2025          | KRW                 | 916.379.129           |                               | 668.039                         |                                               | (9.523)              | (0,01)   |        |  |
|            | 07.2025          | PEN                 | 608.405               |                               | 165.369                         |                                               | (6.014)              | (0,01)   |        |  |
|            | 07.2025          | SGD                 | 344                   |                               | 270                             |                                               | 0                    | 0,00     |        |  |
|            | 07.2025          | THB                 | 3.346.520             |                               | 100.634                         |                                               | (2.413)              | 0,00     |        |  |
|            | 07.2025          | TWD                 | 11.714.817            |                               | 360.080                         |                                               | (43.208)             | (0,04)   |        |  |
|            | 07.2025          | \$                  | 21.694                | AUD                           | 33.441                          | 222                                           | 0                    | 222      | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 49.624                | CAD                           | 67.945                          | 171                                           | 0                    | 171      | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 5.892                 | CHF                           | 4.795                           | 132                                           | 0                    | 132      | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 63.466                | €                             | 54.843                          | 911                                           | 0                    | 911      | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 76.043                | £                             | 55.912                          | 576                                           | 0                    | 576      | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 86.010                | IDR                           | 1.400.630.268                   | 251                                           | 0                    | 251      | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 40.931                | PEN                           | 148.385                         | 879                                           | 0                    | 879      | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 40.401                | SEK                           | 382.911                         | 0                                             | (223)                | (223)    | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 2.993                 | SGD                           | 3.841                           | 23                                            | 0                    | 23       | 0,00   |  |
|            | 07.2025          |                     | 624.245               | TWD                           | 18.556.098                      | 14.557                                        | 0                    | 14.557   | 0,01   |  |
|            | 08.2025          | CNH                 | 488.547               | \$                            | 67.964                          | 0                                             | (496)                | (496)    | 0,00   |  |
|            | 08.2025          | HKD                 | 7.341                 |                               | 938                             | 0                                             | 0                    | 0        | 0,00   |  |
|            | 08.2025          | PEN                 | 796.887               |                               | 217.555                         | 0                                             | (6.810)              | (6.810)  | (0,01) |  |
|            | 08.2025          | SEK                 | 382.085               |                               | 40.401                          | 224                                           | 0                    | 224      | 0,00   |  |
|            | 08.2025          | TWD                 | 13.015.271            |                               | 399.431                         | 0                                             | (52.977)             | (52.977) | (0,05) |  |
|            | 08.2025          | \$                  | 396.012               | BRL                           | 2.284.040                       | 19.256                                        | 0                    | 19.256   | 0,02   |  |
|            | 08.2025          |                     | 519.046               | INR                           | 44.753.892                      | 1.868                                         | (315)                | 1.553    | 0,00   |  |
|            | 08.2025          |                     | 4.563                 | PEN                           | 16.444                          | 64                                            | 0                    | 64       | 0,00   |  |
|            | 09.2025          | ILS                 | 23.260                | \$                            | 6.155                           | 0                                             | (756)                | (756)    | 0,00   |  |
|            | 09.2025          | PEN                 | 20.198                |                               | 5.495                           | 0                                             | (185)                | (185)    | 0,00   |  |
|            | 09.2025          | \$                  | 221.899               | MXN                           | 4.274.359                       | 2.530                                         | 0                    | 2.530    | 0,00   |  |
|            | 09.2025          |                     | 50.526                | PEN                           | 180.565                         | 232                                           | 0                    | 232      | 0,00   |  |
|            | 10.2025          | PEN                 | 322.618               | \$                            | 88.104                          | 0                                             | (2.541)              | (2.541)  | 0,00   |  |
|            | 10.2025          | \$                  | 34.902                | BRL                           | 196.841                         | 342                                           | 0                    | 342      | 0,00   |  |
|            | 11.2025          | PEN                 | 524.197               | \$                            | 142.281                         | 0                                             | (4.871)              | (4.871)  | (0,01) |  |
|            | 12.2025          |                     | 132.110               |                               | 35.966                          | 0                                             | (1.094)              | (1.094)  | 0,00   |  |
| 07.2025    | CAD              | 37.747              |                       | 27.500                        | 0                               | (164)                                         | (164)                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | ILS              | 292.676             |                       | 84.443                        | 0                               | (2.469)                                       | (2.469)              | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | KRW              | 10.213.514          |                       | 7.490                         | 0                               | (61)                                          | (61)                 | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | SGD              | 4.664               |                       | 3.621                         | 0                               | (41)                                          | (41)                 | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | \$               | 9.943               | AUD                   | 15.440                        | 176                             | 0                                             | 176                  | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 7.207               | IDR                   | 117.335.511                   | 19                              | 0                                             | 19                   | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 29.695              | TWD                   | 882.740                       | 689                             | 0                                             | 689                  | 0,00     |        |  |
| 08.2025    | CNH              | 4.795               | \$                    | 671                           | 0                               | (1)                                           | (1)                  | 0,00     |        |  |
| 08.2025    | \$               | 144                 | CNH                   | 1.032                         | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00     |        |  |
| 08.2025    |                  | 248.869             | INR                   | 21.493.836                    | 1.230                           | (72)                                          | 1.158                | 0,00     |        |  |
| 09.2025    | PEN              | 80.215              | \$                    | 21.819                        | 0                               | (740)                                         | (740)                | 0,00     |        |  |
| 09.2025    | \$               | 9.767               | MXN                   | 188.309                       | 120                             | 0                                             | 120                  | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | CAD              | 8.923.166           | \$                    | 6.536.903                     | 10.666                          | (14.975)                                      | (4.309)              | (0,01)   |        |  |
| 07.2025    | CNH              | 780.654             |                       | 108.629                       | 0                               | (472)                                         | (472)                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | ¥                | 167.979.201         |                       | 1.154.020                     | 0                               | (8.908)                                       | (8.908)              | (0,01)   |        |  |
| 07.2025    | SGD              | 23.831              |                       | 18.529                        | 0                               | (182)                                         | (182)                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | \$               | 757                 | HKD                   | 5.945                         | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 2.051.080           | ¥                     | 294.243.672                   | 0                               | (14.017)                                      | (14.017)             | (0,01)   |        |  |
| 07.2025    |                  | 110.095             | PLN                   | 406.030                       | 2.217                           | 0                                             | 2.217                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 18.957              | SGD                   | 24.175                        | 24                              | 0                                             | 24                   | 0,00     |        |  |
| 08.2025    | CNH              | 602.349             | \$                    | 84.176                        | 0                               | (231)                                         | (231)                | 0,00     |        |  |
| 08.2025    | SGD              | 24.118              |                       | 18.957                        | 0                               | (26)                                          | (26)                 | 0,00     |        |  |
| 08.2025    | \$               | 1.154.020           | ¥                     | 167.361.454                   | 8.917                           | 0                                             | 8.917                | 0,01     |        |  |
| 07.2025    | BRL              | 4.376.576           | \$                    | 794.479                       | 0                               | (7.407)                                       | (7.407)              | (0,01)   |        |  |
| 07.2025    | CAD              | 52.628              |                       | 38.463                        | 0                               | (107)                                         | (107)                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | PEN              | 69.926              |                       | 18.781                        | 0                               | (912)                                         | (912)                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | SGD              | 20                  |                       | 15                            | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | TWD              | 1.150.826           |                       | 35.380                        | 0                               | (4.238)                                       | (4.238)              | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | \$               | 21.842              | IDR                   | 355.919.464                   | 78                              | 0                                             | 78                   | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 177                 | ILS                   | 602                           | 1                               | 0                                             | 1                    | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 7.403               | SGD                   | 9.437                         | 6                               | 0                                             | 6                    | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 2.680               | TWD                   | 87.063                        | 318                             | 0                                             | 318                  | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 122                 | ZAR                   | 2.198                         | 2                               | 0                                             | 2                    | 0,00     |        |  |
| 08.2025    | SGD              | 9.414               | \$                    | 7.403                         | 0                               | (7)                                           | (7)                  | 0,00     |        |  |
| 08.2025    | \$               | 1.227               | HUF                   | 444.658                       | 75                              | 0                                             | 75                   | 0,00     |        |  |
| 08.2025    |                  | 7.378               | TWD                   | 242.220                       | 1.042                           | 0                                             | 1.042                | 0,00     |        |  |
| 09.2025    | MXN              | 284.027             | \$                    | 14.800                        | 0                               | (113)                                         | (113)                | 0,00     |        |  |
| 09.2025    | \$               | 600.000             | BRL                   | 3.355.950                     | 5.629                           | 0                                             | 5.629                | 0,01     |        |  |
| 10.2025    |                  | 194.479             |                       | 1.096.611                     | 1.865                           | 0                                             | 1.865                | 0,00     |        |  |
| 12.2025    |                  | 18.280              | MXN                   | 353.890                       | 112                             | 0                                             | 112                  | 0,00     |        |  |
| 07.2025    |                  | 80                  | TWD                   | 2.380                         | 2                               | 0                                             | 2                    | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | CAD              | 1.791.856           | \$                    | 1.315.737                     | 1.941                           | 0                                             | 1.941                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | CHF              | 10.445              |                       | 12.744                        | 0                               | (377)                                         | (377)                | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | CNH              | 1.479.040           |                       | 204.933                       | 0                               | (1.771)                                       | (1.771)              | 0,00     |        |  |
| 07.2025    | £                | 2.201.431           |                       | 2.965.724                     | 0                               | (51.005)                                      | (51.005)             | (0,05)   |        |  |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
|            | 07.2025          | ILS                 | 10.073                | \$                            | 2.789                           | \$                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 56.792.209            |                               | 41.503                          |                                                | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 680.043               |                               | 529.416                         |                                                | (0,01)               |
|            | 07.2025          | TWD                 | 6.892.496             |                               | 212.289                         |                                                | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 978.321               | AUD                           | 1.492.695                       |                                                | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 200.000               | BRL                           | 1.140.015                       | 8.876                                          | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 40.528                | CAD                           | 55.414                          | 83                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 204                   | KRW                           | 278.636                         | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 302.451               | PLN                           | 1.124.131                       | 8.519                                          | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 15.282                | SGD                           | 19.567                          | 81                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 57.131                | TWD                           | 1.694.145                       | 1.206                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 825.008               | \$                            | 46.164                          | (186)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | 1.492.695             |                               | 978.933                         | 78                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 2.010.825             |                               | 279.501                         | (2.276)                                        | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 19.522                |                               | 15.282                          | (84)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 6.843.716             |                               | 210.018                         | (27.868)                                       | (0,03)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 531                   | CNH                           | 3.797                           | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 96.801                | INR                           | 8.393.096                       | 832                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | CAD                 | 1.861.879             | \$                            | 1.360.945                       | (5.210)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 79.143                |                               | 96.307                          | (3.119)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 709.056               |                               | 98.391                          | (703)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 31.809                |                               | 36.931                          | (408)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 202.964               |                               | 275.266                         | (2.866)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HKD                 | 4.326                 |                               | 551                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 4.442                 |                               | 3.462                           | (25)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 1.679.898             |                               | 50.756                          | (972)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 3.266.982             |                               | 100.242                         | (12.226)                                       | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 593.366               | CAD                           | 815.040                         | (59)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 901.581               | €                             | 779.216                         | 13.101                                         | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 142.347               | £                             | 105.126                         | (32)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 5.410                 | HKD                           | 42.315                          | (12)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 19.794                | IDR                           | 321.699.486                     | 18                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 89.788                | ¥                             | 12.900.242                      | (479)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.215                 | NZD                           | 2.010                           | 5                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 74.812                | PLN                           | 280.128                         | 2.690                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 401.935               | SGD                           | 519.783                         | 6.170                                          | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 99.623                | TWD                           | 3.152.385                       | 8.898                                          | 0,01                 |
|            | 08.2025          | CAD                 | 723.908               | \$                            | 527.513                         | (3.917)                                        | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 1.337.778             |                               | 185.794                         | (1.668)                                        | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 518.589               |                               | 401.935                         | (6.251)                                        | (0,01)               |
|            | 08.2025          | TWD                 | 5.222.756             |                               | 161.283                         | (20.259)                                       | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 347.594               | CNH                           | 2.515.542                       | 4.909                                          | 0,01                 |
| MYI        | 09.2025          | PEN                 | 98.626                | \$                            | 27.234                          | (501)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 2.549                 |                               | 1.664                           | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 672                   |                               | 840                             | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 12.279                |                               | 1.712                           | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 7.138                 |                               | 8.362                           | (16)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 231                   |                               | 317                             | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HUF                 | 5.114                 |                               | 15                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 53.715.166            |                               | 368.353                         | (3.522)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 26.794                |                               | 21.015                          | (22)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 28                    | AUD                           | 43                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 21.017                | CAD                           | 28.863                          | 136                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 53                    | CHF                           | 42                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 20.754                | £                             | 15.120                          | (36)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.284                 | HKD                           | 25.693                          | (6)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 46.528                | ¥                             | 6.721.609                       | 6                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 29.857                | NOK                           | 301.168                         | (96)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 575                   | PLN                           | 2.122                           | 12                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 56                    | SGD                           | 71                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 13.097                | ZAR                           | 236.825                         | 208                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 613.889               | \$                            | 85.748                          | (276)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 301.113               |                               | 29.857                          | 96                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 367.389               | ¥                             | 53.378.868                      | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 13.994                | \$                            | 10.175                          | (81)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 230.005               |                               | 280.450                         | (8.501)                                        | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 279                   | HKD                           | 2.186                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | HKD                 | 2.179                 | \$                            | 279                             | 0                                              | 0,00                 |
| RYL        | 07.2025          | \$                  | 1.527                 | £                             | 1.128                           | 19                                             | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | CAD                 | 63.130                | \$                            | 45.932                          | (356)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 794                   |                               | 111                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 341                   |                               | 463                             | (5)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 4.452                 |                               | 1.284                           | (38)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 77.662                |                               | 538                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 16.547                |                               | 9.994                           | (51)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 233.262               |                               | 8.010                           | (20)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.413                 | €                             | 1.236                           | 38                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 18.864                | £                             | 13.906                          | 192                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 101.584               | IDR                           | 1.655.267.755                   | 359                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 80.265                | SGD                           | 103.526                         | 1.018                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 223.734               | TWD                           | 6.565.996                       | 2.303                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 1.057.655             | \$                            | 148.058                         | (151)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 103.291               |                               | 80.265                          | (1.036)                                        | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 1.827.301             |                               | 56.005                          | (7.512)                                        | (0,01)               |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| SOG        | 08.2025          | \$                  | 403.059               | CNH                           | 2.917.780                       | \$ 5.809                                       | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 75.598                | INR                           | 6.490.345                       | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 538                   | ¥                             | 77.376                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 9.624                 | \$                            | 2.659                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 7.763.347             |                               | 53.781                          | 35                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 7                     |                               | 6                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 66.841                | CAD                           | 91.173                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 407                   | €                             | 353                             | 8                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.123                 | NOK                           | 31.356                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NOK                 | 31.350                | \$                            | 3.123                           | 25                                             | 0,00                 |
| SSB        | 08.2025          | \$                  | 58                    | HUF                           | 20.987                          | 4                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 581                   | INR                           | 50.100                          | 2                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 53.781                | ¥                             | 7.734.859                       | 0                                              | 0,00                 |
|            | 09.2025          |                     | 202.486               | MXN                           | 3.902.538                       | 2.420                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 6.485                 | \$                            | 904                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 2.140                 |                               | 2.880                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PEN                 | 27.795                |                               | 7.543                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 2.952.356             | £                             | 2.153.123                       | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD                 | 94.345                | \$                            | 69.236                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 370                   |                               | 52                              | 0                                              | 0,00                 |
| UAG        | 08.2025          | £                   | 2.153.123             |                               | 2.952.737                       | 1.778                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 1                     |                               | 1                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 1.688.232             |                               | 51.898                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 203.117               | BRL                           | 1.164.346                       | 8.576                                          | 0,01                 |
|            | 10.2025          |                     | 38                    | PEN                           | 140                             | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 6.684                 | \$                            | 4.895                           | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 405                   |                               | 548                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HKD                 | 5.227                 |                               | 666                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 34.281                |                               | 9.554                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 8.868.369             |                               | 6.542                           | 0                                              | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | NOK                 | 81.370                |                               | 8.013                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 175.012               |                               | 18.214                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 151                   |                               | 118                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 266.747               |                               | 8.028                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 964                   | CNH                           | 6.908                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 15.094                | £                             | 11.144                          | 178                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 29.905                | ¥                             | 4.328.507                       | 62                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 6.542                 | KRW                           | 8.872.659                       | 18                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.243                 | NZD                           | 2.047                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 6.890                 | \$                            | 964                             | 0                                              | 0,00                 |
| WST        | 08.2025          | \$                  | 151.058               | CNH                           | 1.096.550                       | 2.601                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 5.376                 | TRY                           | 239.181                         | 399                                            | 0,00                 |
|            | 11.2025          |                     | 2.142                 |                               | 100.952                         | 119                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 1.452.666             | \$                            | 936.657                         | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 9.515.705             |                               | 10.750.092                      | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 89.203.621            |                               | 619.427                         | 1.865                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 78.535                |                               | 46.837                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 2.683.157             | €                             | 2.288.114                       | 2.744                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 14.107                | NZD                           | 23.283                          | 27                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | €                   | 2.288.114             | \$                            | 2.689.014                       | 0                                              | 0,00                 |
| WST        | 08.2025          | NZD                 | 23.283                |                               | 14.122                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 619.427               | ¥                             | 88.875.325                      | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 272.274                    | \$ (958.798)                    | \$ (686.524)                                   | (0,70)               |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Institutional AUD (Hedged) ausschüttend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend, Administrative AUD (Hedged) thesaurierend, Administrative AUD (Hedged) ausschüttend, Class E AUD (Hedged) ausschüttend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD                 | 1.016.578             | \$                            | 660.369                         | \$ 0                                           | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 660.755               | AUD                           | 1.016.578                       | 5.880                                          | 0,01                 |
| BOA        | 07.2025          | AUD                 | 4.263                 | \$                            | 2.761                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 5.114                 | AUD                           | 7.883                           | 53                                             | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | AUD                 | 306                   | \$                            | 199                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 3.650                 |                               | 2.377                           | 0                                              | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | \$                  | 588.879               | AUD                           | 913.751                         | 9.948                                          | 0,01                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 3.154                 | \$                            | 2.053                           | 0                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | \$                  | 5.397                 | AUD                           | 8.268                           | 21                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 14.629                |                               | 22.717                          | 259                                            | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | AUD                 | 1.010.571             | \$                            | 660.711                         | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 649.827               | AUD                           | 1.007.178                       | 10.227                                         | 0,01                 |
| JPM        | 08.2025          |                     | 661.118               |                               | 1.010.571                       | 1.578                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 917.713               | \$                            | 601.475                         | 51                                             | 0,00                 |
| MBC        | 08.2025          | \$                  | 601.851               | AUD                           | 917.713                         | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 17.267                | \$                            | 11.088                          | 0                                              | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | \$                  | 3.831                 | AUD                           | 5.910                           | 42                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 650.209               |                               | 1.008.413                       | 10.654                                         | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 38.713                     | \$ (7.751)                      | \$ 30.962                                      | 0,03                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | BRL                    | \$                       | 50.765                           | \$                                 | (350)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | BRL                      | 675.083                          | 5.821                              | 5.821                                                | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 278.980                          | 342                                | 342                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | BRL                    | \$                       | 25.056                           | 0                                  | (822)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | BRL                      | 717.933                          | 5.589                              | 5.589                                                | 0,01                    |
| BSH        | 07.2025          | BRL                    | \$                       | 121.144                          | 0                                  | (1.934)                                              | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | BRL                      | 676.861                          | 1.918                              | 1.918                                                | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | BRL                    | \$                       | 91.905                           | 0                                  | (899)                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | BRL                      | 509.630                          | 874                                | 874                                                  | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | BRL                    | \$                       | 95.208                           | 0                                  | (916)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | BRL                      | 51.036                           | 309                                | 309                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | BRL                    | \$                       | 744                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | BRL                      | 519.375                          | 846                                | 846                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | BRL                    | \$                       | 3.794                            | 0                                  | (156)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | BRL                      | 700.610                          | 5.507                              | 5.507                                                | 0,01                    |
| SOG        | 08.2025          |                        |                          | 17.931                           | 21                                 | 21                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$                                 | (5.085)                                              |                         |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 21.227                             | 16.142                                               | 0,02                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD                    | \$                       | 23.174                           | \$                                 | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | CAD                      | 31.560                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          |                        |                          | 149                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          |                        |                          | 37.030                           | 333                                | 333                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | CAD                    | \$                       | 1.855                            | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | \$                     | CAD                      | 56.213                           | 532                                | 532                                                  | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          |                        |                          | 1.668                            | 11                                 | 11                                                   | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CAD                    | \$                       | 42.985                           | 0                                  | (306)                                                | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CAD                      | 55.739                           | 267                                | 267                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 41.396                           | 307                                | 307                                                  | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | CAD                    | \$                       | 1.234                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025          | \$                     | CAD                      | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          |                        |                          | 75                               | 103                                | 1                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | CAD                    | \$                       | 40.825                           | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | CAD                      | 55.624                           | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$                                 | (342)                                                |                         |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 1.465                              | 1.123                                                | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CHF                    | \$                       | 474.180                          | \$                                 | (1.608)                                              | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | CHF                      | 377.160                          | 1.609                              | 1.609                                                | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | CHF                    | \$                       | 2.420                            | 0                                  | (62)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CHF                      | 8.900                            | 309                                | 309                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | CHF                    | \$                       | 195                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CHF                      | 3.650                            | 157                                | 157                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        |                          | 19.903                           | 451                                | 451                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | CHF                    | \$                       | 472.438                          | 0                                  | (2.712)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CHF                      | 356.589                          | 14.947                             | 14.947                                               | 0,02                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 472.438                          | 2.723                              | 2.723                                                | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          |                        |                          | 5.687                            | 4.661                              | 168                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CHF                    | \$                       | 185                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CHF                      | 362.345                          | 14.079                             | 14.079                                               | 0,02                    |
| MYI        | 07.2025          | CHF                    | \$                       | 1.738                            | 0                                  | (42)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CHF                      | 2.279                            | 61                                 | 61                                                   | 0,00                    |
| RBC        | 07.2025          |                        |                          | 400.472                          | 12.139                             | 12.139                                               | 0,01                    |
| SCX        | 07.2025          |                        |                          | 1.685                            | 1.374                              | 42                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          |                                  | \$                                 | (4.435)                                              |                         |
|            |                  |                        |                          | \$                               | 46.685                             | 42.250                                               | 0,05                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | \$                       | 6.346.054                        | \$                                 | (16.094)                                             | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | €                        | 1.830.280                        | 68.869                             | 68.869                                               | 0,07                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 6.359.961                        | 16.067                             | 16.067                                               | 0,02                    |
| BOA        | 07.2025          |                        |                          | 6.636.812                        | 5.836.874                          | 214.800                                              | 0,22                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BPS        | 07.2025          | €                   | 31.945                | \$ 36.250                     | \$ 0                            | \$ (1.248)                                     | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 52.102                | € 45.037                      | 765                             | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          |                     | 6.895.864             | € 6.071.399                   | 231.045                         | 0                                              | 0,23                 |
| CBK        | 07.2025          | €                   | 15.052                | \$ 17.242                     | 0                               | (426)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 46.019                | € 39.857                      | 766                             | 0                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | €                   | 6.003.747             | \$ 6.964.947                  | 0                               | (82.549)                                       | (0,08)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 6.964.947             | € 5.990.586                   | 82.442                          | 0                                              | 0,08                 |
| MBC        | 07.2025          | €                   | 59.981                | \$ 69.518                     | 0                               | (891)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 56.162                | € 48.894                      | 1.232                           | 0                                              | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | €                   | 5.953.637             | \$ 6.981.532                  | 0                               | (7.141)                                        | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 4.091.206             | € 3.621.430                   | 159.808                         | 0                                              | 0,16                 |
|            | 08.2025          |                     | 6.996.773             | € 5.953.637                   | 7.147                           | 0                                              | 0,01                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 782.941                    | \$ (108.349)                    | \$ 674.592                                     | 0,68                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £                   | 498.233               | \$ 683.675                    | \$ 922                          | \$ 922                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 683.771               | £ 498.233                     | 0                               | (919)                                          | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          |                     | 2.382                 | £ 1.755                       | 23                              | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | £                   | 637.308               | \$ 866.758                    | 0                               | (6.576)                                        | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 687.944               | £ 509.538                     | 10.303                          | (2)                                            | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 760.131               | £ 558.593                     | 5.448                           | 0                                              | 0,01                 |
| CBK        | 07.2025          | £                   | 711                   | \$ 967                        | 0                               | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 112.869               | £ 83.132                      | 1.051                           | 0                                              | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          |                     | 730.655               | £ 542.359                     | 12.566                          | 0                                              | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025          | £                   | 8.653                 | \$ 11.893                     | 36                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 28.939                | £ 21.360                      | 331                             | 0                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | £                   | 553.628               | \$ 759.133                    | 469                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 731.557               | £ 540.286                     | 8.823                           | 0                                              | 0,01                 |
|            | 08.2025          |                     | 759.231               | £ 553.628                     | 0                               | (457)                                          | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          |                     | 139                   | £ 102                         | 2                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 39.974                     | \$ (7.961)                      | \$ 32.013                                      | 0,03                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklasse Class E HUF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 08.2025          | \$                  | 1.505                 | HUF 543.144                   | \$ 86                           | \$ 86                                          | 0,00                 |
| BPS        | 08.2025          |                     | 3                     | HUF 931                       | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 08.2025          | HUF                 | 4.260                 | \$ 12                         | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
| CIB        | 08.2025          | \$                  | 11                    | HUF 3.941                     | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| MBC        | 08.2025          |                     | 138                   | HUF 48.251                    | 4                               | 0                                              | 0,00                 |
| MYI        | 08.2025          |                     | 190                   | HUF 66.617                    | 5                               | 0                                              | 0,00                 |
| RYL        | 08.2025          |                     | 1.508                 | HUF 546.936                   | 94                              | 0                                              | 0,00                 |
| SOG        | 08.2025          |                     | 1.492                 | HUF 540.811                   | 93                              | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 282                        | \$ (1)                          | \$ 281                                         | 0,00                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend, Institutional JPY (Hedged) ausschüttend, Investor JPY (Hedged) thesaurierend, Class E JPY (Hedged) thesaurierend und Class E JPY (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BOA        | 07.2025          | \$                  | 2.022                 | ¥ 290.782                     | \$ 0                            | \$ (9)                                         | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | ¥                   | 1.209.549             | \$ 8.406                      | 32                              | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | \$                  | 49.357                | ¥ 7.098.531                   | 0                               | (213)                                          | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          |                     | 19.290                | ¥ 2.746.626                   | 0                               | (275)                                          | 0,00                 |
| FAR        | 07.2025          | ¥                   | 38.344.476            | \$ 263.427                    | 0                               | (2.033)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 460.641               | ¥ 66.082.632                  | 0                               | (3.148)                                        | (0,01)               |
|            | 08.2025          |                     | 263.427               | ¥ 38.203.464                  | 2.036                           | 0                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | ¥                   | 601.220               | \$ 4.147                      | 3                               | (18)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 466.557               | ¥ 67.081.070                  | 54                              | (2.206)                                        | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          | ¥                   | 34.264.883            | \$ 235.566                    | 50                              | (1.701)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 221.447               | ¥ 31.991.226                  | 30                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 233.829               | ¥ 33.890.602                  | 1.703                           | (38)                                           | 0,00                 |
| RYL        | 07.2025          | ¥                   | 347.692               | \$ 2.415                      | 8                               | 0                                              | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          |                     | 2.391.619             | ¥ 16.594                      | 36                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.454                 | ¥ 209.779                     | 2                               | (4)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 10.929                | ¥ 1.572.665                   | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
| SOG        | 07.2025          | ¥                   | 69.175.667            | \$ 479.211                    | 314                             | (10)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 477.381               | ¥ 68.657.052                  | 0                               | (306)                                          | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | ¥                   | 148.800               | \$ 1.031                      | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 257.915               | ¥ 37.331.441                  | 532                             | 0                                              | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | ¥                   | 65.932.794            | \$ 457.835                    | 1.379                           | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 457.835               | ¥ 65.690.141                  | 0                               | (1.376)                                        | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 6.179                      | \$ (11.339)                     | \$ (5.160)                                     | (0,01)               |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 07.2025          | NOK                    | \$                       | 2.119                            | 210                                | \$ 1                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | NOK                      | 54                               | 550                                | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        |                          | 86.659                           | 882.714                            | 568                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        |                          | 3.185                            | 32.339                             | 14                                                   | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          |                        |                          | 40                               | 400                                | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | NOK                    | \$                       | 810.989                          | 80.399                             | 259                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | NOK                      | 86.659                           | 881.128                            | 411                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 80.399                           | 810.840                            | 0                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | NOK                    | \$                       | 27                               | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | NOK                      | 19                               | 190                                | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | NOK                    | \$                       | 886.532                          | 88.299                             | 694                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | NOK                      | 88.299                           | 886.362                            | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          |                        |                          | 78.713                           | 799.344                            | 275                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 2.222                         | \$ (956)                           | \$ 1.266                                             | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional RMB (Hedged) ausschüttend, Investor RMB (Hedged) thesaurierend und Class E RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BPS        | 07.2025          | \$                     | CNH                      | 1.851                            | 13.282                             | \$ 3                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          |                        |                          | 2.452                            | 17.582                             | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        |                          | 61.323                           | 439.948                            | 95                                                   | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          |                        |                          | 9.000                            | 64.646                             | 25                                                   | 0,00                    |
| IND        | 07.2025          |                        |                          | 637                              | 4.573                              | 1                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | CNH                    | \$                       | 40                               | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CNH                      | 264                              | 1.891                              | 0                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | CNH                    | \$                       | 12.117                           | 1.689                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CNH                      | 2.474                            | 17.751                             | 4                                                    | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | CNH                    | \$                       | 47.487                           | 6.622                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CNH                      | 195                              | 1.399                              | 1                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025          |                        |                          | 64.982                           | 465.755                            | 39                                                   | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          |                        |                          | 67.708                           | 486.191                            | 166                                                  | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | CNH                    | \$                       | 506.319                          | 70.631                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CNH                      | 1.012                            | 7.252                              | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 70.631                           | 505.005                            | 45                                                   | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | CNH                    | \$                       | 480.686                          | 67.087                             | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | CNH                      | 1.887                            | 13.547                             | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 67.087                           | 479.487                            | 17                                                   | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 404                           | \$ (81)                            | \$ 323                                               | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BRC        | 07.2025          | \$                     | SEK                      | 91                               | 873                                | \$ 1                                                 | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          | SEK                    | \$                       | 984                              | 104                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | SEK                      | 4                                | 37                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 104                              | 982                                | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          |                        |                          | 101                              | 968                                | 1                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          |                        |                          | 101                              | 971                                | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 4                             | \$ (2)                             | \$ 2                                                 | 0,00                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD                    | \$                       | 1.549.100                        | 1.209.762                          | \$ 0                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | SGD                      | 150.410                          | 193.866                            | 1.803                                                | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 1.209.762                        | 1.545.480                          | 6.699                                                | 0,01                    |
| BRC        | 07.2025          |                        |                          | 22.601                           | 29.074                             | 227                                                  | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025          |                        |                          | 157.716                          | 202.167                            | 1.018                                                | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          |                        |                          | 1.453.822                        | 1.872.872                          | 16.654                                               | 0,02                    |
| FAR        | 07.2025          | SGD                    | \$                       | 3.414.536                        | 2.677.251                          | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | SGD                      | 2.796.146                        | 3.597.225                          | 28.198                                               | 0,03                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 2.677.251                        | 3.406.400                          | 3.957                                                | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025          | SGD                    | \$                       | 1.508.776                        | 1.183.632                          | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | SGD                      | 1.183.632                        | 1.505.148                          | 1.083                                                | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          | SGD                    | \$                       | 1.568.615                        | 1.225.098                          | 0                                                    | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | SGD                      | 3.238.889                        | 4.160.401                          | 27.630                                               | 0,03                    |
|            | 08.2025          |                        |                          | 1.225.098                        | 1.565.002                          | 6.729                                                | 0,01                    |
| MBC        | 07.2025          | SGD                    | \$                       | 3.909.684                        | 3.023.406                          | 0                                                    | (0,05)                  |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|                                  | 07.2025          | \$ 2.401.121           | SGD 3.080.343            | \$ 17.395                        | \$ 0                               | \$ 17.395                                            | 0,02                    |
|                                  | 08.2025          | 2.983.362              | 3.849.223                | 46.396                           | 0                                  | 46.396                                               | 0,05                    |
| MYI                              | 07.2025          | 49.124                 | 63.137                   | 448                              | 0                                  | 448                                                  | 0,00                    |
| SCX                              | 07.2025          | SGD 656.225            | \$ 508.779               | 0                                | (6.453)                            | (6.453)                                              | (0,01)                  |
|                                  | 08.2025          | \$ 508.779             | SGD 654.734              | 6.568                            | 0                                  | 6.568                                                | 0,01                    |
| SSB                              | 07.2025          | 26.686                 | 34.041                   | 41                               | 0                                  | 41                                                   | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025          | 4.514                  | 5.797                    | 37                               | 0                                  | 37                                                   | 0,00                    |
|                                  |                  |                        |                          | \$ 164.883                       | \$ (70.350)                        | \$ 94.533                                            | 0,10                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ 319.015                                           | 0,32                    |

| BESCHREIBUNG                               | PARI (000S)   | MARKT<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|---------------|-------------------------|-----------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |               |                         |                                   |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 11.627.372 | \$ 16.665               | 0,02                              |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |               | \$ 16.665               | 0,02                              |

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

#### US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

|                                      |         |              |        |
|--------------------------------------|---------|--------------|--------|
| Ginnie Mae, TBA                      |         |              |        |
| 2.500 % fällig am 01.07.2055         | 33.900  | (28.807)     | (0,03) |
| 4.000 % fällig am 01.07.2055 (k)     | 77.600  | (72.163)     | (0,07) |
| 6.000 % fällig am 01.07.2055 (k)     | 3.000   | (3.045)      | (0,01) |
| Uniform Mortgage-Backed Security TBA |         |              |        |
| 3.500 % fällig am 01.07.2055 (k)     | 289.076 | (260.295)    | (0,26) |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere      |         | \$ (364.310) | (0,37) |

|                             |                 |         |
|-----------------------------|-----------------|---------|
| Summe Anlagen               | \$ 149.196.055  | 150,67  |
| Sonstige Aktiva und Passiva | \$ (50.172.835) | (50,67) |
| Nettovermögen               | \$ 99.023.220   | 100,00  |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

- \* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.
- μ Der gesamte Betrag oder ein Teil davon stellt ungedeckte Darlehenszusagen dar. Der Zinssatz für den ungedeckten Anteil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.
- ^ Das Wertpapier ist in Verzug.
- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Reines Kapitalwertpapier.
- (c) Wertpapier per Emissionstermin.
- (d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.
- (e) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.
- (f) Nullkuponwertpapier.
- (g) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (h) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (i) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (j) Mit dem Fonds verbunden.
- (k) Ein zum 30. Juni 2025 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.
- (l) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,61 %):

| Emittentenbeschreibung                                           | Kaufdatum               | Kosten     | Marktwert  | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------------------------------------|-------------------------|------------|------------|-------------------------|
| AMSURG Corp.                                                     | 02.11.2023 - 06.11.2023 | \$ 146.801 | \$ 158.611 | 0,16                    |
| Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046                       | 18.04.2019              | 13.214     | 18.286     | 0,02                    |
| Chester A PLC 1,000 % fällig am 20.05.2046                       | 18.04.2019              | 17.298     | 5.317      | 0,01                    |
| Chester A PLC 5,639 % fällig am 17.03.2046                       | 18.04.2019              | 24.743     | 26.170     | 0,03                    |
| Chester A PLC 6,489 % fällig am 17.03.2046                       | 18.04.2019              | 19.159     | 20.235     | 0,02                    |
| Chester A PLC 7,389 % fällig am 17.03.2046                       | 18.04.2019              | 17.790     | 18.804     | 0,02                    |
| Chester A PLC 8,239 % fällig am 17.03.2046                       | 18.04.2019              | 10.947     | 11.579     | 0,01                    |
| Chester A PLC 8,739 % fällig am 17.03.2046                       | 18.04.2019              | 5.473      | 5.786      | 0,01                    |
| Clover Holdings, Inc. 0,000 %                                    | 09.12.2024              | 348        | 409        | 0,00                    |
| Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10/06/2071    | 10.06.2022              | 0          | 0          | 0,00                    |
| Constellation Pharmaceuticals, Inc. 5,550 % fällig am 01.07.2033 | 16.01.2025              | 30.709     | 31.180     | 0,03                    |
| Copa PPN Placeholder 0,010 % fällig am 31.12.2030                | 03.04.2025              | 120.080    | 126.776    | 0,13                    |
| Corestate Capital Holding S.A.                                   | 22.08.2023              | 0          | 0          | 0,00                    |

| Emittentenbeschreibung                                              | Kaufdatum               | Kosten       | Marktwert  | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------------------------------|-------------------------|--------------|------------|----------------------|
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,520 % fällig am 20.03.2028 | 20.02.2025              | \$ 30.200    | \$ 30.402  | 0,03                 |
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,740 % fällig am 20.03.2030 | 20.02.2025              | 35.600       | 35.992     | 0,04                 |
| Deloitte LLP 5,250 % fällig am 30.01.2030                           | 30.10.2024              | 12.400       | 12.562     | 0,01                 |
| Deloitte LLP 5,410 % fällig am 30.01.2032                           | 30.10.2024              | 12.200       | 12.294     | 0,01                 |
| DreamWell Ltd.                                                      | 24.04.2024              | 701          | 3          | 0,00                 |
| Hardwood Funding LLC 4,840 % fällig am 07.06.2028                   | 11.03.2025              | 9.600        | 9.657      | 0,01                 |
| Hardwood Funding LLC 4,980 % fällig am 07.06.2030                   | 11.03.2025              | 6.200        | 6.262      | 0,01                 |
| Incora                                                              | 31.01.2025              | 16.482       | 11.464     | 0,01                 |
| Incora Top Holdco LLC 6,000 % fällig am 30.01.2033                  | 31.01.2025              | 7.278        | 10.091     | 0,01                 |
| Intelsat Emergence S.A.                                             | 19.06.2017 - 23.02.2022 | 440.150      | 160.738    | 0,16                 |
| MNSN Holdings, Inc.                                                 | 20.03.2023 - 13.09.2024 | 3            | 1          | 0,00                 |
| Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032                         | 11.02.2020              | 61.331       | 47.550     | 0,05                 |
| Pantheon Senior Debt Secondaries 6,317 % fällig am 26.03.2026       | 18.03.2025              | 31.300       | 31.300     | 0,03                 |
| Prime Property 5,250 % fällig am 30.09.2029                         | 17.09.2024              | 18.100       | 18.085     | 0,02                 |
| Prime Property 5,440 % fällig am 30.09.2031                         | 17.09.2024              | 18.100       | 18.042     | 0,02                 |
| Project Alfa 4,256 % fällig am 27.02.2026                           | 28.02.2025              | 18.575       | 20.966     | 0,02                 |
| Serta Simmons Bedding LLC                                           | 29.06.2023              | 701          | 0          | 0,00                 |
| Sierra Hamilton Holder LLC                                          | 31.07.2017              | 560          | 0          | 0,00                 |
| VD DPR Finance Co, 6,833 % fällig am 15.03.2035                     | 31.01.2025              | 27.500       | 26.961     | 0,03                 |
| Westmoreland Mining LLC                                             | 08.12.2014 - 19.12.2019 | 1.491        | 32         | 0,00                 |
| Westmoreland Mining LLC                                             | 03.07.2023              | 338          | 120        | 0,00                 |
|                                                                     |                         | \$ 1.155.372 | \$ 875.675 | 0,90                 |

(m) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 238.339 USD (31. Dezember 2024: 52.492 USD) und Barmittel in Höhe von 36.132 USD (31. Dezember 2024: 2.446 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 602 USD (31. Dezember 2024: 158 USD) und Barmittel in Höhe von 280 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 2.733.754 USD (31. Dezember 2024: 2.256.212 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 7433.829 USD (31. Dezember 2024: 523.210 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert <sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert      |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 236.306                                                                  | \$ 130.820.171                                                  | \$ 1.704.300                                                 | \$ 132.760.777 |
| Investmentfonds                     | 3.068.448                                                                   | 0                                                               | 0                                                            | 3.068.448      |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 11.050.325                                                      | 0                                                            | 11.050.325     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 189.880                                                                     | 2.474.270                                                       | 0                                                            | 2.664.150      |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 16.665                                                          | 0                                                            | 16.665         |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (364.310)                                                       | 0                                                            | (364.310)      |
| Summen                              | \$ 3.494.634                                                                | \$ 143.997.121                                                  | \$ 1.704.300                                                 | \$ 149.196.055 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert      |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 254.928                                                                  | \$ 125.928.776                                                  | \$ 960.483                                                   | \$ 127.144.187 |
| Investmentfonds                     | 2.522.728                                                                   | 290.705                                                         | 0                                                            | 2.813.433      |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 1.454.616                                                       | 0                                                            | 1.454.616      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (51.055)                                                                    | 2.312.872                                                       | (2.347)                                                      | 2.259.470      |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 17.358                                                          | 0                                                            | 17.358         |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (586.515)                                                       | 0                                                            | (586.515)      |
| Summen                              | \$ 2.726.601                                                                | \$ 129.417.812                                                  | \$ 958.136                                                   | \$ 133.102.549 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BAR        | 0,000 %    | 26.06.2025       | 17.07.2025       | \$ (130.575) | \$ (130.575)                             | (0,13)               |
| BOS        | 3,750      | 27.06.2025       | 01.08.2025       | (2.927)      | (2.929)                                  | 0,00                 |
|            | 4,250      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (33.920)     | (33.952)                                 | (0,04)               |
|            | 4,290      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (1.903)      | (1.905)                                  | 0,00                 |
|            | 4,300      | 18.06.2025       | 01.08.2025       | (978)        | (979)                                    | 0,00                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
|                                    | 4,300 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025       | \$ (1.734)   | \$ (1.736)                               | 0,00                 |
|                                    | 4,330      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (6.093)      | (6.099)                                  | (0,01)               |
| BPS                                | 4,280      | 30.05.2025       | 29.05.2027       | (10.880)     | (10.922)                                 | (0,01)               |
| BRC                                | 4,250      | 22.05.2025       | 21.05.2027       | (2.687)      | (2.700)                                  | 0,00                 |
| JPS                                | 4,000      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (9.827)      | (9.836)                                  | (0,01)               |
| MYI                                | 4,100      | 15.01.2025       | 15.01.2027       | (17.042)     | (17.043)                                 | (0,02)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |              | \$ (218.676)                             | (0,22)               |

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                 |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                 |                                    |                                 |
|------------|-----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarkt-wert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarkt-wert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 65.186                         | \$ (58.590)                        | \$ 6.596                        | \$ (22.535)                       | \$ 15.280                          | \$ (7.255)                      |
| BOA        | 222.837                           | (210.510)                          | 12.327                          | (5.330)                           | (5.430)                            | (10.760)                        |
| BPS        | (32.049)                          | 35.070                             | 3.021                           | (29.074)                          | 22.270                             | (6.804)                         |
| BRC        | 278.354                           | (252.840)                          | 25.514                          | 117.327                           | (94.410)                           | 22.917                          |
| BSH        | (1.663)                           | 2.080                              | 417                             | 849                               | (1.740)                            | (891)                           |
| CBK        | (93.124)                          | 35.749                             | (57.375)                        | 34.443                            | (105.691)                          | (71.248)                        |
| CIB        | (164)                             | 0                                  | (164)                           | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           |
| DUB        | 16.683                            | (15.290)                           | 1.393                           | (168.703)                         | 150.900                            | (17.803)                        |
| FAR        | 27.469                            | (39.380)                           | (11.911)                        | (42.258)                          | 38.360                             | (3.898)                         |
| GLM        | 38.510                            | (1.570)                            | 36.940                          | 939                               | 25.200                             | 26.139                          |
| GSC        | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           | 2.093                             | 0                                  | 2.093                           |
| GST        | 17.192                            | (75.900)                           | (58.708)                        | (712)                             | (2.314)                            | (3.026)                         |
| IND        | 3                                 | (20)                               | (17)                            | 1.699                             | (1.470)                            | 229                             |
| JPM        | (47.520)                          | 52.890                             | 5.370                           | 38.444                            | (33.610)                           | 4.834                           |
| JPS        | 1.771                             | (1.640)                            | 131                             | 383                               | (440)                              | (57)                            |
| MBC        | 14.500                            | (6.640)                            | 7.860                           | (89.293)                          | 66.380                             | (22.913)                        |
| MEI        | 241                               | 0                                  | 241                             | 11                                | 0                                  | 11                              |
| MYC        | 39.557                            | 1.700                              | 41.257                          | 21.588                            | (1.680)                            | 19.908                          |
| MYI        | 925                               | (790)                              | 135                             | (18.616)                          | 5.060                              | (13.556)                        |
| RBC        | 3.507                             | (2.890)                            | 617                             | 28.608                            | (23.120)                           | 5.488                           |
| RYL        | 115                               | 0                                  | 115                             | (417)                             | 340                                | (77)                            |
| SAL        | 15.999                            | (15.140)                           | 859                             | 1.877                             | (5.490)                            | (3.613)                         |
| SCX        | 653                               | (2.420)                            | (1.767)                         | (109.550)                         | 84.640                             | (24.910)                        |
| SOG        | 2.690                             | (1.980)                            | 710                             | (6.212)                           | 4.760                              | (1.452)                         |
| SSB        | 10.251                            | (8.570)                            | 1.681                           | 642                               | (320)                              | 322                             |
| TOR        | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           | (1.899)                           | 1.960                              | 61                              |
| UAG        | 2.719                             | (2.200)                            | 519                             | (8.600)                           | 11.730                             | 3.130                           |
| WST        | (265.627)                         | 252.530                            | (13.097)                        | (64.731)                          | 64.530                             | (201)                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 25,20             | 23,68             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 35,77             | 40,45             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,14              | 0,12              |
| Investmentfonds                                                        | 1,41              | 1,42              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 5,09              | 0,73              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,29              | 0,05              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 1,67              | 2,38              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,71              | 0,27              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,01              | 0,00              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 29,71             | 30,90             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert              | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,61              | 1,42              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel   | 25,15             | 28,59             |
| Wandelanleihen & Wechsel           | k. A.             | 0,02              |
| Kommunalanleihen und Wechsel       | 0,03              | 0,04              |
| US-Regierungsbehörden              | 58,84             | 62,51             |
| US-Schatzobligationen              | 21,44             | 23,30             |
| Non-Agency-MBS                     | 7,56              | 8,58              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere   | 10,53             | 9,63              |
| Staatsemissionen                   | 7,88              | 6,91              |
| Stammaktien                        | 0,43              | 0,49              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Optionsscheine                                                                         | 0,01              | 0,02              |
| Vorzugswertpapiere                                                                     | 0,05              | 0,06              |
| Real Estate Investment Trusts                                                          | 0,19              | 0,19              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,35              | 0,64              |
| Investmentfonds                                                                        | 3,10              | 3,15              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 11,16             | 1,63              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,56              | (0,08)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,02              | 0,02              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,16              | 0,10              |
| Zinsswaps                                                                              | 1,63              | 2,85              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,08              | 0,09              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,00              | (0,07)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Zinsscaps                                                                              | (0,02)            | (0,04)            |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,05              | (0,01)            |
| Total Return Swaps auf Indizes                                                         | 0,00              | 0,00              |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere                                                     | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,70)            | 0,47              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,90              | (0,79)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,02              | 0,02              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (0,37)            | (0,66)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (50,67)           | (49,07)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |                                             |                |                          |                                   |
| Poseidon Bidco SASU                       |                |                          |                                   | Erste Group Bank AG                            |                |                          |                                   | UBS Group AG                                |                |                          |                                   |
| 6,980 % fällig am 13.03.2030              | € 300          | \$ 241                   | 0,07                              | 7,000 % fällig am 15.04.2031 (e)(g)            | € 1.200        | \$ 1.492                 | 0,45                              | 4,125 % fällig am 09.06.2033                | € 1.100        | \$ 1.345                 | 0,41                              |
| Syniverse Holdings, Inc.                  |                |                          |                                   | Extra Space Storage LP                         |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(g)         | \$ 250         | \$ 222                   | 0,07                              |
| 11,296 % fällig am 13.05.2027             | \$ 695         | 661                      | 0,20                              | 5,500 % fällig am 01.07.2030                   | \$ 700         | 726                      | 0,22                              | 4,751 % fällig am 12.05.2028                | 1.800          | 1.811                    | 0,55                              |
| Thames Water Utilities Ltd.               |                |                          |                                   | F&G Global Funding                             |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 12.02.2027 (e)(g)         | 200            | 195                      | 0,06                              |
| 0,300 % - 5,234 % fällig am 28.11.2025    | £ 1.374        | 1.379                    | 0,42                              | 5,875 % fällig am 16.01.2030                   | 700            | 720                      | 0,22                              | 6,537 % fällig am 12.08.2033                | 250            | 272                      | 0,08                              |
| U.S. Renal Care, Inc.                     |                |                          |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC                      |                |                          |                                   | UniCredit SpA                               |                |                          |                                   |
| 9,441 % fällig am 20.06.2028              | \$ 206         | 196                      | 0,06                              | 2,900 % fällig am 16.02.2028                   | 500            | 469                      | 0,14                              | 4,450 % fällig am 03.12.2027 (e)(g)         | € 400          | 468                      | 0,14                              |
| Windstream Services LLC                   |                |                          |                                   | 6,050 % fällig am 05.03.2031                   | 1.200          | 1.198                    | 0,36                              | 5,459 % fällig am 30.06.2035                | \$ 300         | 298                      | 0,09                              |
| 9,177 % fällig am 01.10.2031              | 700            | 704                      | 0,21                              | GA Global Funding Trust                        |                |                          |                                   | VICI Properties LP                          |                |                          |                                   |
|                                           |                | 3.181                    | 0,96                              | 5,200 % fällig am 09.12.2031                   | 700            | 702                      | 0,21                              | 4,500 % fällig am 15.01.2028                | 300            | 299                      | 0,09                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,900 % fällig am 13.01.2035                   | 200            | 203                      | 0,06                              | 5,625 % fällig am 01.04.2035                | 700            | 707                      | 0,21                              |
|                                           |                |                          |                                   | Gaci First Investment Co.                      |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 01.04.2034                | 100            | 102                      | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 29.01.2030                   | 1.600          | 1.635                    | 0,49                              | 6,125 % fällig am 01.04.2054 (i)            | 100            | 98                       | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | HLD EUROPE S.C.A.                              |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 02.04.2030                   | € 100          | 120                      | 0,04                              | 1,741 % fällig am 04.05.2030                | € 1.200        | 1.350                    | 0,41                              |
|                                           |                |                          |                                   | HSBC Holdings PLC                              |                |                          |                                   | 5,557 % fällig am 25.07.2034                | \$ 800         | 826                      | 0,25                              |
|                                           |                |                          |                                   | 3,973 % fällig am 22.05.2030                   | \$ 200         | 195                      | 0,06                              |                                             |                | 52.368                   | 15,78                             |
|                                           |                |                          |                                   | IHG Finance LLC                                |                |                          |                                   | <b>INDUSTRIEWERTE</b>                       |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 28.11.2029                   | € 600          | 739                      | 0,22                              | Alice France S.A.                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | ING Groep NV                                   |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 15.07.2029                | 1.000          | 827                      | 0,25                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,550 % fällig am 19.03.2035                   | \$ 300         | 307                      | 0,09                              | American Airlines Pass-Through Trust        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 6,114 % fällig am 11.09.2034 (i)               | 800            | 851                      | 0,26                              | 3,375 % fällig am 01.11.2028                | 400            | 390                      | 0,12                              |
|                                           |                |                          |                                   | Intesa Sanpaolo SpA                            |                |                          |                                   | American Airlines, Inc.                     |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 4,198 % fällig am 01.06.2032                   | 500            | 460                      | 0,14                              | 5,750 % fällig am 20.04.2029                | 800            | 800                      | 0,24                              |
|                                           |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 01.06.2042                   | 600            | 486                      | 0,15                              | Bacardi-Martini BV                          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 01.09.2031 (e)(g)            | € 350          | 425                      | 0,13                              | 5,550 % fällig am 01.02.2030                | 350            | 359                      | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | Jackson National Life Global Funding           |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 01.02.2035                | 350            | 362                      | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 13.01.2027                   | \$ 200         | 202                      | 0,06                              | BAT Capital Corp.                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,315 % fällig am 14.01.2028                   | 100            | 100                      | 0,03                              | 6,343 % fällig am 02.08.2030                | 250            | 270                      | 0,08                              |
|                                           |                |                          |                                   | JPMorgan Chase & Co.                           |                |                          |                                   | 6,421 % fällig am 02.08.2033 (i)            | 250            | 272                      | 0,08                              |
|                                           |                |                          |                                   | 4,505 % fällig am 22.10.2028                   | 700            | 702                      | 0,21                              | Bayer U.S. Finance LLC                      |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,210 % fällig am 22.10.2028                   | 700            | 702                      | 0,21                              | 6,375 % fällig am 21.11.2030                | 1.000          | 1.063                    | 0,32                              |
|                                           |                |                          |                                   | KBC Group NV                                   |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 21.11.2033                | 200            | 214                      | 0,06                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,324 % fällig am 21.09.2034                   | 800            | 858                      | 0,26                              | Broadcom, Inc.                              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.         |                |                          |                                   | 2,450 % fällig am 15.02.2031                | 400            | 358                      | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 12.11.2025                   | € 442          | 516                      | 0,16                              | Burberry Group PLC                          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Lincoln Financial Global Funding               |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 20.06.2030                | £ 1.200        | 1.646                    | 0,50                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,300 % fällig am 13.01.2030                   | \$ 100         | 103                      | 0,03                              | Carnival Corp.                              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Lloyds Banking Group PLC                       |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.08.2028                | \$ 300         | 294                      | 0,09                              |
|                                           |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 14.05.2032                   | € 1.100        | 1.327                    | 0,40                              | Carvana Co. (12,000 % PIK)                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,434 % fällig am 26.11.2028                   | \$ 200         | 200                      | 0,06                              | 12,000 % fällig am 01.12.2028 (b)           | 19             | 20                       | 0,01                              |
|                                           |                |                          |                                   | Mizuho Financial Group, Inc.                   |                |                          |                                   | Carvana Co. (13,000 % PIK)                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,382 % fällig am 10.07.2030                   | 200            | 206                      | 0,06                              | 13,000 % fällig am 01.06.2030 (b)           | 486            | 512                      | 0,15                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,594 % fällig am 10.07.2035                   | 200            | 206                      | 0,06                              | Carvana Co. (14,000 % PIK)                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Morgan Stanley                                 |                |                          |                                   | 14,000 % fällig am 01.06.2031 (b)           | 45             | 52                       | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,148 % fällig am 25.01.2034                   | € 1.000        | 1.297                    | 0,39                              | Centene Corp.                               |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Nationwide Building Society                    |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.03.2031                | 100            | 86                       | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 20.06.2027 (e)(g)            | £ 400          | 541                      | 0,16                              | 3,375 % fällig am 15.02.2030                | 900            | 830                      | 0,25                              |
|                                           |                |                          |                                   | Navient Corp.                                  |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.12.2027                | 540            | 532                      | 0,16                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.03.2027 (i)               | € 250          | 249                      | 0,08                              | Charter Communications Operating LLC        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Nomura Holdings, Inc.                          |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.06.2041                | 100            | 73                       | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,591 % fällig am 02.07.2027                   | 200            | 201                      | 0,06                              | Choice Hotels International, Inc.           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,594 % fällig am 02.07.2027                   | 200            | 204                      | 0,06                              | 5,850 % fällig am 01.08.2034                | 100            | 101                      | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,783 % fällig am 03.07.2034                   | 200            | 207                      | 0,06                              | Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Nykredit Realkredit A/S                        |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am 15.04.2028 (i)            | 240            | 227                      | 0,07                              |
|                                           |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 24.07.2030                   | € 700          | 837                      | 0,25                              | Community Health Systems, Inc.              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.03.2027                | 500            | 493                      | 0,15                              |
|                                           |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 05.04.2032 (c)               | \$ 1.400       | 996                      | 0,30                              | Directv Financing LLC                       |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Paychex, Inc.                                  |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 15.08.2027                | 350            | 349                      | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,350 % fällig am 15.04.2032                   | 100            | 103                      | 0,03                              | DISH DBS Corp.                              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Realty Income Corp.                            |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 01.12.2026                | 1.630          | 1.482                    | 0,45                              |
|                                           |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 20.06.2031                   | € 700          | 820                      | 0,25                              | 5,750 % fällig am 01.12.2028                | 230            | 199                      | 0,06                              |
|                                           |                |                          |                                   | Santander UK Group Holdings PLC                |                |                          |                                   | Elevance Health, Inc.                       |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,694 % fällig am 15.04.2031                   | \$ 300         | 310                      | 0,09                              | 4,750 % fällig am 15.02.2030                | 100            | 101                      | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,534 % fällig am 10.01.2029                   | 300            | 313                      | 0,09                              | Enbridge, Inc.                              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 6,833 % fällig am 21.11.2026                   | 1.800          | 1.816                    | 0,55                              | 5,700 % fällig am 08.03.2033                | 400            | 415                      | 0,12                              |
|                                           |                |                          |                                   | 7,482 % fällig am 29.08.2029                   | £ 200          | 295                      | 0,09                              | Energy Transfer LP                          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Sirius Real Estate Ltd.                        |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.02.2042                | 1.500          | 1.556                    | 0,47                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 22.06.2026                   | € 500          | 576                      | 0,17                              | Harbour Energy PLC                          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 24.11.2028                   | 200            | 223                      | 0,07                              | 6,327 % fällig am 01.04.2035                | 100            | 99                       | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | Suci Second Investment Co.                     |                |                          |                                   | Holding d'Infrastructures de Transport SASU |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 10.09.2027                   | \$ 200         | 199                      | 0,06                              | 3,375 % fällig am 21.04.2029                | € 600          | 714                      | 0,21                              |
|                                           |                |                          |                                   | Thames Water Super Senior Issuer PLC           |                |                          |                                   | iHeartCommunications, Inc.                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 10.10.2025                   | £ 70           | 89                       | 0,03                              | 7,000 % fällig am 15.01.2031                | \$ 320         | 236                      | 0,07                              |

| BESCHREIBUNG                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | % DES |
|----------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------|
| Imperial Brands Finance PLC                                    |                |                          |                          |       |
| 3,875 % fällig am 12.02.2034                                   | € 100          | \$ 115                   | 0,03                     |       |
| 4,500 % fällig am 30.06.2028 (a)                               | \$ 200         | 200                      | 0,06                     |       |
| Informa PLC                                                    |                |                          |                          |       |
| 3,000 % fällig am 23.10.2027                                   | € 350          | 415                      | 0,12                     |       |
| 3,250 % fällig am 23.10.2030                                   | 350            | 410                      | 0,12                     |       |
| Intelsat Jackson Holdings S.A.                                 |                |                          |                          |       |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030                                   | \$ 770         | 787                      | 0,24                     |       |
| LG Energy Solution Ltd.                                        |                |                          |                          |       |
| 5,250 % fällig am 02.04.2028                                   | 200            | 201                      | 0,06                     |       |
| Mundys SpA                                                     |                |                          |                          |       |
| 1,875 % fällig am 12.02.2028                                   | € 300          | 341                      | 0,10                     |       |
| NCL Corp. Ltd.                                                 |                |                          |                          |       |
| 5,875 % fällig am 15.02.2027                                   | \$ 150         | 151                      | 0,05                     |       |
| Nissan Motor Co. Ltd.                                          |                |                          |                          |       |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027                                   | 300            | 288                      | 0,09                     |       |
| Norsk Hydro ASA                                                |                |                          |                          |       |
| 3,625 % fällig am 23.01.2032                                   | € 700          | 826                      | 0,25                     |       |
| Oracle Corp.                                                   |                |                          |                          |       |
| 4,800 % fällig am 03.08.2028                                   | \$ 200         | 203                      | 0,06                     |       |
| Petroleos Mexicanos                                            |                |                          |                          |       |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041                                   | 1.200          | 892                      | 0,27                     |       |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032                                   | 279            | 259                      | 0,08                     |       |
| Prosus NV                                                      |                |                          |                          |       |
| 3,257 % fällig am 19.01.2027                                   | 200            | 196                      | 0,06                     |       |
| Spirit Airlines Pass-Through Trust                             |                |                          |                          |       |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029                                   | 736            | 676                      | 0,20                     |       |
| Thames Water Super Senior Issuer PLC                           |                |                          |                          |       |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027                                   | £ 69           | 105                      | 0,03                     |       |
| Thames Water Utilities Ltd.                                    |                |                          |                          |       |
| 0,000 % fällig am 22.03.2027 (c)                               | 10             | 12                       | 0,00                     |       |
| United Airlines, Inc.                                          |                |                          |                          |       |
| 4,625 % fällig am 15.04.2029 (i)                               | \$ 1.000       | 971                      | 0,29                     |       |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC                              |                |                          |                          |       |
| 3,875 % fällig am 15.08.2029                                   | 200            | 189                      | 0,06                     |       |
| Venture Global LNG, Inc.                                       |                |                          |                          |       |
| 9,500 % fällig am 01.02.2029                                   | 1.400          | 1.526                    | 0,46                     |       |
| 9,875 % fällig am 01.02.2032                                   | 800            | 864                      | 0,26                     |       |
| Windstream Services LLC                                        |                |                          |                          |       |
| 8,250 % fällig am 01.10.2031                                   | 700            | 734                      | 0,22                     |       |
|                                                                |                | 25.293                   | 7,62                     |       |
| <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                                  |                |                          |                          |       |
| Edison International                                           |                |                          |                          |       |
| 6,250 % fällig am 15.03.2030                                   | 3.000          | 3.048                    | 0,92                     |       |
| EPH Financing International A/S                                |                |                          |                          |       |
| 4,625 % fällig am 02.07.2032 (a)                               | € 800          | 946                      | 0,29                     |       |
| Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC                               |                |                          |                          |       |
| 1,500 % fällig am 17.02.2027                                   | 250            | 228                      | 0,07                     |       |
| ONEOK, Inc.                                                    |                |                          |                          |       |
| 5,650 % fällig am 01.09.2034                                   | \$ 900         | 912                      | 0,27                     |       |
| 6,050 % fällig am 01.09.2033                                   | 350            | 367                      | 0,11                     |       |
| Pacific Gas & Electric Co.                                     |                |                          |                          |       |
| 3,000 % fällig am 15.06.2028                                   | 300            | 285                      | 0,09                     |       |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026                                   | 300            | 297                      | 0,09                     |       |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042                                   | 250            | 199                      | 0,06                     |       |
| 5,000 % fällig am 04.06.2028                                   | 100            | 100                      | 0,03                     |       |
| 5,250 % fällig am 01.03.2052                                   | 200            | 167                      | 0,05                     |       |
| 5,900 % fällig am 15.06.2032                                   | 1.400          | 1.430                    | 0,43                     |       |
| 6,000 % fällig am 15.08.2035                                   | 200            | 202                      | 0,06                     |       |
| 6,700 % fällig am 01.04.2053                                   | 400            | 402                      | 0,12                     |       |
| PacifiCorp                                                     |                |                          |                          |       |
| 5,450 % fällig am 15.02.2034                                   | 300            | 304                      | 0,09                     |       |
| Petrobras Global Finance BV                                    |                |                          |                          |       |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115                                   | 45             | 40                       | 0,01                     |       |
| 7,250 % fällig am 17.03.2044                                   | 42             | 43                       | 0,01                     |       |
| Severn Trent Utilities Finance PLC                             |                |                          |                          |       |
| 3,875 % fällig am 04.08.2035                                   | € 100          | 118                      | 0,04                     |       |
| Vistra Operations Co. LLC                                      |                |                          |                          |       |
| 6,950 % fällig am 15.10.2033                                   | \$ 800         | 879                      | 0,27                     |       |
|                                                                |                | 9.967                    | 3,01                     |       |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel                         |                | 87.628                   | 26,41                    |       |
| <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                            |                |                          |                          |       |
| New York City, New York General Obligation Bonds, Series 2025  |                |                          |                          |       |
| 6,291 % fällig am 01.02.2045                                   | \$ 1.530       | \$ 1.605                 | 0,48                     |       |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                   |                |                          |                          |       |
| Ginnie Mae                                                     |                |                          |                          |       |
| 5,000 % fällig am 20.01.2055                                   | 198            | 195                      | 0,06                     |       |
| 5,500 % fällig am 20.07.2053 - 20.08.2053                      | 568            | 572                      | 0,17                     |       |
| Ginnie Mae, TBA                                                |                |                          |                          |       |
| 5,500 % fällig am 01.07.2055                                   | 1.300          | 1.302                    | 0,39                     |       |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                                   | 1.300          | 1.318                    | 0,40                     |       |
| Uniform Mortgage-Backed Security                               |                |                          |                          |       |
| 3,000 % fällig am 01.06.2052 - 01.08.2052                      | 2.423          | 2.101                    | 0,63                     |       |
| 4,000 % fällig am 01.09.2048 - 01.04.2053                      | 6.931          | 6.455                    | 1,95                     |       |
| 4,500 % fällig am 01.10.2052 - 01.04.2054                      | 7.378          | 7.070                    | 2,13                     |       |
| 5,000 % fällig am 01.01.2053 - 01.11.2054                      | 20.085         | 19.716                   | 5,94                     |       |
| 5,500 % fällig am 01.03.2053 - 01.04.2054                      | 7.730          | 7.742                    | 2,33                     |       |
| 6,000 % fällig am 01.04.2053 - 01.03.2055                      | 15.764         | 16.045                   | 4,83                     |       |
| 6,500 % fällig am 01.11.2053 - 01.04.2054                      | 11.537         | 11.924                   | 3,59                     |       |
| Uniform Mortgage-Backed Security TBA                           |                |                          |                          |       |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055                                   | 6.100          | 5.279                    | 1,59                     |       |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055                                   | 7.900          | 7.113                    | 2,14                     |       |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055                                   | 8.800          | 8.184                    | 2,47                     |       |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055                      | 9.950          | 9.752                    | 2,94                     |       |
| 5,500 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055                      | 16.025         | 16.015                   | 4,83                     |       |
| 6,000 % fällig am 01.07.2055                                   | 35.000         | 35.570                   | 10,71                    |       |
| 6,500 % fällig am 01.08.2055                                   | 24.600         | 25.365                   | 7,64                     |       |
| 7,000 % fällig am 01.09.2055                                   | 25             | 26                       | 0,01                     |       |
|                                                                | 181.744        | 54,75                    |                          |       |
| <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                                    |                |                          |                          |       |
| U.S. Treasury Bonds                                            |                |                          |                          |       |
| 4,250 % fällig am 15.08.2054                                   | 600            | 548                      | 0,17                     |       |
| 4,500 % fällig am 15.11.2054                                   | 3.200          | 3.051                    | 0,92                     |       |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)               |                |                          |                          |       |
| 0,125 % fällig am 15.02.2052                                   | 691            | 369                      | 0,11                     |       |
| 0,250 % fällig am 15.07.2029                                   | 502            | 482                      | 0,14                     |       |
| 0,625 % fällig am 15.07.2032                                   | 4.306          | 4.018                    | 1,21                     |       |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049                                   | 127            | 93                       | 0,03                     |       |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033                                   | 10.033         | 9.748                    | 2,94                     |       |
| 1,625 % fällig am 15.10.2027                                   | 325            | 329                      | 0,10                     |       |
| 1,875 % fällig am 15.07.2034                                   | 5.929          | 5.937                    | 1,79                     |       |
| 2,125 % fällig am 15.02.2054                                   | 2.404          | 2.202                    | 0,66                     |       |
| U.S. Treasury Notes                                            |                |                          |                          |       |
| 3,500 % fällig am 31.01.2028                                   | 1.100          | 1.095                    | 0,33                     |       |
| 3,875 % fällig am 31.12.2027                                   | 1.600          | 1.607                    | 0,49                     |       |
| 4,125 % fällig am 15.11.2032                                   | 1.200          | 1.208                    | 0,36                     |       |
|                                                                | 30.687         | 9,25                     |                          |       |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                          |                |                          |                          |       |
| 1211 Avenue of the Americas Trust                              |                |                          |                          |       |
| 4,280 % fällig am 10.08.2035                                   | 400            | 371                      | 0,11                     |       |
| 225 Liberty Street Trust                                       |                |                          |                          |       |
| 4,501 % fällig am 10.02.2036                                   | 500            | 461                      | 0,14                     |       |
| 280 Park Avenue Mortgage Trust                                 |                |                          |                          |       |
| 6,148 % fällig am 15.09.2034                                   | 100            | 97                       | 0,03                     |       |
| Adjustable Rate Mortgage Trust                                 |                |                          |                          |       |
| 4,674 % fällig am 25.08.2036                                   | 617            | 208                      | 0,06                     |       |
| Alba PLC                                                       |                |                          |                          |       |
| 4,618 % fällig am 15.12.2038                                   | £ 449          | 580                      | 0,17                     |       |
| Bletchley Park Funding PLC                                     |                |                          |                          |       |
| 5,524 % fällig am 27.07.2070                                   | 1.000          | 1.375                    | 0,41                     |       |
| Bridgegate Funding PLC                                         |                |                          |                          |       |
| 8,314 % fällig am 16.10.2062                                   | 190            | 264                      | 0,08                     |       |
| 9,314 % fällig am 16.10.2062                                   | 190            | 263                      | 0,08                     |       |
| <b>BESCHREIBUNG</b>                                            |                |                          |                          |       |
| Cassia SRL                                                     |                |                          |                          |       |
| 5,560 % fällig am 22.05.2034                                   | € 670          | \$ 787                   | 0,24                     |       |
| Cheshire PLC                                                   |                |                          |                          |       |
| 6,337 % fällig am 20.08.2045                                   | £ 940          | 1.291                    | 0,39                     |       |
| Curzon Mortgages PLC                                           |                |                          |                          |       |
| 6,032 % fällig am 28.07.2049                                   | 1.000          | 1.375                    | 0,41                     |       |
| Dilosk RMBS DAC                                                |                |                          |                          |       |
| 2,838 % fällig am 25.01.2063                                   | € 985          | 1.156                    | 0,35                     |       |
| Edenbrook Mortgage Funding PLC                                 |                |                          |                          |       |
| 5,589 % fällig am 22.03.2057                                   | £ 992          | 1.365                    | 0,41                     |       |
| Eurosail PLC                                                   |                |                          |                          |       |
| 2,393 % fällig am 13.03.2045                                   | € 500          | 572                      | 0,17                     |       |
| 2,403 % fällig am 13.03.2045                                   | 1.500          | 1.645                    | 0,50                     |       |
| 5,358 % fällig am 13.06.2045                                   | £ 1.003        | 1.305                    | 0,39                     |       |
| Great Hall Mortgages PLC                                       |                |                          |                          |       |
| 4,618 % fällig am 18.06.2038                                   | 2.819          | 3.840                    | 1,16                     |       |
| 4,658 % fällig am 18.06.2039                                   | 1.425          | 1.933                    | 0,58                     |       |
| 4,818 % fällig am 18.06.2038                                   | 2.400          | 3.174                    | 0,96                     |       |
| Grifonas Finance PLC                                           |                |                          |                          |       |
| 2,669 % fällig am 28.08.2039                                   | € 362          | 413                      | 0,12                     |       |
| GS Mortgage Securities Corp. Trust                             |                |                          |                          |       |
| 6,609 % fällig am 15.11.2032                                   | \$ 489         | 483                      | 0,15                     |       |
| Hops Hill PLC                                                  |                |                          |                          |       |
| 0,000 % fällig am 21.06.2056 (a)                               | £ 200          | 274                      | 0,08                     |       |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust            |                |                          |                          |       |
| 2,949 % fällig am 06.09.2038                                   | \$ 900         | 878                      | 0,26                     |       |
| Lehman XS Trust                                                |                |                          |                          |       |
| 4,794 % fällig am 25.11.2035                                   | 432            | 403                      | 0,12                     |       |
| Lugo Funding DAC                                               |                |                          |                          |       |
| 3,049 % fällig am 26.05.2066                                   | € 1.373        | 1.615                    | 0,49                     |       |
| Mansard Mortgages PLC                                          |                |                          |                          |       |
| 4,786 % fällig am 15.10.2048                                   | £ 379          | 514                      | 0,16                     |       |
| Merrion Square Residential DAC                                 |                |                          |                          |       |
| 2,999 % fällig am 24.03.2081                                   | € 927          | 1.090                    | 0,33                     |       |
| Newgate Funding PLC                                            |                |                          |                          |       |
| 4,517 % fällig am 01.12.2050                                   | £ 230          | 311                      | 0,09                     |       |
| 4,557 % fällig am 01.12.2050                                   | 1.473          | 1.919                    | 0,58                     |       |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust                       |                |                          |                          |       |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035                                   | \$ 181         | 159                      | 0,05                     |       |
| RMAC Securities PLC                                            |                |                          |                          |       |
| 4,628 % fällig am 12.06.2044                                   | £ 294          | 393                      | 0,12                     |       |
| Stratton Hawkmoor PLC                                          |                |                          |                          |       |
| 5,737 % fällig am 25.02.2053                                   | 1.700          | 2.346                    | 0,71                     |       |
| Stratton Mortgage Funding PLC                                  |                |                          |                          |       |
| 5,139 % fällig am 28.06.2050                                   | 770            | 1.056                    | 0,32                     |       |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                                |                |                          |                          |       |
| 5,637 % fällig am 20.02.2054                                   | 720            | 989                      | 0,30                     |       |
| 7,798 % fällig am 20.07.2053                                   | 1.150          | 1.592                    | 0,48                     |       |
| 8,798 % fällig am 20.07.2053                                   | 1.150          | 1.593                    | 0,48                     |       |
| Tower Bridge Funding PLC                                       |                |                          |                          |       |
| 5,398 % fällig am 20.01.2066                                   | 389            | 535                      | 0,16                     |       |
| Trinity Square PLC                                             |                |                          |                          |       |
| 5,617 % fällig am 15.07.2059                                   | 1.700          | 2.328                    | 0,70                     |       |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                  |                |                          |                          |       |
| 4,967 % fällig am 25.07.2037                                   | \$ 447         | 406                      | 0,12                     |       |
|                                                                |                | 41.359                   | 12,46                    |       |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                        |                |                          |                          |       |
| <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                                 |                |                          |                          |       |
| FTA Santander Consumer Spain Auto                              |                |                          |                          |       |
| 2,886 % fällig am 22.09.2039                                   | € 426          | 503                      | 0,15                     |       |
| Golden Bar Securitisation SRL                                  |                |                          |                          |       |
| 4,936 % fällig am 22.09.2043                                   | 245            | 294                      | 0,09                     |       |
| 5,636 % fällig am 22.09.2043                                   | 245            | 295                      | 0,09                     |       |
|                                                                |                | 1.092                    | 0,33                     |       |
| <b>CMBS SONSTIGE</b>                                           |                |                          |                          |       |
| <b>AREIT LLC</b>                                               |                |                          |                          |       |
| 6,426 % fällig am 17.08.2041                                   | \$ 490         | 492                      | 0,15                     |       |
| <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>                                     |                |                          |                          |       |
| Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                          |       |
| 6,234 % fällig am 25.11.2034                                   | 400            | 365                      | 0,11                     |       |



**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

|                                                                |    |       |      |
|----------------------------------------------------------------|----|-------|------|
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | \$ | 1.013 | 0,31 |
|----------------------------------------------------------------|----|-------|------|

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Referenzeinheit   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Barclays Bank PLC | 1,000 %                        | 20.12.2025       | € 500                     | \$ (1)                                          | 0,00                    |
| Boeing Co.        | 1,000                          | 20.06.2030       | \$ 1.300                  | 12                                              | 0,00                    |
|                   |                                |                  |                           | \$ 11                                           | 0,00                    |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000 %                        | 20.12.2026       | \$ 460                    | \$ 5                                            | 0,00                    |
| CDX.EM-38 5-Year Index | 1,000                          | 20.12.2027       | 900                       | 17                                              | 0,01                    |
| CDX.EM-40 5-Year Index | 1,000                          | 20.12.2028       | 600                       | 15                                              | 0,01                    |
| CDX.EM-41 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2029       | 200                       | 6                                               | 0,00                    |
| CDX.EM-42 5-Year Index | 1,000                          | 20.12.2029       | 300                       | 4                                               | 0,00                    |
| CDX.EM-43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030       | 300                       | 3                                               | 0,00                    |
| CDX.HY-43 5-Year Index | 5,000                          | 20.12.2029       | 4.300                     | 13                                              | 0,00                    |
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000                          | 20.06.2030       | 6.000                     | 178                                             | 0,05                    |
|                        |                                |                  |                           | \$ 241                                          | 0,07                    |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt<br>variabler Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|--------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Erhalt                               | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 2.500    | \$ (38)                                         | (0,01)                  |
| Zahlung                              | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2055       | 800        | (29)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                               | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 16.06.2028       | ¥ 130.000  | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                               | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 15.12.2028       | 490.000    | 15                                              | 0,00                    |
| Erhalt                               | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,200           | 15.12.2041       | 30.000     | 9                                               | 0,00                    |
| Erhalt                               | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400           | 15.06.2032       | 27.400     | 2                                               | 0,00                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250           | 16.06.2051       | \$ 450     | 28                                              | 0,01                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750           | 21.12.2052       | 800        | 71                                              | 0,02                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,750           | 21.06.2053       | 1.750      | 157                                             | 0,05                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000           | 19.03.2030       | 29.700     | (525)                                           | (0,16)                  |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000           | 21.06.2033       | 9.850      | (35)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2026       | 63.000     | 132                                             | 0,04                    |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2027       | 62.800     | (4)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2030       | 29.200     | 176                                             | 0,05                    |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2035       | 30.300     | 422                                             | 0,13                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2055       | 4.400      | 152                                             | 0,05                    |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 18.06.2055       | 6.200      | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500           | 20.12.2030       | 1.900      | (5)                                             | 0,00                    |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500           | 20.12.2033       | 200        | (2)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500           | 20.06.2054       | 4.300      | 10                                              | 0,00                    |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500           | 18.12.2054       | 700        | (66)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,610           | 12.12.2032       | 100        | 0                                               | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,620           | 30.11.2029       | 4.200      | (37)                                            | (0,01)                  |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750           | 20.06.2029       | 4.000      | 101                                             | 0,03                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750           | 18.12.2029       | 5.200      | (72)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750           | 20.06.2031       | 1.800      | 15                                              | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750           | 15.05.2032       | 2.830      | (36)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750           | 18.12.2034       | 11.400     | (75)                                            | (0,02)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,100           | 15.11.2052       | 601        | (13)                                            | 0,00                    |
| Zahlung                              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,250           | 20.12.2025       | 8.300      | (5)                                             | 0,00                    |
| Erhalt                               | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,250           | 20.03.2034       | 3.400      | 51                                              | 0,01                    |
| Zahlung                              | 1-Year BRL-CDI                    | 10,256          | 04.01.2027       | BRL 41.800 | (397)                                           | (0,12)                  |
| Zahlung                              | 1-Year BRL-CDI                    | 10,512          | 04.01.2027       | 10.200     | (141)                                           | (0,04)                  |
| Zahlung                              | 6-Month AUD-BBR-BBSW              | 3,500           | 19.03.2027       | AUD 5.000  | 31                                              | 0,01                    |
| Zahlung                              | 6-Month AUD-BBR-BBSW              | 4,150           | 19.03.2055       | 300        | 3                                               | 0,00                    |
| Zahlung                              | 6-Month AUD-BBR-BBSW              | 4,250           | 19.03.2030       | 5.300      | 63                                              | 0,02                    |
| Zahlung                              | 6-Month AUD-BBR-BBSW              | 4,500           | 19.03.2035       | 2.900      | 44                                              | 0,01                    |
| Zahlung                              | 6-Month AUD-BBR-BBSW              | 4,500           | 18.06.2035       | 7.600      | 51                                              | 0,01                    |
| Zahlung <sup>(3)</sup>               | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,000           | 17.09.2027       | € 3.500    | (11)                                            | 0,00                    |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2030       | 3.300      | (40)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2035       | 2.600      | (29)                                            | (0,01)                  |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2055       | 8.850      | 395                                             | 0,13                    |
| Zahlung                              | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,547           | 09.03.2033       | 100        | 1                                               | 0,00                    |
|                                      |                                   |                 |                  |            | \$ 366                                          | 0,12                    |
|                                      |                                   |                 |                  |            | \$ 618                                          | 0,19                    |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                 | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|----------------------|
| BOA        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.09.2055 | \$ 70,000     | 08.09.2025    | 8.800                     | \$ (1) | \$ 0      | 0,00                 |
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 5,500 % fällig am 01.08.2055 | 75,000        | 06.08.2025    | 16.025                    | 1      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055 | 77,000        | 06.08.2025    | 14.500                    | 1      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,000 % fällig am 01.09.2055 | 75,000        | 08.09.2025    | 20.500                    | 1      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 6,500 % fällig am 01.08.2055 | 79,000        | 06.08.2025    | 24.600                    | 1      | 0         | 0,00                 |
|            |                                                                              |               |               |                           | \$ 3   | \$ 0      | 0,00                 |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| GST        | Israel Government International Bond       | 1,000 %                     | 20.12.2029       | \$ 100                    | \$ (3)                                | \$ 4                                     | \$ 1      | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                        | 4,850                       | 07.05.2026       | 1.824                     | 0                                     | 21                                       | 21        | 0,01                 |
| MYC        | Israel Government International Bond       | 1,000                       | 20.12.2029       | 100                       | (2)                                   | 3                                        | 1         | 0,00                 |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                       | 20.12.2026       | 200                       | (9)                                   | 10                                       | 1         | 0,00                 |
|            |                                            |                             |                  |                           | \$ (14)                               | \$ 38                                    | \$ 24     | 0,01                 |

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                     | 20.12.2029       | € 197                     | \$ 39                                 | \$ 4                                     | \$ 43     | 0,01                 |

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                 | 22 \$                 | 3                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 301 AUD               | 463                           | 3                               | 3                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | 463 \$                | 301                           | 0                               | (3)                                           | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          | €                   | 53.942                | 61.335                        | 0                               | (1.986)                                       | (0,60)               |
| BPS        | 07.2025          | HKD                 | 401                   | 51                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TRY                 | 57                    | 1                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 05.2026          | \$                  | 44                    | KWD 14                        | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 06.2026          |                     | 31                    | 10                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 06.2027          |                     | 15                    | 5                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 05.2029          | KWD                 | 67 \$                 | 230                           | 10                              | 10                                            | 0,00                 |
|            | 07.2029          |                     | 9                     | 30                            | 1                               | 1                                             | 0,00                 |
|            | 05.2030          |                     | 50                    | 171                           | 7                               | 7                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | TRY                 | 18.474                | 456                           | 0                               | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 33.912                | £ 24.924                      | 243                             | 243                                           | 0,07                 |
|            | 07.2025          |                     | 40                    | ¥ 5.728                       | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.175                 | TRY 48.139                    | 22                              | 22                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 293                   | ZAR 5.291                     | 4                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ZAR                 | 29.837                | \$ 1.646                      | 0                               | (30)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025          | £                   | 24.924                | 33.916                        | 0                               | (243)                                         | (0,07)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 1.080                 | TRY 44.733                    | 13                              | 13                                            | 0,00                 |
| CBK        | 08.2025          | CNH                 | 71 \$                 | 10                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | HKD                 | 2.056                 | 263                           | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 09.2025          | PEN                 | 8.578                 | 2.320                         | 0                               | (92)                                          | (0,03)               |
|            | 12.2025          |                     | 2.480                 | 670                           | 0                               | (26)                                          | (0,01)               |
| DUB        | 07.2025          | \$                  | 63.124                | € 54.413                      | 748                             | 748                                           | 0,23                 |
|            | 08.2025          | €                   | 54.293                | \$ 63.124                     | 0                               | (747)                                         | (0,22)               |
| FAR        | 07.2025          | AUD                 | 463                   | 299                           | 0                               | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 11                    | 2                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | HKD                 | 211                   | 27                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
|            | 07.2025          | ¥ 527.155              | \$ 3.622                 | \$ 0                             | \$ (28)                            | \$ (28)                                              | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$ 3.291               | BRL 18.815               | 156                              | 0                                  | 156                                                  | 0,05                    |
|            | 07.2025          | 6.408                  | ¥ 919.316                | 0                                | (44)                               | (44)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | 3.622                  | 525.216                  | 28                               | 0                                  | 28                                                   | 0,01                    |
|            | 09.2025          | 654                    | MXN 12.727               | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,01                    |
| GLM        | 07.2025          | BRL 18.851             | \$ 3.420                 | 0                                | (34)                               | (34)                                                 | (0,01)                  |
|            | 10.2025          | \$ 3.420               | BRL 19.282               | 33                               | 0                                  | 33                                                   | 0,01                    |
| JPM        | 07.2025          | CNH 22                 | \$ 3                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR 17.183             | 961                      | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | € 802                  | 921                      | 0                                | (21)                               | (21)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | HKD 9.611              | 1.228                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 568                 | € 496                    | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.438                  | £ 1.063                  | 19                               | 0                                  | 19                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 281                    | ¥ 40.326                 | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025          | ¥ 187.696              | \$ 1.287                 | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 42                  | £ 30                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 144                    | ¥ 20.767                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 1.144                  | 166.232                  | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | HKD 87                 | \$ 11                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 08.2025          | \$ 20                  | CNH 144                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          | ¥ 24.363               | \$ 169                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 169                 | ¥ 24.274                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | £ 25.987               | \$ 35.187                | 0                                | (424)                              | (424)                                                | (0,13)                  |
| UAG        | 07.2025          | HKD 19                 | 2                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 94                  | ¥ 13.550                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025          | € 165                  | \$ 193                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 279.940              | 1.944                    | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 194                 | € 165                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 1.944                  | ¥ 278.910                | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 1.335                         | \$ (3.711)                         | \$ (2.376)                                           | (0,71)                  |

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Class E AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD 7.556              | \$ 4.908                 | \$ 0                             | \$ (44)                            | \$ (44)                                              | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$ 4.911               | AUD 7.556                | 44                               | 0                                  | 44                                                   | 0,01                    |
| BOA        | 07.2025          | 98                     | 151                      | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | 1.033                  | 1.592                    | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | 4.406                  | 6.836                    | 74                               | 0                                  | 74                                                   | 0,02                    |
| CBK        | 07.2025          | AUD 256                | \$ 167                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 588                 | AUD 906                  | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | 3.961                  | 6.151                    | 70                               | 0                                  | 70                                                   | 0,02                    |
| FAR        | 07.2025          | AUD 7.511              | \$ 4.911                 | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 4.274               | AUD 6.625                | 67                               | 0                                  | 67                                                   | 0,02                    |
|            | 08.2025          | 4.914                  | 7.511                    | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,01                    |
| JPM        | 07.2025          | AUD 6.840              | \$ 4.483                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 4.486               | AUD 6.840                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | AUD 98                 | \$ 63                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 284                           | \$ (58)                            | \$ 226                                               | 0,07                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 3.306                | \$ 3.871                 | \$ 0                             | \$ (10)                            | \$ (10)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.344               | € 2.943                  | 111                              | 0                                  | 111                                                  | 0,03                    |
|            | 08.2025          | 3.880                  | 3.306                    | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | € 17                   | \$ 20                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.548               | € 3.120                  | 115                              | 0                                  | 115                                                  | 0,03                    |
| BPS        | 07.2025          | € 47                   | \$ 53                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | 49                     | 56                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 3.561               | € 3.136                  | 120                              | 0                                  | 120                                                  | 0,04                    |
| CBK        | 07.2025          | € 14                   | \$ 16                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          | \$ 680                 | € 593                    | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,01                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 373                           | \$ (15)                            | \$ 358                                               | 0,11                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund II (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £                      | 2.975                    | \$                               | 4.083                              | \$ 6                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 4.083                    | £                                | 2.975                              | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | £                      | 3.343                    | \$                               | 4.548                              | (33)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 4.068                    | £                                | 3.013                              | 60                                                   | 0,02                    |
|            | 08.2025          |                        | 4.486                    |                                  | 3.297                              | 32                                                   | 0,01                    |
| CBK        | 07.2025          |                        | 194                      |                                  | 143                                | 2                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025          |                        | 4.306                    |                                  | 3.197                              | 74                                                   | 0,02                    |
| MBC        | 07.2025          | £                      | 30                       | \$                               | 42                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 111                      | £                                | 82                                 | 1                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          | £                      | 3.269                    | \$                               | 4.482                              | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 4.312                    | £                                | 3.185                              | 52                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 4.483                    |                                  | 3.269                              | (3)                                                  | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | £                      | 2                        | \$                               | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 230                           | \$ (41)                            | \$ 189                                               | 0,05                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Class E JPY (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA                              | 07.2025          | \$                     | 78                       | ¥                                | 11.158                             | \$ 0                                                 | 0,00                    |
| BPS                              | 07.2025          | ¥                      | 14.441                   | \$                               | 100                                | 0                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 501                      | ¥                                | 71.704                             | (4)                                                  | (0,00)                  |
| BRC                              | 07.2025          |                        | 2.659                    |                                  | 382.355                            | (12)                                                 | 0,00                    |
| CBK                              | 07.2025          | ¥                      | 173.290                  | \$                               | 1.208                              | 8                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 4.474                    | ¥                                | 642.537                            | (25)                                                 | (0,01)                  |
| FAR                              | 07.2025          | ¥                      | 1.924.480                | \$                               | 13.221                             | (102)                                                | (0,03)                  |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 22.023                   | ¥                                | 3.159.440                          | (151)                                                | (0,05)                  |
|                                  | 08.2025          |                        | 13.221                   |                                  | 1.917.403                          | 102                                                  | 0,03                    |
| MBC                              | 07.2025          | ¥                      | 213.164                  | \$                               | 1.465                              | (11)                                                 | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 23.009                   | ¥                                | 3.308.302                          | (110)                                                | (0,03)                  |
| MYI                              | 07.2025          | ¥                      | 3.136.348                | \$                               | 21.636                             | (85)                                                 | (0,02)                  |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 11.166                   | ¥                                | 1.613.209                          | 2                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          |                        | 21.636                   |                                  | 3.124.813                          | (8)                                                  | 0,02                    |
| SCX                              | 07.2025          | ¥                      | 1.554.722                | \$                               | 10.767                             | 4                                                    | 0,00                    |
|                                  | 07.2025          | \$                     | 159                      | ¥                                | 22.989                             | 1                                                    | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          |                        | 10.330                   |                                  | 1.486.368                          | (1)                                                  | 0,00                    |
| SOG                              | 07.2025          | ¥                      | 3.459.448                | \$                               | 23.966                             | 16                                                   | 0,00                    |
|                                  | 08.2025          | \$                     | 23.959                   | ¥                                | 3.445.845                          | (15)                                                 | 0,00                    |
| UAG                              | 07.2025          |                        | 12.421                   |                                  | 1.797.845                          | 26                                                   | 0,01                    |
|                                  |                  |                        |                          | \$ 256                           | \$ (524)                           | \$ (268)                                             | (0,08)                  |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                        |                          |                                  |                                    | \$ (1.804)                                           | (0,54)                  |

| BESCHREIBUNG                                                         | PARI (0005) | MARKT-<br>WERT<br>(0005) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|----------------------------------------------------------------------|-------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b>                           |             |                          |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                           | \$ 250.000  | \$ 30                    | 0,01                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte                            |             | \$ 30                    | 0,01                         |
| <b>LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE</b>                                     |             |                          |                              |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                         |             |                          |                              |
| Uniform Mortgage-Backed Security TBA<br>4,500 % fällig am 01.08.2055 | 600         | (574)                    | (0,17)                       |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere                                      |             | \$ (574)                 | (0,17)                       |
| Summe Anlagen                                                        |             | \$ 432.810               | 130,42                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                          |             | \$ (100.940)             | (30,42)                      |
| Nettovermögen                                                        |             | \$ 331.870               | 100,00                       |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin,
- (b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung,
- (c) Nullkuponwertpapier,
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt,

- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar,
- (f) Mit dem Fonds verbunden,
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier,
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,01 %):

| Emittentenbeschreibung  | Kaufdatum  | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|-------------------------|------------|--------|-----------|----------------------|
| Intelsat Emergence S.A. | 24.02.2021 | \$ 77  | \$ 32     | 0,01                 |

- (i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 3.774 USD (31. Dezember 2024: 3.052 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von 6.435 USD (31. Dezember 2024: 4.053 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 2.461 USD (31. Dezember 2024: 3.751 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 412.367                                                      | \$ 826                                                       | \$ 413.193        |
| Investmentfonds                     | 20.334                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 20.334            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 464                                                                         | (637)                                                           | 0                                                            | (173)             |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 30                                                              | 0                                                            | 30                |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (574)                                                           | 0                                                            | (574)             |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 20.798</b>                                                            | <b>\$ 411.186</b>                                               | <b>\$ 826</b>                                                | <b>\$ 432.810</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 345.356                                                      | \$ 1.524                                                     | \$ 346.880        |
| Investmentfonds                     | 57                                                                          | 0                                                               | 0                                                            | 57                |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (2)                                                                         | (4.127)                                                         | 0                                                            | (4.129)           |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 31                                                              | 0                                                            | 31                |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (564)                                                           | 0                                                            | (564)             |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 55</b>                                                                | <b>\$ 340.696</b>                                               | <b>\$ 1.524</b>                                              | <b>\$ 342.275</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum   | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|-------------------------------------------|------------|------------------|--------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                       | 4,000 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025         | \$ (170)     | \$ (170)                                    | (0,05)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (188)        | (188)                                       | (0,06)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (1.154)      | (1.155)                                     | (0,35)                  |
|                                           |            | 23.06.2025       | 01.08.2025         | (727)        | (728)                                       | (0,22)                  |
| MYI                                       | 1,500      | 11.06.2025       | TBD <sup>(1)</sup> | € (905)      | (1.063)                                     | (0,32)                  |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                  |                    |              | <b>\$ (3.304)</b>                           | <b>(1,00)</b>           |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                        |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                        |                                       |                                 |
|------------|------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarkt-<br>wert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarkt-<br>wert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 112                                   | \$ 0                                  | \$ 112                          | \$ k. A.                                 | \$ k. A.                              | \$ k. A.                        |
| BOA        | (1.871)                                  | 1.790                                 | (81)                            | (156)                                    | 0                                     | (156)                           |
| BPS        | 65                                       | 0                                     | 65                              | (49)                                     | 0                                     | (49)                            |
| BRC        | 244                                      | (210)                                 | 34                              | (1.251)                                  | 1.320                                 | 69                              |
| CBK        | (129)                                    | 40                                    | (89)                            | (301)                                    | 260                                   | (41)                            |



| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| DUB        | \$ 71                               | \$ 0                                  | \$ 71                           | \$ (209)                            | \$ 0                                  | \$ (209)                        |
| FAR        | 38                                  | 0                                     | 38                              | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| GLM        | (1)                                 | 0                                     | (1)                             | 42                                  | (20)                                  | 22                              |
| GST        | 22                                  | (10)                                  | 12                              | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| JPM        | 70                                  | 0                                     | 70                              | 136                                 | (160)                                 | (24)                            |
| MBC        | (87)                                | 310                                   | 223                             | 715                                 | (510)                                 | 205                             |
| MYC        | 2                                   | 31                                    | 33                              | 1                                   | 31                                    | 32                              |
| MYI        | 1                                   | 0                                     | 1                               | 2                                   | (10)                                  | (8)                             |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (1)                                 | 0                                     | (1)                             |
| SCX        | 4                                   | 0                                     | 4                               | (1.248)                             | 1.270                                 | 22                              |
| SOG        | 1                                   | 0                                     | 1                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| SSB        | (372)                               | 290                                   | (82)                            | 3                                   | 0                                     | 3                               |
| UAG        | 26                                  | 0                                     | 26                              | (875)                               | 870                                   | (5)                             |
| WST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | (135)                               | 0                                     | (135)                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 27,72             | 32,47             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 51,07             | 47,95             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 1,71              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 3,96              | 0,01              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,20              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,43              | 0,37              |
| Freiverkehrsfinaizderivate                                             | 0,50              | 0,30              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,01              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 14,40             | 18,89             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,96              | 1,59              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 26,41             | 23,66             |
| Kommunalanleihen und Wechsel                                                           | 0,48              | k. A.             |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 54,75             | 50,56             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 9,25              | 21,46             |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 12,46             | 14,29             |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 12,60             | 8,66              |
| Staatsemissionen                                                                       | 7,57              | 5,97              |
| Stammaktien                                                                            | 0,01              | 0,01              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | k. A.             | 0,56              |
| Investmentfonds                                                                        | 6,13              | 0,02              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,31              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,07              | 0,04              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,12              | (0,33)            |
| Freiverkehrsfinaizderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,01              | k. A.             |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,71)            | 0,39              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,15              | (1,61)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,01              | 0,01              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (0,17)            | (0,21)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (30,42)           | (25,07)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

|  |  |  |  | </ |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|----|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                             | AKTIEN | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | AKTIEN | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | AKTIEN | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------|--------|---------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|--------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|--------|---------------------------|-----------------------------------|
| <b>STAMMAKTIE</b>                        |        |                           |                                   | Pandox AB                                      | 248    | \$ 4                      | 0,00                              | Centuria Office REIT                              | 413    | \$ 0                      | 0,00                              |
| <b>KOMMUNIKATIONSDIENSTE</b>             |        |                           |                                   | Platzter Fastigheter Holding AB                |        |                           |                                   | Charter Hall Group                                | 1.382  | 17                        | 0,01                              |
| Frontier Communications Parent, Inc. (a) | 1.100  | \$ 40                     | 0,02                              | 'B' (a)                                        | 140    | 1                         | 0,00                              | Charter Hall Long Wale REIT                       | 579    | 2                         | 0,00                              |
| <b>LUXUSGÜTER</b>                        |        |                           |                                   | PSP Swiss Property AG                          | 104    | 19                        | 0,01                              | Charter Hall Retail REIT                          | 438    | 1                         | 0,00                              |
| Marriott International, Inc. 'A'         | 67     | 18                        | 0,01                              | Redfin Corp. (a)                               | 900    | 10                        | 0,01                              | Charter Hall Social Infrastructure REIT           | 303    | 1                         | 0,00                              |
| <b>BASISKONSUMGÜTER</b>                  |        |                           |                                   | Sagax AB 'B'                                   | 514    | 12                        | 0,01                              | Choice Properties Real Estate Investment Trust    | 657    | 7                         | 0,00                              |
| Kellanova                                | 600    | 48                        | 0,02                              | Sino Land Co. Ltd.                             | 8.256  | 9                         | 0,01                              | Comforia Residential REIT, Inc.                   | 2      | 4                         | 0,00                              |
| <b>ENERGIE</b>                           |        |                           |                                   | StorageVault Canada, Inc.                      | 521    | 2                         | 0,00                              | COPT Defense Properties                           | 235    | 6                         | 0,00                              |
| Heß Corp.                                | 400    | 55                        | 0,03                              | Sumitomo Realty & Development Co. Ltd.         | 787    | 30                        | 0,02                              | Cousins Properties, Inc.                          | 351    | 11                        | 0,01                              |
| <b>FINANZWERTE</b>                       |        |                           |                                   | Sun Hung Kai Properties Ltd.                   | 3.213  | 37                        | 0,02                              | Covivio S.A.                                      | 97     | 6                         | 0,00                              |
| Mr Cooper Group, Inc. (a)                | 200    | 30                        | 0,02                              | Swiss Prime Site AG                            | 173    | 26                        | 0,02                              | CRE Logistics REIT, Inc.                          | 1      | 1                         | 0,00                              |
| <b>GESUNDHEITSWESSEN</b>                 |        |                           |                                   | TAG Immobilien AG                              | 223    | 4                         | 0,00                              | Crombie Real Estate Investment Trust              | 242    | 3                         | 0,00                              |
| Amedisys, Inc. (a)                       | 400    | 40                        | 0,02                              | Tokyo Tatemono Co. Ltd.                        | 399    | 7                         | 0,00                              | Cromwell Property Group                           | 1.122  | 0                         | 0,00                              |
| Chartwell Retirement Residences          | 612    | 8                         | 0,01                              | UOL Group Ltd.                                 | 1.063  | 5                         | 0,00                              | CubeSmart                                         | 1.199  | 51                        | 0,03                              |
|                                          |        | 48                        | 0,03                              | Vonovia SE                                     | 1.368  | 48                        | 0,03                              | Curblin Properties Corp.                          | 198    | 5                         | 0,00                              |
| <b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>           |        |                           |                                   | Wallenstam AB 'B'                              | 1.010  | 5                         | 0,00                              | Custodian Property Income Reit PLC                | 1.543  | 2                         | 0,00                              |
| ANSYS, Inc. (a)                          | 100    | 35                        | 0,02                              | Wihlborgs Fastigheter AB                       | 672    | 7                         | 0,00                              | Daiwa House REIT Investment Corp.                 | 5      | 8                         | 0,01                              |
| NEXTDC Ltd. (a)                          | 2.956  | 28                        | 0,01                              |                                                |        | 497                       | 0,26                              | Daiwa Office Investment Corp.                     | 1      | 2                         | 0,00                              |
|                                          |        | 63                        | 0,03                              |                                                |        | 815                       | 0,43                              | Daiwa Securities Living Investments Corp.         | 4      | 3                         | 0,00                              |
| <b>BAUSTOFFE</b>                         |        |                           |                                   | <b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>                      |        |                           |                                   | Dexus                                             | 3.243  | 14                        | 0,01                              |
| Gold Road Resources Ltd.                 | 7.460  | 16                        | 0,01                              | Nationwide Building Society                    | 813    | 145                       | 0,08                              | Dexus Industria REIT                              | 189    | 0                         | 0,00                              |
| <b>IMMOBILIEN</b>                        |        |                           |                                   | <b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>           |        |                           |                                   | DiamondRock Hospitality Co.                       | 1.029  | 8                         | 0,01                              |
| Aeon Mall Co. Ltd.                       | 210    | 4                         | 0,00                              | Abacus Storage King                            | 475    | 0                         | 0,00                              | Digital Core REIT Management Pte Ltd.             | 2.017  | 1                         | 0,00                              |
| Alexander & Baldwin, Inc.                | 152    | 3                         | 0,00                              | Acadia Realty Trust                            | 243    | 5                         | 0,00                              | Digital Realty Trust, Inc.                        | 1.909  | 333                       | 0,18                              |
| Allreal Holding AG                       | 33     | 8                         | 0,01                              | Activia Properties, Inc.                       | 6      | 5                         | 0,00                              | Douglas Emmett, Inc.                              | 345    | 5                         | 0,00                              |
| Amot Investments Ltd.                    | 488    | 3                         | 0,00                              | Advance Residence Investment Corp.             | 6      | 6                         | 0,00                              | Dream Industrial Real Estate Investment Trust (f) | 601    | 5                         | 0,00                              |
| Aroundtown S.A.                          | 663    | 2                         | 0,00                              | Aedifica S.A.                                  | 79     | 6                         | 0,00                              | Easterly Government Properties, Inc.              | 89     | 2                         | 0,00                              |
| Azrieli Group Ltd.                       | 80     | 7                         | 0,01                              | AEON REIT Investment Corp.                     | 4      | 4                         | 0,00                              | EastGroup Properties, Inc.                        | 263    | 44                        | 0,02                              |
| CA Immobilien Anlagen AG                 | 90     | 3                         | 0,00                              | Agree Realty Corp.                             | 542    | 40                        | 0,02                              | Elme Communities                                  | 183    | 3                         | 0,00                              |
| CapitaLand Investment Ltd.               | 4.994  | 10                        | 0,01                              | AIMS APAC REIT                                 | 1.433  | 1                         | 0,00                              | Empire State Realty Trust, Inc. 'A'               | 306    | 2                         | 0,00                              |
| Castellum AB                             | 1.012  | 13                        | 0,01                              | Alexandria Real Estate Equities, Inc.          | 770    | 56                        | 0,03                              | Empiric Student Property PLC                      | 2.291  | 3                         | 0,00                              |
| Catena AB                                | 91     | 5                         | 0,00                              | Allied Properties Real Estate Investment Trust | 286    | 4                         | 0,00                              | EPR Properties                                    | 390    | 23                        | 0,01                              |
| Cibus Nordic Real Estate AB              | 139    | 3                         | 0,00                              | American Assets Trust, Inc.                    | 107    | 2                         | 0,00                              | Equinix, Inc.                                     | 555    | 441                       | 0,24                              |
| City Developments Ltd.                   | 1.031  | 4                         | 0,00                              | American Healthcare REIT, Inc.                 | 317    | 12                        | 0,01                              | Equity LifeStyle Properties, Inc.                 | 1.606  | 99                        | 0,05                              |
| Citycon Oyj (a)                          | 239    | 1                         | 0,00                              | American Homes 4 Rent 'A'                      | 2.797  | 101                       | 0,05                              | Equity Residential                                | 2.174  | 147                       | 0,08                              |
| Corem Property Group AB 'B'              | 1.379  | 1                         | 0,00                              | Americold Realty Trust, Inc.                   | 1.504  | 25                        | 0,01                              | ESR-REIT                                          | 1.511  | 3                         | 0,00                              |
| Deutsche EuroShop AG                     | 48     | 1                         | 0,00                              | Apartment Investment and Management Co. 'A'    | 312    | 3                         | 0,00                              | Essential Properties Realty Trust, Inc.           | 1.517  | 48                        | 0,03                              |
| Dios Fastigheter AB                      | 234    | 2                         | 0,00                              | Apple Hospitality REIT, Inc.                   | 1.164  | 14                        | 0,01                              | Essex Property Trust, Inc.                        | 377    | 107                       | 0,06                              |
| Entra ASA                                | 160    | 2                         | 0,00                              | Arena REIT                                     | 351    | 1                         | 0,00                              | Eurocommercial Properties NV                      | 113    | 4                         | 0,00                              |
| Fabege AB                                | 569    | 5                         | 0,00                              | Armada Hoffer Properties, Inc.                 | 329    | 2                         | 0,00                              | Extra Space Storage, Inc.                         | 1.005  | 148                       | 0,08                              |
| Fastighets AB Balder 'B' (a)             | 1.624  | 12                        | 0,01                              | Assura PLC                                     | 12.219 | 8                         | 0,01                              | Far East Hospitality Trust                        | 2.286  | 1                         | 0,00                              |
| FastPartner AB                           | 116    | 1                         | 0,00                              | AvalonBay Communities, Inc.                    | 857    | 174                       | 0,09                              | Federal Realty Investment Trust                   | 643    | 61                        | 0,03                              |
| Heiwa Real Estate Co. Ltd. (a)           | 122    | 2                         | 0,00                              | Boardwalk Real Estate Investment Trust         | 90     | 5                         | 0,00                              | First Capital Real Estate Investment Trust        | 486    | 6                         | 0,00                              |
| Hongkong Land Holdings Ltd.              | 2.164  | 13                        | 0,01                              | Brandywine Realty Trust                        | 380    | 2                         | 0,00                              | First Industrial Realty Trust, Inc.               | 1.070  | 52                        | 0,03                              |
| Hufvudstaden AB 'A'                      | 241    | 3                         | 0,00                              | British Land Co. PLC                           | 1.296  | 7                         | 0,01                              | Fortune Real Estate Investment Trust              | 3.261  | 2                         | 0,00                              |
| Hulic Co. Ltd.                           | 1.213  | 12                        | 0,01                              | Brixmor Property Group, Inc.                   | 632    | 16                        | 0,01                              | Four Corners Property Trust, Inc.                 | 201    | 5                         | 0,00                              |
| Intea Fastigheter AB                     | 131    | 1                         | 0,00                              | Broadstone Net Lease, Inc.                     | 2.707  | 43                        | 0,02                              | Frasers Centrepoint Trust                         | 2.481  | 4                         | 0,00                              |
| Intershop Holding AG                     | 12     | 2                         | 0,00                              | BWP Trust                                      | 484    | 1                         | 0,00                              | Frasers Logistics & Commercial Trust              | 6.125  | 4                         | 0,00                              |
| Kennedy-Wilson Holdings, Inc.            | 509    | 4                         | 0,00                              | BXP, Inc.                                      | 330    | 22                        | 0,01                              | Frontier Real Estate Investment Corp.             | 6      | 3                         | 0,00                              |
| Kiwi Property Group Ltd.                 | 1.195  | 1                         | 0,00                              | Camden Property Trust                          | 635    | 72                        | 0,04                              | Fukuoka REIT Corp.                                | 2      | 2                         | 0,00                              |
| Kojamo Oyj                               | 419    | 5                         | 0,00                              | Canadian Apartment Properties REIT             | 361    | 12                        | 0,01                              | Gaming and Leisure Properties, Inc.               | 2.006  | 94                        | 0,05                              |
| LEG Immobilien AG                        | 136    | 12                        | 0,01                              | CapitaLand Ascendas REIT                       | 8.334  | 18                        | 0,01                              | Gecina S.A.                                       | 103    | 11                        | 0,01                              |
| Lifestyle Communities Ltd.               | 98     | 1                         | 0,00                              | CapitaLand Ascott Trust                        | 5.602  | 4                         | 0,00                              | Getty Realty Corp.                                | 105    | 3                         | 0,00                              |
| Melisron Ltd.                            | 53     | 6                         | 0,00                              | CapitaLand Integrated Commercial Trust         | 12.401 | 21                        | 0,01                              | Global Net Lease, Inc.                            | 419    | 3                         | 0,00                              |
| Mitsubishi Estate Co. Ltd.               | 2.335  | 44                        | 0,02                              | CareTrust REIT, Inc.                           | 392    | 12                        | 0,01                              | Global One Real Estate Investment Corp.           | 2      | 2                         | 0,00                              |
| Mitsui Fudosan Co. Ltd.                  | 5.497  | 53                        | 0,03                              | Carmila S.A.                                   | 150    | 3                         | 0,00                              | GLP J-Reit                                        | 10     | 9                         | 0,01                              |
| Mobimo Holding AG                        | 18     | 7                         | 0,00                              | CDL Hospitality Trusts                         | 1.996  | 1                         | 0,00                              | Goodman Group                                     | 1.771  | 40                        | 0,02                              |
| New World Development Co. Ltd.           | 3.186  | 2                         | 0,00                              | Centerspace                                    | 37     | 2                         | 0,00                              |                                                   |        |                           |                                   |
| Nomura Real Estate Holdings, Inc.        | 1.092  | 6                         | 0,00                              | Centuria Industrial REIT                       | 469    | 1                         | 0,00                              |                                                   |        |                           |                                   |
| NP3 Fastigheter AB                       | 90     | 3                         | 0,00                              |                                                |        |                           |                                   |                                                   |        |                           |                                   |
| Nyfosa AB                                | 356    | 4                         | 0,00                              |                                                |        |                           |                                   |                                                   |        |                           |                                   |

|                                                   |        | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                                                              |        | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                                           |        | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |  |  |  |  |
|---------------------------------------------------|--------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|--------|--------------------------|-----------------------------------|--|--|--|--|
| BESCHREIBUNG                                      | AKTIEN |                          |                                   | BESCHREIBUNG                                                 | AKTIEN |                          |                                   | BESCHREIBUNG                              | AKTIEN |                          |                                   |  |  |  |  |
| Goodman Property Trust                            | 773    | \$ 1                     | 0,00                              | Mercialys S.A.                                               | 247    | \$ 3                     | 0,00                              | Sirius Real Estate Ltd.                   | 5.680  | \$ 8                     | 0,01                              |  |  |  |  |
| GPT Group                                         | 9.036  | 29                       | 0,02                              | Merlin Properties Socimi S.A.                                | 722    | 9                        | 0,01                              | SITE Centers Corp.                        | 106    | 1                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Granite Real Estate Investment Trust              | 132    | 7                        | 0,00                              | Mid-America Apartment Communities, Inc.                      | 569    | 84                       | 0,05                              | SL Green Realty Corp.                     | 149    | 9                        | 0,01                              |  |  |  |  |
| Great Portland Estates PLC                        | 1.332  | 7                        | 0,00                              | Mirai Corp.                                                  | 4      | 1                        | 0,00                              | SmartCentres Real Estate Investment Trust | 299    | 6                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Growthpoint Properties Australia Ltd.             | 243    | 0                        | 0,00                              | Mirvac Group                                                 | 11.789 | 17                       | 0,01                              | SOSiLA Logistics REIT, Inc.               | 2      | 2                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| H&R Real Estate Investment Trust                  | 601    | 5                        | 0,00                              | Mitsubishi Estate Logistics REIT Investment Corp.            | 3      | 2                        | 0,00                              | STAG Industrial, Inc.                     | 960    | 35                       | 0,02                              |  |  |  |  |
| Hamborner REIT AG                                 | 189    | 1                        | 0,00                              | Mitsui Fudosan Logistics Park, Inc.                          | 7      | 5                        | 0,00                              | Star Asia Investment Corp.                | 6      | 2                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Hankyu Hanshin REIT, Inc.                         | 2      | 2                        | 0,00                              | Montea NV                                                    | 54     | 4                        | 0,00                              | Starhill Global REIT                      | 3.298  | 1                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Healthcare Realty Trust, Inc.                     | 1.200  | 19                       | 0,01                              | Mori Hills REIT Investment Corp. 'C'                         | 4      | 4                        | 0,00                              | Stockland                                 | 8.792  | 31                       | 0,02                              |  |  |  |  |
| Healthpeak Properties, Inc.                       | 3.112  | 55                       | 0,03                              | Mori Trust REIT, Inc.                                        | 6      | 3                        | 0,00                              | Summit Hotel Properties, Inc.             | 235    | 1                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Heiwa Real Estate REIT, Inc.                      | 2      | 2                        | 0,00                              | National Health Investors, Inc.                              | 227    | 16                       | 0,01                              | Sun Communities, Inc.                     | 604    | 76                       | 0,04                              |  |  |  |  |
| Highwoods Properties, Inc.                        | 219    | 7                        | 0,00                              | National Storage Affiliates Trust                            | 147    | 5                        | 0,00                              | Sunstone Hotel Investors, Inc.            | 1.006  | 9                        | 0,01                              |  |  |  |  |
| HomeCo Daily Needs REIT                           | 1.555  | 1                        | 0,00                              | National Storage REIT                                        | 8.908  | 13                       | 0,01                              | Suntec Real Estate Investment Trust       | 4.829  | 4                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Hoshino Resorts REIT, Inc.                        | 1      | 2                        | 0,00                              | NETSTREIT Corp.                                              | 171    | 3                        | 0,00                              | Supermarket Income REIT PLC               | 4.711  | 5                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Host Hotels & Resorts, Inc.                       | 4.938  | 76                       | 0,04                              | NexPoint Residential Trust. Inc.                             | 50     | 2                        | 0,00                              | Takara Leben Real Estate Investment Corp. | 2      | 1                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Hulic Reit, Inc.                                  | 3      | 3                        | 0,00                              | Nippon Accommodations Fund, Inc.                             | 5      | 4                        | 0,00                              | Tanger, Inc.                              | 223    | 7                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| ICADE                                             | 86     | 2                        | 0,00                              | Nippon Building Fund, Inc.                                   | 17     | 16                       | 0,01                              | Target Healthcare REIT PLC                | 2.352  | 3                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Ichigo Office REIT Investment Corp.               | 2      | 1                        | 0,00                              | Nippon Prologis REIT, Inc.                                   | 18     | 10                       | 0,01                              | Terreno Realty Corp.                      | 206    | 12                       | 0,01                              |  |  |  |  |
| Independence Realty Trust, Inc.                   | 471    | 8                        | 0,01                              | Nippon REIT Investment Corp.                                 | 4      | 2                        | 0,00                              | Tokyu REIT, Inc.                          | 2      | 3                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp. | 5      | 4                        | 0,00                              | NNN REIT, Inc.                                               | 1.203  | 52                       | 0,03                              | Tritax Big Box REIT PLC                   | 2.542  | 5                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Ingenia Communities Group                         | 329    | 1                        | 0,00                              | Nomura Real Estate Master Fund, Inc.                         | 10     | 10                       | 0,01                              | UDR, Inc.                                 | 2.208  | 90                       | 0,05                              |  |  |  |  |
| Inmobiliaria Colonial Socimi S.A.                 | 376    | 3                        | 0,00                              | NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust | 500    | 2                        | 0,00                              | UMH Properties, Inc.                      | 151    | 3                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Innovative Industrial Properties, Inc.            | 59     | 3                        | 0,00                              | NTT UD REIT Investment Corp.                                 | 3      | 3                        | 0,00                              | Unibail-Rodamco-Westfield SE              | 180    | 17                       | 0,01                              |  |  |  |  |
| InterRent Real Estate Investment Trust            | 310    | 3                        | 0,00                              | Omega Healthcare Investors, Inc.                             | 1.414  | 52                       | 0,03                              | UNITE Group PLC                           | 408    | 5                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| InvenTrust Properties Corp.                       | 394    | 11                       | 0,01                              | Orix JREIT, Inc.                                             | 6      | 8                        | 0,01                              | United Urban Investment Corp.             | 5      | 5                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Invincible Investment Corp.                       | 17     | 7                        | 0,00                              | Paramount Group, Inc.                                        | 414    | 3                        | 0,00                              | Urban Edge Properties                     | 643    | 12                       | 0,01                              |  |  |  |  |
| Invitation Homes, Inc.                            | 4.394  | 144                      | 0,08                              | Park Hotels & Resorts, Inc.                                  | 1.044  | 11                       | 0,01                              | Vastned NV                                | 28     | 1                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Irish Residential Properties REIT PLC             | 1.179  | 1                        | 0,00                              | Parkway Life Real Estate Investment Trust                    | 987    | 3                        | 0,00                              | Ventas, Inc.                              | 2.407  | 152                      | 0,08                              |  |  |  |  |
| Iron Mountain, Inc.                               | 1.576  | 162                      | 0,09                              | Pebblebrook Hotel Trust                                      | 249    | 3                        | 0,00                              | Veris Residential, Inc.                   | 164    | 2                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Japan Excellent. Inc.                             | 3      | 3                        | 0,00                              | Phillips Edison & Co., Inc.                                  | 901    | 32                       | 0,02                              | VICI Properties, Inc.                     | 6.297  | 205                      | 0,11                              |  |  |  |  |
| Japan Hotel REIT Investment Corp.                 | 12     | 6                        | 0,00                              | Piedmont Office Realty Trust, Inc. 'A'                       | 277    | 2                        | 0,00                              | Vicinity Ltd                              | 11.248 | 18                       | 0,01                              |  |  |  |  |
| Japan Logistics Fund, Inc.                        | 6      | 4                        | 0,00                              | Precinct Properties Group                                    | 984    | 1                        | 0,00                              | Vornado Realty Trust                      | 368    | 14                       | 0,01                              |  |  |  |  |
| Japan Prime Realty Investment Corp.               | 8      | 5                        | 0,00                              | Primaris Real Estate Investment Trust                        | 217    | 2                        | 0,00                              | Warehouse de Pauw S.C.A.                  | 326    | 8                        | 0,01                              |  |  |  |  |
| Japan Real Estate Investment Corp.                | 16     | 13                       | 0,01                              | Primary Health Properties PLC                                | 4.978  | 7                        | 0,00                              | Waypoint REIT Ltd.                        | 601    | 1                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Japan Metropolitan Fund Investment Corp.          | 16     | 11                       | 0,01                              | Prologis, Inc.                                               | 4.752  | 500                      | 0,27                              | Welltower, Inc.                           | 3.860  | 593                      | 0,32                              |  |  |  |  |
| JBG SMITH Properties                              | 168    | 3                        | 0,00                              | PRS REIT PLC                                                 | 1.958  | 3                        | 0,00                              | Wereldhave NV                             | 93     | 2                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| KDX Realty Investment Corp.                       | 9      | 10                       | 0,01                              | Public Storage                                               | 857    | 251                      | 0,13                              | Workspace Group PLC                       | 523    | 3                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Keppel DC REIT                                    | 3.396  | 6                        | 0,00                              | Realty Income Corp.                                          | 4.517  | 260                      | 0,14                              | WP Carey, Inc.                            | 857    | 53                       | 0,03                              |  |  |  |  |
| Keppel REIT                                       | 5.381  | 4                        | 0,00                              | Regency Centers Corp.                                        | 971    | 69                       | 0,04                              | Xenia Hotels & Resorts, Inc.              | 213    | 3                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Killam Apartment Real Estate Investment Trust     | 263    | 4                        | 0,00                              | Region Group                                                 | 1.037  | 2                        | 0,00                              | Xior Student Housing NV                   | 104    | 4                        | 0,00                              |  |  |  |  |
| Kilroy Realty Corp.                               | 240    | 8                        | 0,01                              | Regional REIT Ltd.                                           | 445    | 1                        | 0,00                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Kimco Realty Corp.                                | 4.853  | 102                      | 0,06                              | Retail Estates NV                                            | 33     | 2                        | 0,00                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Kite Realty Group Trust                           | 2.755  | 62                       | 0,03                              | Rexford Industrial Realty, Inc.                              | 462    | 16                       | 0,01                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Kleierre S.A.                                     | 366    | 14                       | 0,01                              | RioCan Real Estate Investment Trust                          | 672    | 9                        | 0,01                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| LaSalle Logiport REIT                             | 4      | 4                        | 0,00                              | RLJ Lodging Trust                                            | 314    | 2                        | 0,00                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Lendlease Global Commercial REIT                  | 3.945  | 2                        | 0,00                              | Ryman Hospitality Properties, Inc.                           | 309    | 31                       | 0,02                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Lineage, Inc.                                     | 127    | 6                        | 0,00                              | Sabra Health Care REIT, Inc.                                 | 1.236  | 23                       | 0,01                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Link REIT                                         | 5.840  | 31                       | 0,02                              | Safehold, Inc.                                               | 235    | 4                        | 0,00                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| LondonMetric Property PLC                         | 3.327  | 9                        | 0,01                              | Safestore Holdings PLC                                       | 810    | 8                        | 0,01                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| LTC Properties, Inc.                              | 222    | 8                        | 0,01                              | Samty Residential Investment Corp.                           | 1      | 1                        | 0,00                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| LXP Industrial Trust                              | 1.484  | 12                       | 0,01                              | Scentre Group                                                | 18.759 | 44                       | 0,02                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Macerich Co.                                      | 520    | 8                        | 0,01                              | Segro PLC                                                    | 922    | 9                        | 0,01                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Mapletree Industrial Trust                        | 4.308  | 7                        | 0,00                              | Sekisui House Reit, Inc.                                     | 9      | 5                        | 0,00                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Mapletree Logistics Trust                         | 7.468  | 7                        | 0,00                              | Sila Realty Trust, Inc.                                      | 282    | 7                        | 0,00                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Mapletree Pan Asia Commercial Trust               | 4.861  | 5                        | 0,00                              | Simon Property Group, Inc.                                   | 1.863  | 300                      | 0,16                              |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
| Medical Properties Trust, Inc.                    | 1.247  | 5                        | 0,00                              |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |
|                                                   |        |                          |                                   |                                                              |        |                          |                                   |                                           |        |                          |                                   |  |  |  |  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGETEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month EURIBOR September Futures                              | Short | 09.2025     | 115                  | \$ (102)                                 | (0,05)               |
| 3-Month EURIBOR September Futures                              | Long  | 09.2026     | 115                  | 91                                       | 0,05                 |
| Australia Government 3-Year Note September Futures             | Short | 09.2025     | 8                    | (2)                                      | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures            | Long  | 09.2025     | 75                   | 45                                       | 0,02                 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures                         | Long  | 09.2025     | 7                    | 40                                       | 0,02                 |
| Euro STOXX 50 September Futures                                | Long  | 09.2025     | 36                   | 4                                        | 0,00                 |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Short | 09.2025     | 36                   | 16                                       | 0,01                 |
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 72                   | 30                                       | 0,02                 |
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09.2025     | 42                   | 35                                       | 0,02                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Long  | 09.2025     | 6                    | (9)                                      | (0,01)               |
| Euro-Oat September Futures                                     | Short | 09.2025     | 101                  | 101                                      | 0,05                 |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 146                  | (31)                                     | (0,02)               |
| FTSE 100 Index September Futures                               | Long  | 09.2025     | 5                    | 0                                        | 0,00                 |
| US Treasury 2-Year Note September Futures                      | Short | 09.2025     | 174                  | (143)                                    | (0,07)               |
| US Treasury 5-Year Note September Futures                      | Short | 09.2025     | 154                  | (155)                                    | (0,08)               |
| US Treasury 10-Year Note September Futures                     | Long  | 09.2025     | 59                   | 31                                       | 0,02                 |
| US Treasury 10-Year Ultra September Futures                    | Long  | 09.2025     | 54                   | 136                                      | 0,07                 |
| US Treasury Long-Term Bond September Futures                   | Short | 09.2025     | 165                  | (816)                                    | (0,43)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 77                   | 286                                      | 0,15                 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025     | 57                   | 102                                      | 0,05                 |
|                                                                |       |             |                      | <b>\$ (341)</b>                          | <b>(0,18)</b>        |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                      | <b>\$ (341)</b>                          | <b>(0,18)</b>        |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz              | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------|------------------|------------|------------------------------------------|----------------------|
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 1,500 %         | 15.06.2052       | £ 1.900    | \$ 31                                    | 0,02                 |
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500           | 19.03.2030       | 17.900     | 132                                      | 0,07                 |
| Erhalt                                         | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 16.06.2031       | ¥ 50.000   | 17                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                         | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,450           | 20.03.2029       | 154.390    | 61                                       | 0,03                 |
| Erhalt                                         | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500           | 15.12.2031       | 77.000     | 15                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                         | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,550           | 14.09.2028       | 1.950.000  | 117                                      | 0,06                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,237           | 21.11.2053       | \$ 1.730   | 480                                      | 0,25                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,865           | 13.02.2054       | 10.900     | 1.830                                    | 0,97                 |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,085           | 13.02.2034       | 6.100      | (213)                                    | (0,11)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250           | 19.03.2035       | 4.700      | (149)                                    | (0,08)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,500           | 20.06.2054       | 2.600      | 126                                      | 0,07                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750           | 15.05.2032       | 1.603      | (23)                                     | (0,01)               |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,100           | 15.11.2052       | 2.450      | (49)                                     | (0,03)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,250           | 20.12.2025       | 34.000     | (172)                                    | (0,09)               |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 0,190           | 04.11.2052       | € 200      | 105                                      | 0,06                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 0,195           | 04.11.2052       | 200        | 117                                      | 0,06                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 0,197           | 08.11.2052       | 400        | 209                                      | 0,11                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,000           | 17.09.2027       | 14.300     | (66)                                     | (0,04)               |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,112           | 02.09.2027       | 3.500      | (10)                                     | (0,01)               |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,120           | 03.09.2027       | 19.600     | (57)                                     | (0,03)               |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2035       | 35.660     | 363                                      | 0,19                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250           | 17.09.2055       | 10.800     | 314                                      | 0,17                 |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,879           | 15.08.2032       | 8.400      | 447                                      | 0,24                 |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 1,636           | 15.06.2027       | 1.700      | 4                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,034           | 15.09.2034       | 800        | (5)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,049           | 15.08.2034       | 2.700      | (22)                                     | (0,01)               |
| Erhalt                                         | CPTFEMU                           | 2,470           | 15.07.2032       | 1.100      | (2)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 2,590           | 15.12.2052       | 500        | 52                                       | 0,03                 |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 2,680           | 15.04.2053       | 1.500      | 217                                      | 0,12                 |
| Zahlung                                        | CPTFEMU                           | 2,700           | 15.04.2053       | 900        | 113                                      | 0,06                 |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 1,280           | 19.05.2030       | \$ 600     | (53)                                     | (0,03)               |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 1,954           | 03.06.2029       | 750        | (72)                                     | (0,04)               |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,165           | 16.04.2029       | 500        | (49)                                     | (0,03)               |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,379           | 09.07.2028       | 300        | (31)                                     | (0,02)               |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 2,380           | 15.10.2025       | 700        | (3)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | CPURNSA                           | 2,703           | 25.05.2026       | 300        | 30                                       | 0,02                 |
| Erhalt                                         | CPURNSA                           | 2,813           | 14.05.2026       | 300        | 30                                       | 0,02                 |
| Zahlung                                        | CPURNSA                           | 3,043           | 21.02.2026       | 900        | (1)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                        | UKRPI                             | 3,480           | 15.01.2030       | £ 800      | (180)                                    | (0,10)               |
| Zahlung                                        | UKRPI                             | 4,040           | 15.04.2029       | 1.000      | 32                                       | 0,02                 |
| Erhalt                                         | UKRPI                             | 4,288           | 15.02.2032       | 1.530      | 63                                       | 0,03                 |
| Erhalt                                         | UKRPI                             | 4,615           | 15.02.2027       | 1.100      | 61                                       | 0,03                 |
|                                                |                                   |                 |                  |            | <b>\$ 3.809</b>                          | <b>2,02</b>          |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                   |                 |                  |            | <b>\$ 3.809</b>                          | <b>2,02</b>          |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.



## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## VERKAUFSOPTIONEN

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung      | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz                                         | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermö-gens |
|------------|-------------------|--------------------|------------------------------------------------------------|---------------|---------------------------|---------|------------|------------------------|
| GLM        | Cap - OTC CPALEMU | \$ 100,151         | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035    | 300                       | \$ (14) | \$ (8)     | 0,00                   |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen       | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermö-gens |
|------------|----------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|------------|------------------------|
| GST        | CMBX.NA.AAA.10 INDEX | 0,500 %                     | 17.11.2059       | \$ 200                    | \$ (6)                                 | \$ 7                                      | \$ 1       | 0,00                   |
| MYC        | CMBX.NA.AAA.10 INDEX | 0,500                       | 17.11.2059       | 800                       | (26)                                   | 29                                        | 3          | 0,00                   |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.12 INDEX | 0,500                       | 17.08.2061       | 200                       | 0                                      | 1                                         | 1          | 0,00                   |
| UAG        | CMBX.NA.AAA.10 INDEX | 0,500                       | 17.11.2059       | 400                       | (12)                                   | 14                                        | 2          | 0,00                   |
|            |                      |                             |                  |                           | \$ (44)                                | \$ 51                                     | \$ 7       | 0,00                   |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermö-gens |
|------------|-----------------------------------|-------------------------|-----------------|------------------|------------|---------------------------------------|-------------------------------------------|------------|------------------------|
| MYC        | Erhalt                            | CPURNSA                 | 1,800 %         | 20.07.2026       | \$ 600     | \$ 0                                  | \$ (107)                                  | \$ (107)   | (0,06)                 |
|            | Erhalt                            | CPURNSA                 | 1,805           | 20.09.2026       | 50         | 0                                     | (9)                                       | (9)        | 0,00                   |
|            | Erhalt                            | CPURNSA                 | 1,810           | 19.07.2026       | 500        | 0                                     | (89)                                      | (89)       | (0,05)                 |
|            |                                   |                         |                 |                  |            | \$ 0                                  | \$ (205)                                  | \$ (205)   | (0,11)                 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier     | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz                     | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermö-gens |
|------------|----------------|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|------------|------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|------------|------------------------|
| BOA        | Erhalt         | MLPIREIL Index | 18.195                            | 4,980 %                                | \$ 1.717   | 10.06.2026       | \$ 0                                   | \$ 7                                      | \$ 7       | 0,00                   |
|            | Zahlung        | MLPIREIS Index | 17.301                            | 4,830                                  | 1.573      | 10.06.2026       | 0                                      | (15)                                      | (15)       | (0,01)                 |
| JPM        | Erhalt         | JMABDEWU Index | 1.627                             | 0,053                                  | 257        | 15.07.2026       | 0                                      | 0                                         | 0          | 0,00                   |
|            | Erhalt         | JMABNIUS Index | 74.518                            | 0,000                                  | 13.778     | 15.07.2026       | 0                                      | (442)                                     | (442)      | (0,24)                 |
| MAC        | Erhalt         | PIMCODBU Index | 143.671                           | 0,150                                  | 24.849     | 15.09.2025       | 0                                      | (795)                                     | (795)      | (0,42)                 |
|            | Erhalt         | PIMCODBV Index | 67.717                            | 0,600                                  | 5.337      | 15.09.2025       | 0                                      | 300                                       | 300        | 0,16                   |
| MYI        | Erhalt         | TRNGLU Index   | 360                               | FEDL01 abzgl. eines bestimmten Spreads | 1.885      | 04.03.2026       | 0                                      | 10                                        | 10         | 0,01                   |
| UAG        | Erhalt         | TRNGLU Index   | 1.679                             | 3,865 %                                | 8.791      | 16.07.2025       | 0                                      | 51                                        | 51         | 0,03                   |
|            |                |                |                                   |                                        |            |                  | \$ 0                                   | \$ (884)                                  | \$ (884)   | (0,47)                 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier             | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz                    | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermö-gens |
|------------|----------------|------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|------------|------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|------------|------------------------|
| BOA        | Zahlung        | Synopsys, Inc.         | 34                                | FEDL01 zzgl. eines bestimmten Spreads | \$ 16      | 21.01.2026       | \$ 0                                   | \$ (2)                                    | \$ (2)     | 0,00                   |
|            | Zahlung        | Rocket Companies, Inc. | 2.913                             | (9,610) %                             | 37         | 11.03.2026       | 0                                      | (4)                                       | (4)        | 0,00                   |
| MYI        | Zahlung        | Chevron Corp.          | 410                               | FEDL01 zzgl. eines bestimmten Spreads | 56         | 09.07.2025       | 0                                      | (2)                                       | (2)        | 0,00                   |
|            |                |                        |                                   |                                       |            |                  | \$ 0                                   | \$ (8)                                    | \$ (8)     | 0,00                   |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                 | 1.873                 | \$ 260                        | \$ 0                            | \$ (2)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 3.847                 | AUD 5.921                     | 34                              | 0                                              | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 131                   | € 116                         | 4                               | 4                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 147                   | NZD 244                       | 1                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | 5.921                 | \$ 3.849                      | 0                               | (34)                                           | (0,02)               |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOA        | 08.2025          | CNH                    | 4.021                    | \$ 560                           | \$ 0                               | \$ (3)                                               | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD                    | 244                      | 147                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 144                      | 94                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 199.506                  | 146                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 28                       | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 203                      | IDR 3.314.013                    | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 1.452                    | \$ 203                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 62                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 08.2025          | \$                     | 22                       | SGD                              | 28                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 5.319                    | \$ 3.864                         | 0                                  | (35)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025          | NOK                    | 405                      | 40                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 3.273                    | 100                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 4.393                    | 135                              | 0                                  | (16)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 180                      | BRL 1.002                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 24                       | € 21                             | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 479                      | IDR 7.820.843                    | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 40                       | THB                              | 1.311                              | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 101                      | TWD                              | 2.996                              | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 1.820                    | \$ 255                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 5.693                    | 178                              | 0                                  | (20)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 105                      | CZK 2.344                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 368                      | INR 31.947                       | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 438                      | TWD 13.100                       | 17                                 | 0                                                    | 0,01                    |
| BRC        | 07.2025          | AUD                    | 76                       | \$ 49                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 25.528                   | 28.994                           | 0                                  | (973)                                                | (0,53)                  |
|            | 07.2025          | ILS                    | 621                      | 178                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 29.174                   | 21                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 88                       | ILS 299                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 50                       | PLN 189                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 604                      | TRY 24.463                       | 11                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 673                      | ZAR 12.166                       | 10                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          |                        | 1.040                    | CZK 23.135                       | 60                                 | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 08.2025          |                        | 761                      | TRY 31.647                       | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | DKK                    | 4.400                    | \$ 670                           | 0                                  | (22)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 156                      | BRL 884                          | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 09.2025          |                        | 312                      | PEN 1.143                        | 9                                  | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          | BRL                    | 1.162                    | \$ 200                           | 0                                  | (13)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | ¥                      | 22.700                   | 159                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 3.445                    | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | SGD                    | 45                       | 35                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 6.615                    | 203                              | 0                                  | (24)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 2.877                    | CNY 20.623                       | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 670                      | IDR 10.913.497                   | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.407                    | KRW 1.929.490                    | 19                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 517                      | THB 17.192                       | 12                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025          |                        | 132                      | TWD 3.901                        | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 626                      | \$ 87                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 10.265                   | 316                              | 0                                  | (41)                                                 | (0,02)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 144                      | COP 599.775                      | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 2.752                    | INR 237.214                      | 9                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ILS                    | 301                      | \$ 87                            | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW                    | 27.272                   | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 520                      | DKK 3.311                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 27.930                   | € 24.075                         | 332                                | 0                                                    | 0,18                    |
|            | 07.2025          |                        | 22                       | IDR 362.149                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 22                       | TWD 654                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 3.303                    | \$ 520                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
| FAR        | 08.2025          | €                      | 24.022                   | 27.930                           | 0                                  | (332)                                                | (0,18)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.276                    | INR 110.079                      | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 190                      | TWD 6.051                        | 20                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 09.2025          | MXN                    | 74                       | \$ 4                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | AUD                    | 5.701                    | 3.679                            | 0                                  | (58)                                                 | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | BRL                    | 23.089                   | 4.180                            | 0                                  | (50)                                                 | (0,03)                  |
|            | 07.2025          | CHF                    | 512                      | 622                              | 0                                  | (21)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CNH                    | 1.000                    | 139                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 23                       | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 3.901                    | BRL 22.305                       | 187                                | 0                                                    | 0,10                    |
|            | 07.2025          |                        | 680                      | CHF 544                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 707                      | DKK 4.500                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 9.573                    | ¥ 1.393.455                      | 74                                 | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025          |                        | 756                      | PLN 2.789                        | 15                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CHF                    | 542                      | \$ 680                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 1.921                    | 268                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | DKK                    | 4.489                    | 707                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | ¥                      | 1.388.331                | 9.573                            | 0                                  | (74)                                                 | (0,04)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 610                      | INR 52.721                       | 4                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 18                       | SGD 23                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 09.2025          |                        | 4.180                    | BRL 23.442                       | 50                                 | 0                                                    | 0,03                    |
|            | 09.2025          |                        | 3.185                    | MXN 62.013                       | 71                                 | 0                                                    | 0,04                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 9                        | \$ 7                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 2.123                    | 65                               | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 159                      | IDR 2.588.738                    | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1.392                    | MYR 5.894                        | 9                                  | 0                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| JPM        | 08.2025          | \$                  | 710                   | HUF                           | 257.253                         | \$ 43                                          | 0,02                 |
|            | 08.2025          |                     | 7                     | SGD                           | 9                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CHF                 | 33                    | \$                            | 40                              | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 951                   |                               | 132                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | DKK                 | 3.409                 |                               | 516                             | (20)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | KRW                 | 36.191                |                               | 27                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 144                   |                               | 86                              | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 19                    |                               | 15                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 4.273                 |                               | 131                             | (16)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 88                    | KRW                           | 119.926                         | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 341                   | PHP                           | 19.024                          | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.901                 | PLN                           | 7.058                           | 52                                             | 0,03                 |
|            | 07.2025          |                     | 165                   | SGD                           | 212                             | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 193                   | ZAR                           | 3.450                           | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 3.740                 | \$                            | 521                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 7.666                 |                               | 236                             | (31)                                           | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 411                   | INR                           | 35.631                          | 4                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 15                    | SGD                           | 19                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 26                    | TWD                           | 850                             | 4                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH                 | 908                   | \$                            | 126                             | (1)                                            | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | ¥                   | 1.441.621             |                               | 10.034                          | 54                                             | 0,03                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 496                   |                               | 384                             | (6)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 1.691                 |                               | 52                              | (6)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 3.871                 | CAD                           | 5.321                           | 29                                             | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.526                 | €                             | 1.337                           | 44                                             | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 485                   | £                             | 358                             | 5                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 101                   | HKD                           | 790                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 146                   | IDR                           | 2.377.901                       | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 192                   | PHP                           | 10.740                          | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 387                   | PLN                           | 1.450                           | 14                                             | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 398                   | SGD                           | 510                             | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 261                   | THB                           | 8.630                           | 5                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 7                     | TWD                           | 218                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CAD                 | 5.312                 | \$                            | 3.871                           | (29)                                           | (0,01)               |
|            | 08.2025          | CNH                 | 2.359                 |                               | 328                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 11.129                |                               | 345                             | (41)                                           | (0,02)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 384                   | SGD                           | 495                             | 6                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 712.988               | \$                            | 4.935                           | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 110                   | €                             | 94                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 4                     | £                             | 3                               | 0                                              | 0,00                 |
| MYI        | 07.2025          |                     | 3.044                 | ¥                             | 443.940                         | 29                                             | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 36                    | NOK                           | 367                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 4                     | PLN                           | 15                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 5                     | SGD                           | 7                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 1.958                 | \$                            | 273                             | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 442.308               |                               | 3.044                           | (29)                                           | (0,02)               |
|            | 08.2025          | NOK                 | 367                   |                               | 36                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 203                   | £                             | 150                             | 2                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNY                 | 20.670                | \$                            | 2.886                           | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 5                     |                               | 1                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 50                    |                               | 30                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 99                    |                               | 77                              | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 592                   |                               | 20                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 739                   | IDR                           | 12.039.354                      | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 4                     | ¥                             | 551                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 3.373                 | \$                            | 472                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 549                   |                               | 4                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 854                   |                               | 26                              | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 165                   | CNH                           | 1.180                           | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 2.886                 | CNY                           | 20.615                          | 1                                              | 0,00                 |
| RYL<br>SCX | 08.2025          |                     | 430                   | INR                           | 36.934                          | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 77                    | SGD                           | 99                              | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 65                    | €                             | 57                              | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 446                   | ¥                             | 64.400                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 281                   | RON                           | 1.232                           | 4                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | ¥                   | 64.164                | \$                            | 446                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 33                    | HUF                           | 12.142                          | 2                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 2                     | INR                           | 213                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 9.092                 | \$                            | 12.311                          | (148)                                          | (0,08)               |
|            | 07.2025          |                     | 180                   |                               | 244                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS                 | 46                    |                               | 13                              | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ¥                   | 465.214               |                               | 3.214                           | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 29.114                |                               | 21                              | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 486                   | CLP                           | 455.036                         | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 21                    | KRW                           | 29.128                          | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 213                   | RON                           | 935                             | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 41                    | THB                           | 1.370                           | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH                 | 814                   | \$                            | 114                             | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NZD                 | 50                    |                               | 30                              | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 5.138                 | ¥                             | 739.980                         | (15)                                           | (0,01)               |
|            | 08.2025          | ¥                   | 737.257               | \$                            | 5.138                           | 15                                             | 0,01                 |
| SSB<br>UAG |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
| WST        |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       | \$ 1.340                      | \$ (2.127)                      | \$ (787)                                       | (0,43)               |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | € 15.685            | \$ 18.366             | \$ 0                          | \$ (48)                         | \$ (48)                                        | (0,02)               |
|            | 07.2025          | \$ 3.834            | € 3.374               | 127                           | 0                               | 127                                            | 0,07                 |
|            | 08.2025          | 18.406              | 15.685                | 46                            | 0                               | 46                                             | 0,02                 |
| BOA        | 07.2025          | 18.522              | 16.290                | 600                           | 0                               | 600                                            | 0,32                 |
| BPS        | 07.2025          | € 259               | \$ 298                | 0                             | (6)                             | (6)                                            | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | 209                 | 238                   | 0                             | (7)                             | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 18.627           | € 16.402              | 628                           | 0                               | 628                                            | 0,33                 |
| CBK        | 07.2025          | € 366               | \$ 419                | 0                             | (11)                            | (11)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | SGD 1               | 1                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 7                | € 6                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 15.870            | \$ 18.410             | 0                             | (219)                           | (219)                                          | (0,12)               |
|            | 08.2025          | \$ 18.410           | € 15.835              | 219                           | 0                               | 219                                            | 0,12                 |
| JPM        | 07.2025          | SGD 14              | \$ 11                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| MBC        | 07.2025          | € 721               | 831                   | 0                             | (17)                            | (17)                                           | (0,01)               |
|            | 07.2025          | KRW 43.280          | 32                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD 33              | 26                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 27               | SGD 35                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD 35              | \$ 27                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | \$ 5                | SGD 7                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD 7               | \$ 5                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| UAG        | 07.2025          | \$ 32               | KRW 43.280            | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | KRW 43.280          | \$ 32                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 1.620                      | \$ (308)                        | \$ 1.312                                       | 0,70                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 99                | \$ 136                | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 136              | £ 99                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | £ 535               | \$ 728                | 0                             | (6)                             | (6)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 146              | £ 108                 | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 701                 | 515                   | 5                             | 0                               | 5                                              | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | 4                   | 3                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | 713                 | 529                   | 12                            | 0                               | 12                                             | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025          | £ 24                | \$ 32                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SSB        | 07.2025          | 510                 | 699                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 714              | £ 527                 | 9                             | 0                               | 9                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 699                 | 510                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 28                         | \$ (6)                          | \$ 22                                          | 0,01                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| BOA                              | 07.2025          | € 0                 | \$ 0                  | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                           | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | SGD 283             | 221                   | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$ 221              | SGD 283               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| BRC                              | 07.2025          | 5                   | 7                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| CBK                              | 07.2025          | SGD 2               | \$ 2                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| DUB                              | 07.2025          | \$ 0                | € 0                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | 101                 | SGD 130               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | € 0                 | \$ 0                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| FAR                              | 07.2025          | SGD 254             | 199                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 255              | SGD 327               | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | 199                 | 254                   | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| GLM                              | 07.2025          | SGD 99              | \$ 77                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$ 77               | SGD 98                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| JPM                              | 07.2025          | SGD 232             | \$ 181                | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 591              | SGD 759               | 5                             | 0                               | 5                                              | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | 181                 | 232                   | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| MBC                              | 07.2025          | SGD 706             | \$ 546                | 0                             | (8)                             | (8)                                            | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 433              | SGD 556               | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | 546                 | 704                   | 8                             | 0                               | 8                                              | 0,01                 |
| MYI                              | 07.2025          | SGD 49              | \$ 38                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|                                  | 07.2025          | \$ 5                | SGD 6                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
| SCX                              | 07.2025          | SGD 120             | \$ 93                 | 0                             | (1)                             | (1)                                            | 0,00                 |
|                                  | 08.2025          | \$ 93               | SGD 120               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                 |
| UAG                              | 07.2025          | SGD 1               | \$ 1                  | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|                                  |                  |                     |                       | \$ 23                         | \$ (11)                         | \$ 12                                          | 0,01                 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                  |                     |                       |                               |                                 | \$ (539)                                       | (0,29)               |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>     |                 |                           |                                   |
| Ginnie Mae, TBA                  |                 |                           |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055 (e) | \$ 8.400        | \$ (7.638)                | (4,05)                            |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere  |                 | \$ (7.638)                | (4,05)                            |
| Summe Anlagen                    |                 | \$ 247.522                | 131,32                            |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                 | \$ (59.028)               | (31,32)                           |
| Nettovermögen                    |                 | \$ 188.494                | 100,00                            |

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Ein zum 30. Juni 2025 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: null):

| Emittentenbeschreibung                        | Kaufdatum  | Kosten | Marktwert | % des<br>Nettovermögens |
|-----------------------------------------------|------------|--------|-----------|-------------------------|
| Dream Industrial Real Estate Investment Trust | 03.03.2025 | \$ 5   | \$ 5      | 0,00                    |

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 2.273 USD (31. Dezember 2024: 9.147 USD) als Sicherheiten verpfändet.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 25.862 USD (31. Dezember 2024: 33.955 USD) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 3.834 USD (31. Dezember 2024: 3.883 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 1.490 USD (31. Dezember 2024: 1.960 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert <sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 6.443                                                                    | \$ 226.995                                                      | \$ 0                                                         | \$ 233.438        |
| Investmentfonds               | 18.793                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 18.793            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 319                                                                         | 2.610                                                           | 0                                                            | 2.929             |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (7.638)                                                         | 0                                                            | (7.638)           |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 25.555</b>                                                            | <b>\$ 221.967</b>                                               | <b>\$ 0</b>                                                  | <b>\$ 247.522</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 9.904                                                                    | \$ 235.264                                                      | \$ 0                                                         | \$ 245.168        |
| Investmentfonds               | 339                                                                         | 15.417                                                          | 0                                                            | 15.756            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (53)                                                                        | 1.881                                                           | 0                                                            | 1.828             |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 10.190</b>                                                            | <b>\$ 252.562</b>                                               | <b>\$ 0</b>                                                  | <b>\$ 262.752</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Multi-Asset Fund (Forts.)

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BOS                                | 4,500 %    | 26.06.2025       | 02.07.2025       | \$ (1.036)   | \$ (1.037)                               | (0,55)               |
| DEU                                | 4,480      | 25.06.2025       | 02.07.2025       | (1.238)      | (1.238)                                  | (0,66)               |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |              | \$ (2.275)                               | (1,21)               |

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                            | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte <sup>(1)</sup> | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------------------------|----------------------|
| BRC                                   | 4,500 %    | 26.06.2025       | 02.07.2025       | \$ (25.853)  | \$ (25.869)                                                | (13,72)              |
| Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte |            |                  |                  |              | \$ (25.869)                                                | (13,72)              |

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 3 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

|            | Zum 30. Jun. 2025                 |                                    |                                 | Zum 31. Dez. 2024                 |                                    |                                 |
|------------|-----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|---------------------------------|
| Kontrahent | Gesamtmarkt-wert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarkt-wert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 124                            | \$ 0                               | \$ 124                          | \$ (29)                           | \$ 0                               | \$ (29)                         |
| BOA        | 584                               | (340)                              | 244                             | 41                                | 0                                  | 41                              |
| BPS        | (42)                              | 0                                  | (42)                            | (182)                             | 0                                  | (182)                           |
| BRC        | (265)                             | 250                                | (15)                            | 30                                | (30)                               | 0                               |
| BSH        | (7)                               | 0                                  | (7)                             | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           |
| CBK        | (41)                              | 0                                  | (41)                            | (91)                              | 670                                | 579                             |
| DUB        | 24                                | 0                                  | 24                              | (246)                             | 0                                  | (246)                           |
| FAR        | 199                               | 0                                  | 199                             | 157                               | 0                                  | 157                             |
| GLM        | 37                                | (60)                               | (23)                            | (194)                             | 140                                | (54)                            |
| GST        | 1                                 | 0                                  | 1                               | (376)                             | 400                                | 24                              |
| IND        | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           | 20                                | 0                                  | 20                              |
| JPM        | (439)                             | 460                                | 21                              | 11                                | 50                                 | 61                              |
| MAC        | (495)                             | 520                                | 25                              | (36)                              | 300                                | 264                             |
| MBC        | 58                                | 0                                  | 58                              | 689                               | (720)                              | (31)                            |
| MYC        | (202)                             | 260                                | 58                              | (190)                             | 260                                | 70                              |
| MYI        | 6                                 | (50)                               | (44)                            | (6)                               | 0                                  | (6)                             |
| RBC        | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           | 1                                 | 0                                  | 1                               |
| RYL        | 2                                 | 0                                  | 2                               | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           |
| SAL        | 1                                 | 0                                  | 1                               | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           |
| SCX        | 2                                 | 0                                  | 2                               | 289                               | 140                                | 429                             |
| SOG        | 7                                 | 0                                  | 7                               | (11)                              | 0                                  | (11)                            |
| SSB        | (139)                             | 0                                  | (139)                           | (9)                               | 0                                  | (9)                             |
| TOR        | k. A.                             | k. A.                              | k. A.                           | (2)                               | 0                                  | (2)                             |
| UAG        | 47                                | 0                                  | 47                              | (3)                               | 0                                  | (3)                             |
| WST        | (1)                               | 0                                  | (1)                             | (1)                               | 0                                  | (1)                             |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 42,10             | 46,83             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 25,18             | 25,10             |
| Investmentfonds                                                        | 5,42              | 4,63              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,26              | 0,25              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 1,43              | 1,34              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,98              | 0,61              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 24,63             | 21,24             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 0,77              | 0,74              |
| US-Regierungsbehörden            | 37,95             | 37,38             |
| US-Schatzobligationen            | 37,67             | 43,33             |
| Non-Agency-MBS                   | 4,56              | 5,74              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 3,90              | 4,78              |
| Staatsemissionen                 | 34,85             | 39,46             |

| Anlagen zum Marktwert                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|--------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Stammaktien                                            | 0,43              | 0,30              |
| Vorzugswertpapiere                                     | 0,08              | 0,07              |
| Real Estate Investment Trusts                          | 3,64              | 5,24              |
| Investmentfonds                                        | 9,97              | 8,81              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate    |                   |                   |
| Futures                                                | (0,18)            | 0,26              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                    |                   |                   |
| Zinsswaps                                              | 2,02              | 0,84              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                       |                   |                   |
| Inflation-Capped Options                               | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswaptionen                                         | k. A.             | (0,25)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Zinsswaps                                              | (0,11)            | (0,11)            |
| Total Return Swaps auf Indizes                         | (0,47)            | (0,02)            |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere                     | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                 | (0,43)            | 0,76              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                    | 0,72              | (0,46)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                              | (4,05)            | k. A.             |
| Sonstige Aktiva und Passiva                            | (31,32)           | (46,87)           |
| Nettovermögen                                          | 100,00            | 100,00            |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund

| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | % DES                 |                          | BESCHREIBUNG | PARI<br>(000S) | % DES                 |                          | BESCHREIBUNG | PARI (000S) | % DES                 |                          |
|----------------------------------------------|----------------|-----------------------|--------------------------|--------------|----------------|-----------------------|--------------------------|--------------|-------------|-----------------------|--------------------------|
|                                              |                | MARKT-<br>WERT (000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |              |                | MARKT-<br>WERT (000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |              |             | MARKT-<br>WERT (000S) | NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                     |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL             |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| BANKEN UND FINANZEN                          |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| ABN AMRO Bank NV                             |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,575 % fällig am 13.10.2026                 | \$             | 2.500                 | 2.513                    | 0,31         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC     |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,097 % fällig am 08.05.2029                 | 1.000          | 1.031                 | 0,13                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| American Express Co.                         |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,043 % fällig am 26.07.2028                 | 300            | 304                   | 0,04                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Athene Global Funding                        |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 3,046 % fällig am 23.02.2027                 | €              | 1.200                 | 1.416                    | 0,17         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,097 % fällig am 16.07.2026                 | \$             | 1.800                 | 1.803                    | 0,22         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Avolon Holdings Funding Ltd.                 |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,375 % fällig am 30.05.2030                 | 600            | 611                   | 0,07                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Bank Of America Corp.                        |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,623 % fällig am 09.05.2029                 | 1.900          | 1.912                 | 0,23                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Bank of Montreal                             |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,567 % fällig am 10.09.2027                 | 1.600          | 1.604                 | 0,20                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Banque Federative du Credit Mutuel S.A.      |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,194 % fällig am 16.02.2028                 | 900            | 917                   | 0,11                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Barclays PLC                                 |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,304 % fällig am 09.08.2026                 | 3.500          | 3.501                 | 0,43                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 7,325 % fällig am 02.11.2026                 | 1.400          | 1.412                 | 0,17                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| BGC Group, Inc.                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,150 % fällig am 02.04.2030                 | 400            | 406                   | 0,05                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| BPCE S.A.                                    |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,612 % fällig am 19.10.2027                 | 4.100          | 4.198                 | 0,51                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Canadian Imperial Bank of Commerce           |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 3,250 % fällig am 31.03.2027                 | €              | 3.400                 | 4.064                    | 0,50         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Capital One Financial Corp.                  |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,985 % fällig am 24.07.2026                 | \$             | 3.800                 | 3.800                    | 0,46         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Citibank N.A.                                |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,438 % fällig am 30.04.2026                 | 1.900          | 1.915                 | 0,23                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| CNO Global Funding                           |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,875 % fällig am 04.06.2027                 | 1.000          | 1.027                 | 0,13                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Cooperative Rabobank UA                      |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,002 % fällig am 28.08.2026                 | 1.000          | 1.003                 | 0,12                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Coventry Building Society                    |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 2,625 % fällig am 07.12.2026                 | €              | 200                   | 236                      | 0,03         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Credit Agricole SA                           |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,606 % fällig am 11.09.2028                 | \$             | 300                   | 302                      | 0,04         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Deutsche Bank AG                             |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,589 % fällig am 16.11.2027                 | 1.500          | 1.500                 | 0,18                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,119 % fällig am 14.07.2026                 | 2.000          | 2.001                 | 0,24                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Federation des Caisses Desjardins du Quebec  |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,877 % fällig am 30.11.2026                 | £              | 1.300                 | 1.787                    | 0,22         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Ford Credit Canada Co.                       |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 7,000 % fällig am 10.02.2026                 | CAD            | 1.100                 | 821                      | 0,10         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Ford Motor Credit Co. LLC                    |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,125 % fällig am 05.11.2026                 | \$             | 400                   | 399                      | 0,05         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,918 % fällig am 20.03.2028                 | 200            | 202                   | 0,03                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| General Motors Financial Co., Inc.           |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,400 % fällig am 08.05.2027                 | 2.000          | 2.030                 | 0,25                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Goldman Sachs Group, Inc.                    |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,937 % fällig am 23.04.2028                 | 2.200          | 2.218                 | 0,27                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,798 % fällig am 10.08.2026                 | 2.500          | 2.503                 | 0,31                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| HSBC Holdings PLC                            |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,932 % fällig am 14.08.2027                 | 1.900          | 1.917                 | 0,23                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| JPMorgan Chase & Co.                         |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,915 % fällig am 24.01.2029                 | 1.000          | 1.014                 | 0,12                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,070 % fällig am 22.10.2027                 | 1.900          | 1.942                 | 0,24                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| LSEG U.S. Fin Corp.                          |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,875 % fällig am 28.03.2027                 | 500            | 505                   | 0,06                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Manulife Financial Corp.                     |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,150 % fällig am 04.03.2026                 | 1.500          | 1.498                 | 0,18                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Morgan Stanley                               |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,367 % fällig am 13.04.2028                 | 2.000          | 2.012                 | 0,25                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,138 % fällig am 16.10.2026                 | 2.700          | 2.712                 | 0,33                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Morgan Stanley Bank N.A.                     |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,016 % fällig am 12.01.2029                 | 1.200          | 1.219                 | 0,15                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| National Bank of Canada                      |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 3,500 % fällig am 25.04.2028                 | €              | 2.000                 | 2.420                    | 0,30         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| NatWest Group PLC                            |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 7,472 % fällig am 10.11.2026                 | \$             | 1.300                 | 1.313                    | 0,16         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,448 % fällig am 13.09.2027                 | \$             | 200                   | 198                      | 0,02         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Pricoa Global Funding                        |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,200 % fällig am 28.08.2025                 | 2.700          | 2.698                 | 0,33                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Protective Life Global Funding               |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,850 % fällig am 22.07.2026                 | 1.000          | 1.001                 | 0,12                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Royal Bank of Canada                         |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,965 % fällig am 24.01.2029                 | 500            | 507                   | 0,06                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Santander UK Group Holdings PLC              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 6,833 % fällig am 21.11.2026                 | 2.300          | 2.319                 | 0,28                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 7,230 % fällig am 17.03.2026                 | 4.000          | 3.974                 | 0,49                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Src Sukuk Ltd.                               |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,000 % fällig am 27.02.2028                 | 400            | 404                   | 0,05                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Stellantis Finance U.S. Inc.                 |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,350 % fällig am 17.03.2028                 | 200            | 202                   | 0,02                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.        |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,464 % fällig am 13.01.2026                 | 3.300          | 3.317                 | 0,41                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 3,629 % fällig am 06.04.2026                 | €              | 2.000                 | 2.373                    | 0,29         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Toronto-Dominion Bank                        |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 3,879 % fällig am 13.03.2026                 | 6.700          | 7.962                 | 0,97                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Toyota Motor Credit Corp.                    |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,550 % fällig am 07.08.2026                 | \$             | 600                   | 602                      | 0,07         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| UBS AG                                       |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 5,800 % fällig am 11.09.2025                 | 2.200          | 2.206                 | 0,27                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| UBS Group AG                                 |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025                 | 800            | 799                   | 0,10                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,703 % fällig am 05.08.2027                 | 1.600          | 1.603                 | 0,20                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| UBS Switzerland AG                           |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 3,390 % fällig am 05.12.2025                 | €              | 1.200                 | 1.416                    | 0,17         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| VICI Properties LP                           |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,750 % fällig am 01.04.2028                 | \$             | 250                   | 252                      | 0,03         |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| Wells Fargo & Co.                            |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
| 4,808 % fällig am 25.07.2028                 | 4.000          | 4.034                 | 0,49                     |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |
|                                              |                |                       |                          |              |                |                       |                          |              |             |                       |                          |

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 0,680 % fällig am 06.08.2025                            | \$ 4.600       | \$ 4.582                 | 0,56                              |
| 0,800 % fällig am 28.10.2026                            | 7.000          | 6.715                    | 0,82                              |
| 1,250 % fällig am 15.10.2027                            | 1.442          | 1.401                    | 0,17                              |
| 2,920 % fällig am 25.01.2026                            | 235            | 233                      | 0,03                              |
| 3,000 % fällig am 01.01.2027                            | 16             | 16                       | 0,00                              |
| 4,738 % fällig am 15.02.2037                            | 11             | 11                       | 0,00                              |
| 4,868 % fällig am 15.09.2041                            | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 4,916 % fällig am 25.07.2026                            | 129            | 129                      | 0,02                              |
| 4,926 % fällig am 25.10.2026                            | 13             | 13                       | 0,00                              |
| 5,245 % fällig am 25.11.2054                            | 2.595          | 2.590                    | 0,32                              |
| 5,250 % fällig am 15.12.2050                            | 859            | 859                      | 0,10                              |
| 5,255 % fällig am 25.03.2055                            | 1.164          | 1.155                    | 0,14                              |
| 5,275 % fällig am 25.08.2054                            | 1.463          | 1.466                    | 0,18                              |
| 5,305 % fällig am 25.02.2055                            | 1.870          | 1.874                    | 0,23                              |
| 5,404 % fällig am 25.07.2055                            | 1.600          | 1.601                    | 0,20                              |
| 5,455 % fällig am 25.03.2055                            | 1.111          | 1.111                    | 0,14                              |
| 5,505 % fällig am 25.12.2054                            | 1.847          | 1.848                    | 0,23                              |
| 5,599 % fällig am 25.02.2045                            | 48             | 47                       | 0,01                              |
| 5,705 % fällig am 25.03.2055                            | 1.612          | 1.620                    | 0,20                              |
| 6,500 % fällig am 25.07.2043                            | 61             | 63                       | 0,01                              |
| 6,598 % fällig am 01.12.2034                            | 2              | 3                        | 0,00                              |
| 6,775 % fällig am 01.01.2035                            | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 6,815 % fällig am 01.01.2035                            | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 6,886 % fällig am 01.07.2035                            | 7              | 7                        | 0,00                              |
| 7,355 % fällig am 01.09.2035                            | 23             | 24                       | 0,00                              |
| <b>Ginnie Mae</b>                                       |                |                          |                                   |
| 4,350 % fällig am 20.04.2069                            | 38             | 38                       | 0,00                              |
| 4,893 % fällig am 20.06.2065                            | 228            | 228                      | 0,03                              |
| 5,000 % fällig am 20.06.2027                            | 4              | 4                        | 0,00                              |
| 5,046 % fällig am 20.04.2065                            | 283            | 283                      | 0,03                              |
| 5,052 % fällig am 20.10.2072                            | 827            | 829                      | 0,10                              |
| 5,076 % fällig am 20.03.2065                            | 490            | 490                      | 0,06                              |
| 5,096 % fällig am 20.10.2064                            | 878            | 879                      | 0,11                              |
| 5,102 % fällig am 20.04.2072                            | 1.488          | 1.483                    | 0,18                              |
| 5,146 % fällig am 20.10.2065                            | 2              | 2                        | 0,00                              |
| 5,202 % fällig am 20.01.2073 -<br>20.07.2074            | 2.005          | 2.011                    | 0,25                              |
| 5,246 % fällig am 20.05.2066                            | 538            | 539                      | 0,07                              |
| 5,252 % fällig am 20.09.2073                            | 1.721          | 1.734                    | 0,21                              |
| 5,302 % fällig am 20.05.2073                            | 1.898          | 1.918                    | 0,23                              |
| 5,346 % fällig am 20.04.2066                            | 853            | 856                      | 0,10                              |
| 5,402 % fällig am 20.05.2073                            | 4.204          | 4.269                    | 0,52                              |
| 5,462 % fällig am 20.11.2072                            | 8.195          | 8.331                    | 1,02                              |
| 5,472 % fällig am 20.11.2072                            | 9.400          | 9.575                    | 1,17                              |
| 5,496 % fällig am 20.02.2062                            | 5              | 5                        | 0,00                              |
| 5,696 % fällig am 20.08.2070                            | 2.487          | 2.529                    | 0,31                              |
| 5,802 % fällig am 20.08.2071                            | 985            | 1.006                    | 0,12                              |
| 6,717 % fällig am 20.07.2067                            | 3.259          | 3.308                    | 0,40                              |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                 |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 01.02.2035                            | 1.185          | 1.144                    | 0,14                              |
| 3,000 % fällig am 01.12.2026 -<br>01.04.2052            | 17.980         | 15.856                   | 1,94                              |
| 3,500 % fällig am 01.07.2047 -<br>01.12.2047            | 25.400         | 23.171                   | 2,83                              |
| 4,000 % fällig am 01.10.2047                            | 17             | 16                       | 0,00                              |
| 5,000 % fällig am 01.09.2025 -<br>01.07.2054            | 29.098         | 28.596                   | 3,49                              |
| 6,000 % fällig am 01.04.2035 -<br>01.04.2055            | 4.277          | 4.417                    | 0,54                              |
| 6,500 % fällig am 01.12.2035 -<br>01.01.2036            | 5              | 6                        | 0,00                              |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security TBA</b>             |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055            | 16.000         | 14.878                   | 1,82                              |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055                            | 55.000         | 53.873                   | 6,58                              |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055                            | 4.600          | 4.596                    | 0,56                              |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                            | 86.100         | 87.418                   | 10,67                             |
|                                                         |                | 344.417                  | 42,05                             |
| <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)</b> |                |                          |                                   |
| 0,125 % fällig am 15.10.2025                            | 927            | 924                      | 0,11                              |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025                            | 3.179          | 3.177                    | 0,39                              |
| 0,625 % fällig am 15.07.2032                            | 6.072          | 5.666                    | 0,69                              |
| 1,125 % fällig am 15.01.2033                            | 6.569          | 6.280                    | 0,77                              |
| <b>U.S. Treasury Notes</b>                              |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 15.05.2032                            | 1.800          | 1.680                    | 0,21                              |
| 3,500 % fällig am 30.09.2026                            | 12.600         | 12.537                   | 1,53                              |
| 3,750 % fällig am 31.08.2026                            | 14.400         | 14.368                   | 1,75                              |
| 4,250 % fällig am 30.11.2026                            | 17.200         | 17.292                   | 2,11                              |
| 4,375 % fällig am 15.08.2026                            | 26.200         | 26.318                   | 3,21                              |
| 4,875 % fällig am 31.05.2026                            | 142.600        | 143.632                  | 17,54                             |
|                                                         |                | 231.874                  | 28,31                             |

| BESCHREIBUNG                                                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>Banc of America Mortgage Trust</b>                                                  |                |                          |                                   |
| 5,855 % fällig am 25.07.2034                                                           | \$ 7           | \$ 7                     | 0,00                              |
| 6,538 % fällig am 25.08.2034                                                           | 118            | 119                      | 0,02                              |
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                                     |                |                          |                                   |
| 4,848 % fällig am 25.07.2034                                                           | 92             | 86                       | 0,01                              |
| 5,125 % fällig am 25.01.2035                                                           | 6              | 5                        | 0,00                              |
| 5,939 % fällig am 25.01.2034                                                           | 5              | 5                        | 0,00                              |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                                                        |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.02.2034                                                           | 28             | 26                       | 0,00                              |
| 6,188 % fällig am 25.12.2033                                                           | 18             | 17                       | 0,00                              |
| <b>Benchmark Mortgage Trust</b>                                                        |                |                          |                                   |
| 3,965 % fällig am 10.04.2051                                                           | 544            | 540                      | 0,07                              |
| <b>Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.</b>                              |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 25.12.2018                                                           | 0              | 1                        | 0,00                              |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust Inc.</b>                                              |                |                          |                                   |
| 7,230 % fällig am 25.10.2035                                                           | 10             | 11                       | 0,00                              |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                                              |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.10.2033                                                           | 7              | 7                        | 0,00                              |
| <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>                               |                |                          |                                   |
| 5,138 % fällig am 25.11.2034                                                           | 22             | 21                       | 0,00                              |
| 5,395 % fällig am 20.02.2035                                                           | 4              | 4                        | 0,00                              |
| <b>DBGS Mortgage Trust</b>                                                             |                |                          |                                   |
| 5,204 % fällig am 15.06.2033                                                           | 2.800          | 2.684                    | 0,33                              |
| <b>Eurosail PLC</b>                                                                    |                |                          |                                   |
| 5,308 % fällig am 13.06.2045                                                           | £ 1.824        | 2.497                    | 0,31                              |
| <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                                                         |                |                          |                                   |
| 5,293 % fällig am 25.09.2035                                                           | \$ 56          | 54                       | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 25.03.2032                                                           | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>IndyMac Mortgage Loan Trust</b>                                                     |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.04.2035                                                           | 245            | 202                      | 0,03                              |
| <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                                              |                |                          |                                   |
| 5,697 % fällig am 25.10.2034                                                           | 190            | 184                      | 0,02                              |
| <b>MortgageIT Trust</b>                                                                |                |                          |                                   |
| 5,074 % fällig am 25.02.2035                                                           | 32             | 32                       | 0,00                              |
| <b>Optimum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed<br/>Pass-Through Certificates</b>    |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.12.2035                                                           | 195            | 192                      | 0,02                              |
| <b>Prime Mortgage Trust</b>                                                            |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.02.2034                                                           | 1              | 1                        | 0,00                              |
| <b>Sequoia Mortgage Trust</b>                                                          |                |                          |                                   |
| 4,852 % fällig am 20.06.2036                                                           | 126            | 118                      | 0,01                              |
| 5,232 % fällig am 20.10.2027                                                           | 0              | 1                        | 0,00                              |
| <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>                                  |                |                          |                                   |
| 3,972 % fällig am 25.01.2035                                                           | 52             | 52                       | 0,01                              |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>                                     |                |                          |                                   |
| 4,932 % fällig am 19.07.2035                                                           | 12             | 11                       | 0,00                              |
| <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                                                 |                |                          |                                   |
| 5,074 % fällig am 20.04.2051                                                           | £ 1.675        | 2.296                    | 0,28                              |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>                                   |                |                          |                                   |
| 5,114 % fällig am 25.01.2045                                                           | \$ 330         | 326                      | 0,04                              |
| 5,799 % fällig am 25.06.2042                                                           | 3              | 3                        | 0,00                              |
| <b>Warwick Finance Residential Mortgages PLC</b>                                       |                |                          |                                   |
| 5,189 % fällig am 21.12.2049                                                           | £ 491          | 675                      | 0,08                              |
|                                                                                        |                | 10.177                   | 1,24                              |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                                |                |                          |                                   |
| <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                                                         |                |                          |                                   |
| <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>                                                   |                |                          |                                   |
| 3,086 % fällig am 22.09.2043                                                           | € 947          | 1.119                    | 0,14                              |
| <b>Pulse UK PLC</b>                                                                    |                |                          |                                   |
| 4,884 % fällig am 27.05.2036                                                           | £ 2.000        | 2.744                    | 0,33                              |
|                                                                                        |                | 3.863                    | 0,47                              |
| <b>CMBS SONSTIGE</b>                                                                   |                |                          |                                   |
| <b>Fortress Investment Group LLC</b>                                                   |                |                          |                                   |
| 6,152 % fällig am 23.02.2039                                                           | \$ 80          | 78                       | 0,01                              |
| <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>                                                             |                |                          |                                   |
| <b>Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed<br/>Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am 25.10.2034                                                           | 82             | 82                       | 0,01                              |
| <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>                               |                |                          |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.11.2034                                                           | 16             | 19                       | 0,00                              |

| BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b> |                |                          |                                   |
| 4,562 % fällig am 25.01.2032                                | \$ 5           | \$ 4                     | 0,00                              |
|                                                             |                | 105                      | 0,01                              |
| <b>ABS SONSTIGE</b>                                         |                |                          |                                   |
| <b>AlbaCore Euro CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |
| 3,269 % fällig am 15.07.2035                                | € 1.900        | 2.233                    | 0,27                              |
| <b>Ares European CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |
| 3,086 % fällig am 20.04.2032                                | 2.857          | 3.355                    | 0,41                              |
| 3,266 % fällig am 21.10.2034                                | 364            | 427                      | 0,05                              |
| <b>Avoca CLO DAC</b>                                        |                |                          |                                   |
| 3,099 % fällig am 15.10.2032                                | 2.670          | 3.132                    | 0,38                              |
| <b>Avoca Static CLO DAC</b>                                 |                |                          |                                   |
| 3,249 % fällig am 15.01.2035                                | 925            | 1.086                    | 0,13                              |
| <b>Bain Capital Credit CLO Ltd.</b>                         |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am<br>22.04.2035 (b)                         | \$ 1.800       | 1.800                    | 0,22                              |
| <b>Black Diamond CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |
| 3,123 % fällig am 15.05.2032                                | € 1.508        | 1.770                    | 0,22                              |
| <b>BlueMountain Fuji EUR CLO DAC</b>                        |                |                          |                                   |
| 2,999 % fällig am 15.01.2031                                | 1.188          | 1.396                    | 0,17                              |
| <b>BNPP AM Euro CLO DAC</b>                                 |                |                          |                                   |
| 3,056 % fällig am 22.07.2032                                | 2.996          | 3.507                    | 0,43                              |
| <b>Bridgepoint CLO DAC</b>                                  |                |                          |                                   |
| 3,489 % fällig am 15.01.2034                                | 3.363          | 3.950                    | 0,48                              |
| <b>Carbone CLO Ltd.</b>                                     |                |                          |                                   |
| 5,671 % fällig am 20.01.2031                                | \$ 1.385       | 1.387                    | 0,17                              |
| <b>Carlyle Euro CLO DAC</b>                                 |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am<br>15.08.2038 (b)                         | € 1.500        | 1.761                    | 0,22                              |
| 2,979 % fällig am 15.01.2031                                | 1.258          | 1.477                    | 0,18                              |
| <b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.</b>       |                |                          |                                   |
| 2,893 % fällig am 15.11.2031                                | 1.310          | 1.538                    | 0,19                              |
| <b>Catamaran CLO Ltd.</b>                                   |                |                          |                                   |
| 5,634 % fällig am 22.04.2030                                | \$ 413         | 414                      | 0,05                              |
| <b>CBAM Ltd.</b>                                            |                |                          |                                   |
| 5,561 % fällig am 17.04.2031                                | 160            | 161                      | 0,02                              |
| <b>Goldentree Loan Management US, CLO Ltd.</b>              |                |                          |                                   |
| 5,419 % fällig am 20.10.2034                                | 500            | 500                      | 0,06                              |
| <b>Golub Capital Partners CLO Ltd.</b>                      |                |                          |                                   |
| 5,592 % fällig am 25.10.2034                                | 1.000          | 1.001                    | 0,12                              |
| <b>Griffith Park CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |
| 2,795 % fällig am 21.11.2031                                | € 1.318        | 1.544                    | 0,19                              |
| <b>Hayfin Emerald CLO DAC</b>                               |                |                          |                                   |
| 3,914 % fällig am 22.01.2039                                | 2.000          | 2.350                    | 0,29                              |
| <b>Indigo Credit Management DAC</b>                         |                |                          |                                   |
| 3,479 % fällig am 15.07.2038                                | 2.000          | 2.352                    | 0,29                              |
| <b>Madison Park Euro Funding DAC</b>                        |                |                          |                                   |
| 3,029 % fällig am 15.01.2032                                | 2.673          | 3.129                    | 0,38                              |
| <b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>              |                |                          |                                   |
| 2,999 % fällig am 15.10.2031                                | 886            | 1.038                    | 0,13                              |
| 3,143 % fällig am 15.05.2034                                | 941            | 1.104                    | 0,13                              |
| 3,170 % fällig am 15.10.2034                                | 1.600          | 1.873                    | 0,23                              |
| 3,203 % fällig am 15.02.2035                                | 1.400          | 1.643                    | 0,20                              |
| <b>Regatta Funding Ltd.</b>                                 |                |                          |                                   |
| 5,456 % fällig am 15.01.2033                                | \$ 1.752       | 1.753                    | 0,21                              |
| <b>Saranac CLO Ltd.</b>                                     |                |                          |                                   |
| 6,454 % fällig am 22.06.2030                                | 58             | 58                       | 0,01                              |
| <b>Tikehau CLO DAC</b>                                      |                |                          |                                   |
| 3,456 % fällig am 20.01.2037                                | € 2.100        | 2.465                    | 0,30                              |
| <b>Toro European CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |
| 2,953 % fällig am 15.02.2034                                | 3.156          | 3.693                    | 0,45                              |
| 3,185 % fällig am 12.01.2032                                | 2.379          | 2.791                    | 0,34                              |
| <b>TSTAT Ltd.</b>                                           |                |                          |                                   |
| 5,419 % fällig am 20.07.2037                                | \$ 327         | 328                      | 0,04                              |
|                                                             |                | 57.016                   | 6,96                              |
|                                                             |                | 61.062                   | 7,45                              |

|                                             |       |       |      |
|---------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                     |       |       |      |
| <b>Cassa Depositi e Prestiti SpA</b>        |       |       |      |
| 5,875 % fällig am 30.04.2029                | 2.000 | 2.093 | 0,25 |
| <b>Israel Government International Bond</b> |       |       |      |
| 5,375 % fällig am 19.02.2030                | 900   | 918   | 0,11 |
| <b>Korea Housing Finance Corp.</b>          |       |       |      |
| 4,875 % fällig am 27.08.2027                | 400   | 406   | 0,05 |
| <b>Poland Government International Bond</b> |       |       |      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028 | \$ 2.300        | \$ 2.339                  | 0,29                              | HCA, Inc.<br>4,950 % fällig am 15.08.2025                             | \$ 350          | \$ 348                    | 0,04                              | RTX Corp.<br>4,660 % fällig am 15.07.2025                                          | \$ 3.900        | \$ 3.892                  | 0,48                              |
|                                                                            |                 | 8.194                     | 1,00                              | Holcim Finance U.S. LLC<br>4,670 % fällig am 15.07.2025               | 250             | 250                       | 0,03                              | Summe kurzfristige Instrumente                                                     |                 | 21.675                    | 2,65                              |
|                                                                            |                 |                           |                                   | Holcim Finance U.S. LLC<br>4,670 % fällig am 16.07.2025               | 1.100           | 1.098                     | 0,13                              |                                                                                    |                 |                           |                                   |
| <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                                            |                 |                           |                                   | Jabil, Inc.<br>4,860 % fällig am 02.07.2025                           | 250             | 250                       | 0,03                              | Summe Übertragbare Wertpapiere                                                     | \$ 832.337      | 101,62                    |                                   |
| <b>COMMERCIAL PAPER</b>                                                    |                 |                           |                                   | Jones Lang LaSalle Finance BV<br>4,650 % fällig am 14.07.2025         | 250             | 250                       | 0,03                              | <b>AKTIEN</b>                                                                      |                 |                           |                                   |
| Air Lease Corp.<br>4,840 % fällig am 15.07.2025                            | 250             | 249                       | 0,03                              | 4,720 % fällig am 09.07.2025                                          | 550             | 549                       | 0,07                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                           |                 |                           |                                   |
| Alimentation Couche-Tard, Inc.<br>4,610 % fällig am 10.07.2025             | 250             | 250                       | 0,03                              | 4,760 % fällig am 01.07.2025                                          | 1.600           | 1.600                     | 0,20                              | PIMCO Funds: Global<br>Investors Series plc - US<br>Short-Term Fund (e)            | 2.787.178       | 28.485                    | 3,48                              |
| 4,630 % fällig am 09.07.2025                                               | 400             | 400                       | 0,05                              | Mondelez International, Inc.<br>4,570 % fällig am 11.08.2025          | 300             | 298                       | 0,04                              | PIMCO Select Funds plc -<br>PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating<br>NAV Fund (e) | 1.531.423       | 15.271                    | 1,86                              |
| Canadian Natural Resources Ltd.<br>4,900 % fällig am 06.08.2025 (b)        | 1.650           | 1.642                     | 0,20                              | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>4,600 % fällig am 23.07.2025 | 250             | 249                       | 0,03                              |                                                                                    |                 |                           |                                   |
| CBRE Services, Inc.<br>4,690 % fällig am 10.07.2025                        | 250             | 250                       | 0,03                              | 4,600 % fällig am 28.07.2025                                          | 550             | 548                       | 0,07                              |                                                                                    |                 |                           |                                   |
| Crown Castle, Inc.<br>5,030 % fällig am 22.07.2025                         | 3.900           | 3.888                     | 0,47                              | 4,600 % fällig am 29.07.2025                                          | 350             | 349                       | 0,04                              |                                                                                    |                 | 43.756                    | 5,34                              |
| CVS Corp.<br>4,920 % fällig am 14.07.2025                                  | 1.300           | 1.297                     | 0,16                              | NXP BV<br>4,640 % fällig am 10.09.2025                                | 3.300           | 3.269                     | 0,40                              | <b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>                                                       |                 |                           |                                   |
| 4,920 % fällig am 15.07.2025                                               | 250             | 249                       | 0,03                              | ONEOK, Inc.<br>4,600 % fällig am 14.07.2025                           | 250             | 250                       | 0,03                              | PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>US Dollar Short<br>Maturity UCITS ETF (e)                | 362.860         | 36.326                    | 4,44                              |
| Global Payments, Inc.<br>5,000 % fällig am 01.07.2025                      | 250             | 250                       | 0,03                              |                                                                       |                 |                           |                                   | Summe Investmentfonds                                                              | \$ 80.082       | 9,78                      |                                   |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                     | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsgeschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsgeschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|-------------------------|------------|------------------|------------------|---------------|-----------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------|-----------------------------------|
| DEU                     | 4,420 %    | 30.06.2025       | 01.07.2025       | \$ 100        | U.S. Treasury Bonds 1,750 %<br>fällig am 15.08.2041 | \$ (103)                   | \$ 100                         | \$ 100                                                         | 0,01                              |
| FICC                    | 4,400      | 30.06.2025       | 01.07.2025       | 56.100        | U.S. Treasury Notes 4,000 %<br>fällig am 15.12.2027 | (57.678)                   | 56.100                         | 56.107                                                         | 6,85                              |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |               |                                                     | \$ (57.781)                | \$ 56.200                      | \$ 56.207                                                      | 6,86                              |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHADELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|
| Euro-Bobl September Futures                 | Short | 09.2025     | 27                      | \$ 17                                           | 0,00                    |
| Euro-Bund September Futures                 | Long  | 09.2025     | 2                       | (2)                                             | 0,00                    |
| US Treasury 2-Year Note September Futures   | Long  | 09.2025     | 1.136                   | 857                                             | 0,10                    |
| US Treasury 5-Year Note September Futures   | Long  | 09.2025     | 1.141                   | 1.333                                           | 0,16                    |
| US Treasury 10-Year Note September Futures  | Short | 09.2025     | 546                     | (983)                                           | (0,12)                  |
| US Treasury 10-Year Ultra September Futures | Short | 09.2025     | 625                     | (1.259)                                         | (0,15)                  |
|                                             |       |             |                         | \$ (37)                                         | (0,01)                  |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|---------|-----------|-----------------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 1                       | \$ 0    | \$ 0      | 0,00                              |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500       | 25.07.2025    | 5                       | (2)     | 0         | 0,00                              |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250       | 25.07.2025    | 19                      | (5)     | (2)       | 0,00                              |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000       | 25.07.2025    | 1                       | 0       | (1)       | 0,00                              |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500       | 25.07.2025    | 5                       | (2)     | (3)       | 0,00                              |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750       | 25.07.2025    | 19                      | (6)     | (8)       | 0,00                              |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250     | 25.07.2025    | 2                       | 0       | (1)       | 0,00                              |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500       | 25.07.2025    | 2                       | 0       | 0         | 0,00                              |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | 129,000       | 25.07.2025    | 1                       | 0       | (1)       | 0,00                              |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500       | 25.07.2025    | 1                       | (1)     | 0         | 0,00                              |
|                                                                |               |               |                         | \$ (16) | \$ (16)   | 0,00                              |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                         | \$ (53) |           | (0,01)                            |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Referenzeinheit           | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Barclays Bank PLC         | 1,000 %                     | 20.12.2025       | € 400                     | \$ 0                                     | 0,00                 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000                       | 20.06.2026       | \$ 300                    | 0                                        | 0,00                 |
|                           |                             |                  |                           | \$ 0                                     | 0,00                 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.06.2030       | \$ 200                    | \$ 2                                     | 0,00                 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz              | Variabler Zinssatzindex        | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|------------------|------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 26.300   | \$ 336                                   | 0,04                 |
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,930           | 06.01.2035       | 100        | (1)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000           | 19.03.2027       | \$ 346.600 | 835                                      | 0,10                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,231           | 18.09.2034       | 100        | 5                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,232           | 10.09.2034       | 100        | 5                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,240           | 16.09.2034       | 200        | 9                                        | 0,00                 |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 18.06.2027       | 7.800      | 19                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 18.06.2035       | 7.100      | 115                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,278           | 16.09.2034       | 300        | 13                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,280           | 16.09.2034       | 300        | 13                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,408           | 05.09.2034       | 100        | 3                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,410           | 05.09.2034       | 300        | 10                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500           | 18.12.2025       | 80.900     | 119                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,514           | 04.09.2034       | 300        | 7                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,558           | 21.08.2034       | 100        | 2                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,605           | 28.08.2034       | 100        | 2                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,623           | 31.10.2030       | 1.800      | (6)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,664           | 31.10.2030       | 1.200      | (7)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,677           | 31.10.2030       | 1.000      | (6)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,679           | 13.08.2034       | 100        | 1                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,689           | 31.10.2030       | 2.840      | (20)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,691           | 31.10.2030       | 2.000      | (14)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,722           | 31.10.2030       | 3.900      | (33)                                     | (0,01)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,735           | 31.10.2030       | 2.600      | (25)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,739           | 31.10.2030       | 1.400      | (14)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 18.12.2029       | 8.400      | (107)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,807           | 31.05.2028       | 1.300      | (14)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,842           | 04.03.2030       | 1.100      | (16)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,870           | 05.03.2035       | 100        | (1)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,874           | 05.03.2035       | 600        | (7)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,884           | 25.03.2035       | 400        | (5)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,899           | 11.03.2035       | 400        | (6)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,905           | 12.03.2035       | 400        | (6)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,908           | 04.03.2035       | 600        | (9)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,930           | 24.03.2035       | 600        | (10)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,975           | 21.03.2035       | 600        | (12)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,000           | 26.02.2035       | 250        | (6)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,300           | 25.09.2029       | € 100      | (2)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,350           | 29.04.2030       | 300        | (1)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,390           | 01.10.2034       | 500        | 3                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,400           | 09.04.2030       | 300        | (2)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,400           | 12.02.2035       | 100        | 2                                        | 0,00                 |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,420           | 07.03.2035       | 300        | (4)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,450           | 05.05.2035       | 100        | 2                                        | 0,00                 |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,460           | 13.03.2035       | 100        | (1)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,460           | 01.04.2035       | 200        | (2)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,520           | 27.03.2035       | 100        | 0                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,520           | 09.04.2035       | 200        | 2                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,550           | 16.04.2035       | 100        | 1                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,590           | 19.08.2034       | 100        | (2)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,610           | 24.03.2035       | 200        | 1                                        | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,650           | 14.08.2029       | 100        | (4)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,680           | 07.08.2034       | 210        | (5)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,700           | 13.08.2029       | 400        | (15)                                     | 0,00                 |
|                                                |                                |                 |                  |            | \$ 1.142                                 | 0,14                 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                |                 |                  |            | \$ 1.144                                 | 0,14                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|--------|-----------|----------------------|
| DUB        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,750 %       | 30.10.2025    | 15.800                    | \$ 85  | \$ 55     | 0,01                 |
| FAR        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,750         | 01.08.2025    | 75.900                    | 463    | 66        | 0,01                 |
| MYC        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 5,000         | 08.07.2025    | 90.200                    | 108    | 0         | 0,00                 |
|            |                                      |                         |                                   |               |               |                           | \$ 656 | \$ 121    | 0,02                 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850 %       | 16.07.2025    | 500                       | \$ (1)  | \$ 0      | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 1,000         | 16.07.2025    | 700                       | (1)     | 0         | 0,00                 |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850         | 16.07.2025    | 700                       | (1)     | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900         | 16.07.2025    | 800                       | (1)     | 0         | 0,00                 |
|            |                                  |                     |               |               |                           | \$ (4)  | \$ 0      | 0,00                 |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|---------------------------|----------|-----------|----------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,555 %       | 24.07.2025    | 500                       | \$ (2)   | \$ (2)    | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,637         | 18.07.2025    | 200                       | (1)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,700         | 21.07.2025    | 600                       | (2)      | (5)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,770         | 09.07.2025    | 300                       | (1)      | (3)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,905         | 24.07.2025    | 500                       | (2)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,037         | 18.07.2025    | 200                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,050         | 21.07.2025    | 600                       | (2)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,120         | 09.07.2025    | 300                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,564         | 24.07.2025    | 300                       | (1)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,605         | 23.07.2025    | 400                       | (1)      | (2)       | 0,00                 |
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,914         | 24.07.2025    | 300                       | (1)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,955         | 23.07.2025    | 400                       | (1)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                            | 2,380         | 03.07.2025    | 100                       | 0        | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                            | 2,460         | 16.07.2025    | 200                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                           | 2,640         | 03.07.2025    | 100                       | 0        | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                           | 2,720         | 16.07.2025    | 200                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 2,830         | 30.10.2025    | 15.800                    | (32)     | (9)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,290         | 30.10.2025    | 15.800                    | (53)     | (22)      | (0,01)               |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 2,750         | 01.08.2025    | 75.900                    | (175)    | (1)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,250         | 01.08.2025    | 75.900                    | (288)    | (8)       | 0,00                 |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,750         | 03.07.2025    | 600                       | (2)      | (4)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,790         | 09.07.2025    | 300                       | (1)      | (3)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,100         | 03.07.2025    | 600                       | (2)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,140         | 09.07.2025    | 300                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,583         | 23.07.2025    | 200                       | (1)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,653         | 14.07.2025    | 300                       | (1)      | (1)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,695         | 17.07.2025    | 500                       | (1)      | (4)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,775         | 07.07.2025    | 700                       | (2)      | (6)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 3,933         | 23.07.2025    | 200                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,053         | 14.07.2025    | 300                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,095         | 17.07.2025    | 500                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,125         | 07.07.2025    | 700                       | (2)      | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,772         | 10.07.2025    | 600                       | (2)      | (6)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,122         | 10.07.2025    | 600                       | (2)      | 0         | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,664         | 14.07.2025    | 700                       | (2)      | (3)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,669         | 07.07.2025    | 500                       | (2)      | (2)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,697         | 16.07.2025    | 500                       | (1)      | (4)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,715         | 02.07.2025    | 700                       | (3)      | (3)       | 0,00                 |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                            | 3,725         | 03.07.2025    | 400                       | (1)      | (2)       | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,019         | 07.07.2025    | 500                       | (2)      | 0         | 0,00                 |
| MYC        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,064         | 14.07.2025    | 700                       | (2)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,065         | 02.07.2025    | 700                       | (3)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,075         | 03.07.2025    | 400                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                           | 4,097         | 16.07.2025    | 500                       | (1)      | 0         | 0,00                 |
|            |                                       |                         |                                   |               |               |                           | \$ (604) | \$ (96)   | (0,01)               |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.



CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|------------|--------------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------|
| BOA        | South Africa Government International Bond | 1,000 %                        | 20.12.2026       | \$ 2.000                  | \$ (94)                                      | \$ 102                                          | \$ 8           | 0,00                              |
| CBK        | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026       | 5.600                     | (270)                                        | 292                                             | 22             | 0,00                              |
| GST        | SoftBank Group Corp.                       | 1,000                          | 20.06.2026       | 200                       | (2)                                          | 1                                               | (1)            | 0,00                              |
| MYC        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027       | 1.900                     | (108)                                        | 103                                             | (5)            | 0,00                              |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2027       | 2.300                     | (205)                                        | 187                                             | (18)           | 0,00                              |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026       | 4.200                     | (195)                                        | 211                                             | 16             | 0,00                              |
|            |                                            |                                |                  |                           | \$ (874)                                     | \$ 896                                          | \$ 22          | 0,00                              |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | AUD 921                | \$ 598                   | \$ 0                             | \$ (5)                             | \$ (5)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH 40                 | \$ 6                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 594                 | NZD 987                  | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 4.139              | \$ 579                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | NZD 987                | \$ 594                   | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 599                 | AUD 921                  | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                    |
| BOA        | 07.2025          | € 57.174               | \$ 65.010                | 0                                | (2.105)                            | (2.105)                                              | (0,26)                  |
|            | 07.2025          | IDR 12.048.549         | \$ 739                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 528                 | KRW 720.246              | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 12                     | SGD 16                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 16                 | \$ 12                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 83                 | \$ 3                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 871                 | CNH 6.229                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025          | THB 119                | \$ 4                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 156                 | IDR 2.542.238            | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 150                    | THB 4.963                | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 17                     | TWD 560                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 3.647              | \$ 511                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR 4.543              | \$ 52                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 889                 | CNH 6.341                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 159                    | TWD 5.207                | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025          | ILS 290                | \$ 86                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | KRW 16.465             | 12                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN 83                 | 22                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 9.159               | £ 6.740                  | 78                               | 0                                  | 78                                                   | 0,01                    |
|            | 07.2025          | 173                    | ILS 603                  | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 3                      | ¥ 454                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR 11.567             | \$ 640                   | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | £ 6.097                | 8.297                    | 0                                | (59)                               | (59)                                                 | (0,01)                  |
| CBK        | 07.2025          | KRW 1.278.412          | 930                      | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB 6.215              | 187                      | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD 2.835              | 87                       | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 100                 | IDR 1.628.711            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.012                  | KRW 1.386.314            | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 60                     | THB 2.003                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 2.106                  | TWD 62.645               | 50                               | 0                                  | 50                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CNH 70                 | \$ 10                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR 28.496             | 331                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD 7.641              | 236                      | 0                                | (30)                               | (30)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$ 54                  | INR 4.644                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | 63                     | TWD 2.051                | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025          | 67.760                 | € 58.409                 | 804                              | 0                                  | 804                                                  | 0,10                    |
|            | 07.2025          | 85                     | ILS 293                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 69                     | TWD 2.058                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | € 58.281               | \$ 67.760                | 0                                | (802)                              | (802)                                                | (0,10)                  |
|            | 08.2025          | INR 15.654             | 181                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 09.2025          | MXN 4                  | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025          | BRL 6.729              | 1.177                    | 0                                | (56)                               | (56)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | CHF 236                | 295                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH 20                 | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥ 143.019              | 983                      | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$ 594                 | AUD 921                  | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.221                  | BRL 6.746                | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 287                    | CHF 236                  | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 1.746                  | ¥ 250.430                | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | 10                     | SGD 13                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH 3.849              | \$ 538                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR 7.497              | 87                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD 13                 | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| GLM        | 08.2025          | \$                     | 295 CHF                  | 235                              | \$ 2                               | \$ 2                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 983 ¥                    | 142.493                          | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025          | BRL                    | 6.849 \$                 | 1.221                            | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 09.2025          | \$                     | 173 MXN                  | 3.362                            | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | TWD                    | 116.807 \$               | 3.591                            | 0                                  | (430)                                                | (0,05)                  |
|            | 07.2025          | \$                     | 24 IDR                   | 386.338                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 4 SGD                    | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 08.2025          | SGD                    | 5 \$                     | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 38                       | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | NZD                    | 987                      | 588                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 896                      | 239                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 110                      | 85                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 84 KRW                   | 115.443                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 8 SGD                    | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025          |                        | 280 TWD                  | 8.365                            | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ZAR                    | 3.280 \$                 | 184                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 3.901                    | 546                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 5.067                    | 58                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 10                       | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 8.883                    | 273                              | 0                                  | (35)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025          | \$                     | 886 CNH                  | 6.333                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| MYI        | 08.2025          |                        | 70 TWD                   | 2.278                            | 10                                 | 10                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CAD                    | 2.200 \$                 | 1.602                            | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | CNH                    | 18                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 1.235                    | 1.418                            | 0                                  | (32)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025          | PLN                    | 641                      | 171                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | SGD                    | 264                      | 206                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | THB                    | 3.120                    | 94                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
| RYL        | 07.2025          | \$                     | 1.601 CAD                | 2.201                            | 12                                 | 12                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 20 IDR                   | 324.401                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 76 ¥                     | 10.985                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 212 SGD                  | 274                              | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 90 THB                   | 3.001                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 237 TWD                  | 7.530                            | 22                                 | 22                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CAD                    | 2.198 \$                 | 1.601                            | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                    |
| SCX        | 08.2025          | CNH                    | 1.466                    | 204                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 273                      | 212                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | TWD                    | 6.471                    | 203                              | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 23 TWD                   | 737                              | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | €                      | 72 \$                    | 84                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 48.094                   | 330                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 136 £                    | 99                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025          |                        | 39 ¥                     | 5.657                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 3.923 \$                 | 548                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 330 ¥                    | 47.917                           | 3                                  | 3                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 392 CNH                  | 2.843                            | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 536 \$                   | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 110 IDR                  | 1.796.713                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 1 ILS                    | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025          |                        | 42 SGD                   | 55                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 2.443 TWD                | 72.305                           | 46                                 | 46                                                   | 0,01                    |
|            | 08.2025          | CNH                    | 8.211 \$                 | 1.149                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 5.252                    | 61                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | SGD                    | 54                       | 42                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025          | \$                     | 1.327 CNH                | 9.601                            | 19                                 | 19                                                   | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 4 ¥                      | 534                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 08.2025          |                        | 14 TWD                   | 441                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | ¥                      | 79.378 \$                | 550                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          | INR                    | 30                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 08.2025          | \$                     | 550 ¥                    | 79.087                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | £                      | 6.740 \$                 | 9.127                            | 0                                  | (110)                                                | (0,01)                  |
|            | 07.2025          | THB                    | 502                      | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025          | \$                     | 12 ILS                   | 44                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 26 ¥                     | 3.691                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025          |                        | 321 CNH                  | 2.333                            | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            |                  |                        |                          | \$ 1.203                         | \$ (3.846)                         | \$ (2.643)                                           | (0,32)                  |

### ABGESICHORTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                      | 7.181 \$                 | 8.409                            | \$ 0                               | \$ (21)                                              | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 7.757 €                  | 6.827                            | 257                                | 257                                                  | 0,03                    |
| BOA        | 08.2025          |                        | 8.427                    | 7.181                            | 21                                 | 21                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025          |                        | 8.204                    | 7.215                            | 266                                | 266                                                  | 0,03                    |
| BPS        | 07.2025          | €                      | 21 \$                    | 24                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025          | \$                     | 5 €                      | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| BRC        | 07.2025          | € 55                | \$ 62                 | \$ 0                          | \$ (2)                          | \$ (2)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 8.268            | € 7.281               | 278                           | 0                               | 278                                           | 0,04                 |
| CBK        | 07.2025          | € 22                | \$ 26                 | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 88               | € 75                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | € 7.247             | \$ 8.407              | 0                             | (100)                           | (100)                                         | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$ 8.407            | € 7.231               | 100                           | 0                               | 100                                           | 0,01                 |
| MBC        | 07.2025          | € 54                | \$ 62                 | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 8                | € 7                   | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 922                        | \$ (125)                        | \$ 797                                        | 0,10                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 26.538            | \$ 36.416             | \$ 49                         | \$ 0                            | \$ 49                                         | 0,01                 |
|            | 08.2025          | \$ 36.421           | £ 26.538              | 0                             | (49)                            | (49)                                          | (0,01)               |
| BRC        | 07.2025          | £ 28.344            | \$ 38.559             | 0                             | (282)                           | (282)                                         | (0,03)               |
|            | 07.2025          | \$ 34.728           | £ 25.703              | 498                           | (4)                             | 494                                           | 0,06                 |
|            | 08.2025          | 37.851              | 27.815                | 271                           | 0                               | 271                                           | 0,03                 |
| CBK        | 07.2025          | £ 629               | \$ 849                | 0                             | (13)                            | (13)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 47               | £ 34                  | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| JPM        | 07.2025          | 35.326              | 26.222                | 608                           | 0                               | 608                                           | 0,07                 |
| MBC        | 07.2025          | £ 434               | \$ 592                | 1                             | (4)                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 55               | £ 41                  | 1                             | 0                               | 1                                             | 0,00                 |
| SCX        | 07.2025          | 7.731               | 5.707                 | 90                            | 0                               | 90                                            | 0,01                 |
| SSB        | 07.2025          | £ 27.889            | \$ 38.241             | 24                            | 0                               | 24                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 35.376           | £ 26.126              | 427                           | 0                               | 427                                           | 0,05                 |
|            | 08.2025          | 38.246              | 27.889                | 0                             | (23)                            | (23)                                          | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 1.969                      | \$ (375)                        | \$ 1.594                                      | 0,19                 |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ (205) (0,02)

#### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                         | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|--------------------------------------|-------------|-------------------|-----------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>         |             |                   |                       |
| Uniform Mortgage-Backed Security TBA |             |                   |                       |
| 3,000 % fällig am 01.08.2055         | \$ 23.300   | \$ (20.160)       | (2,46)                |
| 3,500 % fällig am 01.08.2055         | 31.000      | (27.905)          | (3,41)                |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere      |             | \$ (48.065)       | (5,87)                |
| Summe Anlagen                        |             | \$ 921.440        | 112,50                |
| Sonstige Aktiva und Passiva          |             | \$ (102.390)      | (12,50)               |
| Nettovermögen                        |             | \$ 819.050        | 100,00                |

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- (a) Reines Kapitalwertpapier.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Nullkuponwertpapier,
- (d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt,
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 100.844 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 5 USD (31. Dezember 2024: 5 USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 9.049 USD (31. Dezember 2024: 8.669 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 2.090 USD (31. Dezember 2024: 1.030 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

### Bewertung zum Marktwert <sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 828.933                                                      | \$ 3.404                                                     | \$ 832.337        |
| Investmentfonds               | 80.082                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 80.082            |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 56.200                                                          | 0                                                            | 56.200            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 13                                                                          | 873                                                             | 0                                                            | 886               |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (48.065)                                                        | 0                                                            | (48.065)          |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 80.095</b>                                                            | <b>\$ 837.941</b>                                               | <b>\$ 3.404</b>                                              | <b>\$ 921.440</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 841.885                                                      | \$ 0                                                         | \$ 841.885        |
| Investmentfonds               | 31.021                                                                      | 36.337                                                          | 0                                                            | 67.358            |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 5.400                                                           | 0                                                            | 5.400             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 20                                                                          | 1.981                                                           | 0                                                            | 2.001             |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (48.230)                                                        | 0                                                            | (48.230)          |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 31.041</b>                                                            | <b>\$ 837.373</b>                                               | <b>\$ 0</b>                                                  | <b>\$ 868.414</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                        |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                        |                                       |                                 |
|------------|------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarkt-<br>wert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarkt-<br>wert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 257                                   | \$ 0                                  | \$ 257                          | \$ 29                                    | \$ 0                                  | \$ 29                           |
| BOA        | (1.841)                                  | 1.760                                 | (81)                            | 8                                        | 0                                     | 8                               |
| BPS        | 27                                       | 0                                     | 27                              | 384                                      | (260)                                 | 124                             |
| BRC        | 773                                      | (830)                                 | (57)                            | 1                                        | 0                                     | 1                               |
| CBK        | 16                                       | 0                                     | 16                              | 58                                       | 0                                     | 58                              |
| DUB        | 29                                       | 0                                     | 29                              | (179)                                    | 0                                     | (179)                           |
| FAR        | 3                                        | 0                                     | 3                               | 45                                       | (30)                                  | 15                              |
| GLM        | (442)                                    | 330                                   | (112)                           | 1.346                                    | (1.430)                               | (84)                            |
| GST        | (1)                                      | 0                                     | (1)                             | k. A.                                    | k. A.                                 | k. A.                           |
| JPM        | 563                                      | (680)                                 | (117)                           | 34                                       | (40)                                  | (6)                             |
| MBC        | (52)                                     | 0                                     | (52)                            | 798                                      | (570)                                 | 228                             |
| MYC        | (21)                                     | 0                                     | (21)                            | 12                                       | 0                                     | 12                              |
| MYI        | (2)                                      | (10)                                  | (12)                            | (725)                                    | 720                                   | (5)                             |
| RBC        | k. A.                                    | k. A.                                 | k. A.                           | (180)                                    | 0                                     | (180)                           |
| RYL        | 6                                        | 0                                     | 6                               | 3                                        | 0                                     | 3                               |
| SCX        | 155                                      | (200)                                 | (45)                            | (308)                                    | 310                                   | 2                               |
| SSB        | 318                                      | (370)                                 | (52)                            | k. A.                                    | k. A.                                 | k. A.                           |
| UAG        | 7                                        | 0                                     | 7                               | (182)                                    | 0                                     | (182)                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 31,52             | 37,67             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 28,50             | 22,95             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,82              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 5,85              | 4,56              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 4,11              | 5,57              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,16              | 0,11              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,11              | 0,00              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,31              | 0,04              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 28,62             | 29,10             |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>     | <b>100,00</b>     |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 18,92             | 27,48             |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 42,05             | 47,32             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 28,31             | 37,72             |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 1,24              | 2,25              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 7,45              | 8,98              |
| Staatsemissionen                                                                       | 1,00              | 0,71              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 2,65              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                                        | 9,78              | 9,96              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 6,86              | 0,80              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | (0,01)            | 0,16              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,00              | k. A.             |
| Zinsswaps                                                                              | 0,14              | (0,03)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,02              | 0,04              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,03)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,32)            | 0,35              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,29              | (0,19)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (5,87)            | (7,13)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (12,50)           | (28,39)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   | <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   | <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>             |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   | <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>   |                |                          |                                   |
| Republic of Panama                        |                |                          |                                   | Barclays PLC                              |                |                          |                                   | Deutsche Bank AG                            |                |                          |                                   |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027              | € 1.300        | \$ 1.537                 | 0,12                              | 2,885 % fällig am 31.01.2027              | € 300          | \$ 353                   | 0,03                              | 1,375 % fällig am 03.09.2026                | € 300          | \$ 351                   | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,278 % fällig am 13.09.2027              | € 6.500        | 6.596                    | 0,52                              | 7,146 % fällig am 13.07.2027                | € 1.800        | 1.846                    | 0,15                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>   |                |                          |                                   | Bevco Lux SARL                            |                |                          |                                   | Deutsche Börse AG                           |                |                          |                                   |
| <b>BANKEN UND FINANZEN</b>                |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 16.01.2030              | € 600          | 635                      | 0,05                              | 3,875 % fällig am 28.09.2026                | € 1.800        | 2.151                    | 0,17                              |
| AerCap Ireland Capital DAC                |                |                          |                                   | BGC Group, Inc.                           |                |                          |                                   | Deutsche EuroShop AG                        |                |                          |                                   |
| 2,450 % fällig am 29.10.2026              | \$ 3.300       | 3.216                    | 0,26                              | 6,600 % fällig am 10.06.2029              | \$ 2.400       | 2.488                    | 0,20                              | 4,500 % fällig am 15.10.2030                | 1.300          | 1.527                    | 0,12                              |
| 3,000 % fällig am 29.10.2028              | 400            | 381                      | 0,03                              | Blackstone Secured Lending Fund           |                |                          |                                   | Dexus Finance Pty. Ltd.                     |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 06.06.2028              | 1.180          | 1.221                    | 0,10                              | 5,875 % fällig am 15.11.2027              | 900            | 919                      | 0,07                              | 2,500 % fällig am 17.10.2029                | AUD 200        | 120                      | 0,01                              |
| Aircastle Ltd.                            |                |                          |                                   | BMW International Investment BV           |                |                          |                                   | Digital Dutch Finco BV                      |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 11.08.2025              | 1.805          | 1.805                    | 0,14                              | 2,812 % fällig am 09.10.2026              | € 1.200        | 1.412                    | 0,11                              | 1,500 % fällig am 15.03.2030                | € 1.100        | 1.194                    | 0,09                              |
| 6,500 % fällig am 18.07.2028              | 1.000          | 1.044                    | 0,08                              | (f)                                       | 500            | 594                      | 0,05                              | Digital Euro Finco LLC                      |                |                          |                                   |
| Ally Financial, Inc.                      |                |                          |                                   | BNP Paribas S.A.                          |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 09.04.2028                | 600            | 673                      | 0,05                              |
| 6,992 % fällig am 13.06.2029              | 700            | 737                      | 0,06                              | 1,904 % fällig am 30.09.2028              | \$ 778         | 734                      | 0,06                              | 2,500 % fällig am 16.01.2026                | 300            | 352                      | 0,03                              |
| AMCO - Asset Management Co. SpA           |                |                          |                                   | 2,125 % fällig am 23.01.2027              | € 300          | 352                      | 0,03                              | DNB Bank ASA                                |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 06.02.2027              | € 1.400        | 1.703                    | 0,14                              | 2,591 % fällig am 20.01.2028              | € 2.400        | 2.330                    | 0,18                              | 4,625 % fällig am 01.11.2029                | 1.000          | 1.241                    | 0,10                              |
| American Tower Corp.                      |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 25.07.2028              | € 2.300        | 2.710                    | 0,22                              | Edenred SE                                  |                |                          |                                   |
| 1,450 % fällig am 15.09.2026              | \$ 2.800       | 2.706                    | 0,21                              | 2,875 % fällig am 24.02.2029              | £ 900          | 1.160                    | 0,09                              | 3,250 % fällig am 27.08.2030                | 2.900          | 3.411                    | 0,27                              |
| 3,650 % fällig am 15.03.2027              | 900            | 889                      | 0,07                              | 4,400 % fällig am 14.08.2028              | \$ 478         | 477                      | 0,04                              | EPR Properties                              |                |                          |                                   |
| 4,900 % fällig am 15.03.2030              | 600            | 609                      | 0,05                              | BPCE S.A.                                 |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.06.2027                | \$ 1.600       | 1.593                    | 0,13                              |
| 5,000 % fällig am 31.01.2030              | 685            | 699                      | 0,06                              | 1,652 % fällig am 06.10.2026              | 1.200          | 1.190                    | 0,09                              | 4,950 % fällig am 15.04.2028                | 300            | 300                      | 0,02                              |
| Antares Holdings LP                       |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 23.10.2027              | 1.550          | 1.518                    | 0,12                              | Equinix, Inc.                               |                |                          |                                   |
| 6,350 % fällig am 23.10.2029              | 1.500          | 1.516                    | 0,12                              | 3,625 % fällig am 17.04.2026              | € 600          | 712                      | 0,06                              | 0,250 % fällig am 15.03.2027                | € 900          | 1.017                    | 0,08                              |
| 6,500 % fällig am 08.02.2029              | 1.800          | 1.824                    | 0,14                              | 5,203 % fällig am 18.01.2027              | \$ 1.000       | 1.015                    | 0,08                              | Equitable Financial Life Global Funding     |                |                          |                                   |
| Apollo Debt Solutions BDC                 |                |                          |                                   | 5,876 % fällig am 14.01.2031              | 750            | 778                      | 0,06                              | 5,500 % fällig am 02.12.2025                | \$ 3.200       | 3.213                    | 0,26                              |
| 6,900 % fällig am 13.04.2029              | 1.300          | 1.358                    | 0,11                              | 5,975 % fällig am 18.01.2027              | 300            | 302                      | 0,02                              | Extra Space Storage LP                      |                |                          |                                   |
| Ares Capital Corp.                        |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 29.09.2028              | £ 400          | 562                      | 0,04                              | 5,700 % fällig am 01.04.2028                | 400            | 413                      | 0,03                              |
| 7,000 % fällig am 15.01.2027              | 900            | 929                      | 0,07                              | Brookfield Finance, Inc.                  |                |                          |                                   | F&G Global Funding                          |                |                          |                                   |
| Ares Management Corp.                     |                |                          |                                   | 4,350 % fällig am 15.04.2030              | \$ 200         | 197                      | 0,02                              | 5,875 % fällig am 10.06.2027                | 100            | 102                      | 0,01                              |
| 6,375 % fällig am 10.11.2028              | 2.400          | 2.545                    | 0,20                              | Caisse de Refinancement de l'Habitat S.A. |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 16.01.2030                | 1.000          | 1.029                    | 0,08                              |
| Ares Strategic Income Fund                |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 12.01.2029              | € 2.300        | 2.731                    | 0,22                              | Fastighets AB Balder                        |                |                          |                                   |
| 5,600 % fällig am 15.02.2030              | 400            | 399                      | 0,03                              | CaixaBank S.A.                            |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 29.01.2027                | € 1.500        | 1.713                    | 0,14                              |
| Asian Development Bank                    |                |                          |                                   | 5,673 % fällig am 15.03.2030              | \$ 2.000       | 2.069                    | 0,16                              | First Abu Dhabi Bank PJSC                   |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 15.08.2025              | £ 4.000        | 5.492                    | 0,44                              | Canadian Imperial Bank of Commerce        |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 28.02.2029                | \$ 1.500       | 1.526                    | 0,12                              |
| Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.      |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 01.10.2029              | € 3.100        | 3.653                    | 0,29                              | Ford Motor Credit Co. LLC                   |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 15.09.2028              | \$ 500         | 526                      | 0,04                              | Castellum AB                              |                |                          |                                   | 2,700 % fällig am 10.08.2026                | 600            | 584                      | 0,05                              |
| Athene Global Funding                     |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 10.12.2030              | 1.600          | 1.909                    | 0,15                              | 4,125 % fällig am 17.08.2027                | 900            | 880                      | 0,07                              |
| 2,500 % fällig am 24.03.2028              | 2.053          | 1.943                    | 0,15                              | Charles Schwab Corp.                      |                |                          |                                   | 4,271 % fällig am 09.01.2027                | 800            | 789                      | 0,06                              |
| 3,410 % fällig am 25.02.2030              | € 500          | 590                      | 0,05                              | 4,886 % fällig am 13.05.2026              | \$ 200         | 200                      | 0,02                              | 4,950 % fällig am 28.05.2027                | 500            | 497                      | 0,04                              |
| 4,860 % fällig am 27.08.2026              | \$ 1.900       | 1.909                    | 0,15                              | CI Financial Corp.                        |                |                          |                                   | 5,850 % fällig am 17.05.2027                | 1.600          | 1.613                    | 0,13                              |
| 5,516 % fällig am 25.03.2027              | 2.000          | 2.034                    | 0,16                              | 4,750 % fällig am 03.04.2028              | CAD 1.500      | 1.102                    | 0,09                              | 5,918 % fällig am 20.03.2028                | 800            | 808                      | 0,06                              |
| Aviation Capital Group LLC                |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 20.09.2027              | 500            | 377                      | 0,03                              | Freedom Mortgage Corp.                      |                |                          |                                   |
| 1,950 % fällig am 30.01.2026              | 200            | 197                      | 0,02                              | 7,500 % fällig am 30.05.2029              | \$ 1.000       | 1.056                    | 0,08                              | 12,000 % fällig am 01.10.2028               | 300            | 323                      | 0,03                              |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025              | 100            | 100                      | 0,01                              | Citadel LP                                |                |                          |                                   | FS KKR Capital Corp.                        |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 15.07.2029              | 2.400          | 2.445                    | 0,19                              | 6,000 % fällig am 23.01.2030              | 1.200          | 1.241                    | 0,10                              | 2,625 % fällig am 15.01.2027                | 400            | 384                      | 0,03                              |
| 6,250 % fällig am 15.04.2028              | 150            | 156                      | 0,01                              | Citadel Securities Global Holdings LLC    |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 15.01.2030                | 900            | 894                      | 0,07                              |
| Avolon Holdings Funding Ltd.              |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 18.06.2030              | 1.800          | 1.822                    | 0,14                              | 6,875 % fällig am 15.08.2029                | 600            | 616                      | 0,05                              |
| 2,528 % fällig am 18.11.2027              | 3.400          | 3.233                    | 0,26                              | Citigroup, Inc.                           |                |                          |                                   | GA Global Funding Trust                     |                |                          |                                   |
| 5,150 % fällig am 15.01.2030              | 500            | 504                      | 0,04                              | 4,412 % fällig am 31.03.2031              | 4.300          | 4.255                    | 0,34                              | 5,400 % fällig am 13.01.2030                | 3.600          | 3.699                    | 0,29                              |
| 5,500 % fällig am 15.01.2026              | 900            | 901                      | 0,07                              | Clydesdale Bank PLC                       |                |                          |                                   | Gaci First Investment Co.                   |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 15.11.2029              | 400            | 412                      | 0,03                              | 4,839 % fällig am 22.09.2028              | £ 1.100        | 1.512                    | 0,12                              | 4,750 % fällig am 14.02.2030                | 1.200          | 1.206                    | 0,10                              |
| 6,375 % fällig am 04.05.2028              | 500            | 522                      | 0,04                              | CNO Global Funding                        |                |                          |                                   | GAIF Bond Issuer Pty Ltd.                   |                |                          |                                   |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA       |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 04.06.2027              | \$ 500         | 514                      | 0,04                              | 4,742 % fällig am 03.06.2030                | AUD 4.000      | 2.650                    | 0,21                              |
| 1,875 % fällig am 09.01.2026              | € 900          | 1.053                    | 0,08                              | Commerzbank AG                            |                |                          |                                   | General Motors Financial Co., Inc.          |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 27.11.2030              | 1.600          | 1.898                    | 0,15                              | 2,500 % fällig am 25.02.2028              | € 3.000        | 3.547                    | 0,28                              | 5,150 % fällig am 15.08.2026                | £ 1.300        | 1.785                    | 0,14                              |
| Banco BPM SpA                             |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 17.01.2031              | 400            | 496                      | 0,04                              | GLP Capital LP                              |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 18.09.2026              | 2.600          | 3.115                    | 0,25                              | Commonwealth Bank of Australia            |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.01.2030                | \$ 3.100       | 2.981                    | 0,24                              |
| Banco Santander S.A.                      |                |                          |                                   | 3,768 % fällig am 31.08.2027              | 2.000          | 2.424                    | 0,19                              | 5,300 % fällig am 15.01.2029                | 900            | 911                      | 0,07                              |
| 5,538 % fällig am 14.03.2030              | \$ 2.000       | 2.063                    | 0,16                              | Consumers Securitization Funding LLC      |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                   |                |                          |                                   |
| 5,796 % fällig am 23.01.2029              | AUD 1.100      | 749                      | 0,06                              | 5,550 % fällig am 01.03.2028              | \$ 482         | 486                      | 0,04                              | 1,948 % fällig am 21.10.2027                | 2.300          | 2.228                    | 0,18                              |
| Bank Of America Corp.                     |                |                          |                                   | Cooperative Rabobank UA                   |                |                          |                                   | 5,049 % fällig am 23.07.2030                | 1.100          | 1.119                    | 0,09                              |
| 3,648 % fällig am 31.03.2029              | € 2.200        | 2.656                    | 0,21                              | 5,002 % fällig am 28.08.2026              | 5.000          | 5.013                    | 0,40                              | 5,182 % fällig am 09.12.2026                | 8.400          | 8.414                    | 0,67                              |
| 3,824 % fällig am 20.01.2028              | \$ 500         | 496                      | 0,04                              | Corebridge Financial, Inc.                |                |                          |                                   | 6,484 % fällig am 24.10.2029                | 1.900          | 2.016                    | 0,16                              |
| 5,080 % fällig am 20.01.2027              | 1.300          | 1.304                    | 0,10                              | 3,650 % fällig am 05.04.2027              | 1.500          | 1.481                    | 0,12                              | Golub Capital BDC, Inc.                     |                |                          |                                   |
| 5,202 % fällig am 25.04.2029              | 4.700          | 4.804                    | 0,38                              | Credit Agricole SA                        |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 24.08.2026                | 100            | 97                       | 0,01                              |
| 5,365 % fällig am 24.01.2031              | 1.400          | 1.396                    | 0,11                              | 4,631 % fällig am 11.09.2028              | 2.150          | 2.153                    | 0,17                              | Goodman U.S. Finance Three LLC              |                |                          |                                   |
| 6,204 % fällig am 10.11.2028              | 250            | 260                      | 0,02                              | Crown Castle, Inc.                        |                |                          |                                   | 3,700 % fällig am 15.03.2028                | 1.700          | 1.667                    | 0,13                              |
| Bank of Nova Scotia                       |                |                          |                                   | CTP NV                                    |                |                          |                                   | GTA Finance Co. Pty. Ltd.                   |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 17.04.2029              | € 3.000        | 3.594                    | 0,29                              | 0,875 % fällig am 20.01.2026              | € 262          | 305                      | 0,02                              | 2,200 % fällig am 26.08.2027                | AUD 800        | 498                      | 0,04                              |
| Bank of Queensland Ltd.                   |                |                          |                                   | Danske Bank A/S                           |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 04.12.2029                | 1.700          | 1.143                    | 0,09                              |
| 3,300 % fällig am 30.07.2029              | 2.400          | 2.890                    | 0,23                              | 6,259 % fällig am 22.09.2026              | \$ 1.500       | 1.505                    | 0,12                              | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc. |                |                          |                                   |
| Banque Federative du Credit Mutuel S.A.   |                |                          |                                   | DBS Bank Ltd.                             |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 15.01.2031                | \$ 1.800       | 1.823                    | 0,14                              |
| 1,750 % fällig am 15.03.2029              | 1.100          | 1.244                    | 0,10                              | 3,209 % fällig am 19.08.2026              | € 1.500        | 1.784                    | 0,14                              | Highwoods Realty LP                         |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 25.09.2025              | £ 2.000        | 2.742                    | 0,22                              | Dell Bank International DAC               |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.03.2028                | 800            | 784                      | 0,06                              |
| 5,440 % fällig am 16.02.2028              | \$ 2.500       | 2.513                    | 0,20                              | 3,625 % fällig am 24.06.2029              | 500            | 601                      | 0,05                              | HLD EUROPE S.C.A.                           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 02.04.2030                | € 1.000        | 1.200                    | 0,10                              |

| BESCHREIBUNG                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>HSBC Holdings PLC</b>                    |                |                          |                                   | <b>Morgan Stanley Bank N.A.</b>               |                |                          |                                   | <b>Santander UK Group Holdings PLC</b>        |                |                          |                                   |
| 3,019 % fällig am 15.06.2027                | € 700          | \$ 827                   | 0,07                              | 4,754 % fällig am 21.04.2026                  | \$ 2.000       | \$ 2.006                 | 0,16                              | 1,532 % fällig am 21.08.2026                  | \$ 1.200       | \$ 1.194                 | 0,09                              |
| 5,130 % fällig am 03.03.2031                | \$ 1.600       | 1.622                    | 0,13                              | 5,882 % fällig am 30.10.2026                  | 1.500          | 1.532                    | 0,12                              | 4,858 % fällig am 11.09.2030                  | 400            | 400                      | 0,03                              |
| 5,933 % fällig am 13.05.2031                | 1.000          | 1.006                    | 0,08                              | <b>Mutual of Omaha Cos, Global Funding</b>    |                |                          |                                   | 5,694 % fällig am 15.04.2031                  | 1.500          | 1.548                    | 0,12                              |
| <b>IHG Finance LLC</b>                      |                |                          |                                   | 5,350 % fällig am 09.04.2027                  | 1.000          | 1.016                    | 0,08                              | 6,833 % fällig am 21.11.2026                  | 2.400          | 2.420                    | 0,19                              |
| 4,375 % fällig am 28.11.2029                | € 500          | 616                      | 0,05                              | 5,450 % fällig am 12.12.2028                  | 1.000          | 1.029                    | 0,08                              | <b>SBA Tower Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| <b>ING Belgium S.A.</b>                     |                |                          |                                   | <b>Nationale-Nederlanden Bank NV</b>          |                |                          |                                   | 1,631 % fällig am 15.05.2051                  | 1.900          | 1.823                    | 0,14                              |
| 3,375 % fällig am 31.05.2027                | 2.300          | 2.763                    | 0,22                              | 3,625 % fällig am 16.10.2026                  | € 2.000        | 2.392                    | 0,19                              | <b>Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.</b> |                |                          |                                   |
| <b>ING Groep NV</b>                         |                |                          |                                   | <b>Nationwide Building Society</b>            |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 29.10.2022 ^                | 1.400          | 84                       | 0,01                              |
| 3,500 % fällig am 03.09.2030                | 1.100          | 1.314                    | 0,10                              | 6,557 % fällig am 18.10.2027                  | \$ 2.800       | 2.871                    | 0,23                              | 5,250 % fällig am 23.05.2023                  | 500            | 30                       | 0,00                              |
| 4,500 % fällig am 23.05.2029                | 2.200          | 2.707                    | 0,21                              | <b>NatWest Group PLC</b>                      |                |                          |                                   | ^(e)                                          |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 14.11.2027                | 1.000          | 1.212                    | 0,10                              | 2,057 % fällig am 09.11.2028                  | £ 900          | 1.164                    | 0,09                              | <b>Scentre Group Trust</b>                    |                |                          |                                   |
| <b>Intesa Sanpaolo SpA</b>                  |                |                          |                                   | 4,771 % fällig am 16.02.2029                  | € 1.000        | 1.237                    | 0,10                              | 5,200 % fällig am 27.11.2029                  | AUD 1.700      | 1.151                    | 0,09                              |
| 0,625 % fällig am 24.02.2026                | 300            | 349                      | 0,03                              | 5,847 % fällig am 02.03.2027                  | \$ 1.000       | 1.009                    | 0,08                              | <b>SELP Finance SARL</b>                      |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 21.11.2025                | \$ 600         | 605                      | 0,05                              | 7,472 % fällig am 10.11.2026                  | 200            | 202                      | 0,02                              | 0,875 % fällig am 27.05.2029                  | € 600          | 644                      | 0,05                              |
| <b>Itau Unibanco Holding S.A</b>            |                |                          |                                   | <b>NE Property BV</b>                         |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 10.08.2027                  | 200            | 239                      | 0,02                              |
| 6,000 % fällig am 27.02.2030                | 2.200          | 2.258                    | 0,18                              | 1,875 % fällig am 09.10.2026                  | € 1.500        | 1.743                    | 0,14                              | <b>Shinhan Bank Co. Ltd.</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>JAB Holdings BV</b>                      |                |                          |                                   | <b>Newmark Group, Inc.</b>                    |                |                          |                                   | 1,183 % fällig am 29.09.2025                  | AUD 3.600      | 2.342                    | 0,19                              |
| 4,750 % fällig am 29.06.2032                | € 500          | 623                      | 0,05                              | 7,500 % fällig am 12.01.2029                  | \$ 300         | 318                      | 0,03                              | 3,320 % fällig am 29.01.2027                  | € 1.300        | 1.548                    | 0,12                              |
| <b>JPMorgan Chase &amp; Co.</b>             |                |                          |                                   | <b>Nexi SpA</b>                               |                |                          |                                   | <b>Sirius Real Estate Ltd.</b>                |                |                          |                                   |
| 2,739 % fällig am 15.10.2030                | \$ 2.500       | 2.332                    | 0,19                              | 2,125 % fällig am 30.04.2029                  | € 500          | 560                      | 0,04                              | 1,125 % fällig am 22.06.2026                  | 1.200          | 1.383                    | 0,11                              |
| 3,782 % fällig am 01.02.2028                | 1.975          | 1.959                    | 0,16                              | 3,875 % fällig am 21.05.2031                  | 1.100          | 1.303                    | 0,10                              | 1,750 % fällig am 24.11.2028                  | 600            | 668                      | 0,05                              |
| 4,452 % fällig am 05.12.2029                | 1.771          | 1.775                    | 0,14                              | <b>Nissan Motor Acceptance Co. LLC</b>        |                |                          |                                   | <b>Sixth Street Lending Partners</b>          |                |                          |                                   |
| 4,603 % fällig am 22.10.2030                | 900            | 903                      | 0,07                              | 5,300 % fällig am 13.09.2027                  | \$ 1.300       | 1.283                    | 0,10                              | 5,750 % fällig am 15.01.2030                  | \$ 1.000       | 1.003                    | 0,08                              |
| 4,851 % fällig am 25.07.2028                | 2.400          | 2.425                    | 0,19                              | <b>NLG Global Funding</b>                     |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 11.03.2029                  | 300            | 310                      | 0,02                              |
| 4,995 % fällig am 22.07.2030                | 3.000          | 3.055                    | 0,24                              | 5,400 % fällig am 23.01.2030                  | 2.200          | 2.266                    | 0,18                              | <b>Skandinaviska Enskilda Banken AB</b>       |                |                          |                                   |
| 5,299 % fällig am 24.07.2029                | 3.700          | 3.800                    | 0,30                              | <b>NMI Holdings, Inc.</b>                     |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 09.08.2027                  | € 1.100        | 1.247                    | 0,10                              |
| 5,581 % fällig am 22.04.2030                | 1.600          | 1.662                    | 0,13                              | 6,000 % fällig am 15.08.2029                  | 1.090          | 1.120                    | 0,09                              | <b>SLM Corp.</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>JPMorgan Chase Bank N.A.</b>             |                |                          |                                   | <b>Nomura Holdings, Inc.</b>                  |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 02.11.2026                  | \$ 600         | 588                      | 0,05                              |
| 5,110 % fällig am 08.12.2026                | 1.750          | 1.773                    | 0,14                              | 1,653 % fällig am 14.07.2026                  | 200            | 194                      | 0,02                              | <b>Societe Generale S.A.</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>Kodit Global Co. Ltd.</b>                |                |                          |                                   | 5,386 % fällig am 06.07.2027                  | 2.500          | 2.547                    | 0,20                              | 4,250 % fällig am 06.12.2030                  | € 500          | 611                      | 0,05                              |
| 5,357 % fällig am 29.05.2027                | 2.100          | 2.133                    | 0,17                              | 5,591 % fällig am 02.07.2027                  | 400            | 403                      | 0,03                              | 6,447 % fällig am 12.01.2027                  | \$ 600         | 605                      | 0,05                              |
| <b>Kookmin Bank</b>                         |                |                          |                                   | <b>Nordea Bank Abp</b>                        |                |                          |                                   | <b>Standard Chartered Bank Singapore Ltd.</b> |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 21.01.2028                | € 1.000        | 1.182                    | 0,09                              | 1,125 % fällig am 16.02.2027                  | € 800          | 922                      | 0,07                              | 3,324 % fällig am 28.05.2027                  | € 2.300        | 2.755                    | 0,22                              |
| <b>Ladder Capital Finance Holdings LLLP</b> |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 10.09.2029                  | \$ 1.100       | 1.108                    | 0,09                              | <b>Stellantis Finance U.S. Inc.</b>           |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 01.08.2030                | \$ 200         | 201                      | 0,02                              | <b>Norinchukin Bank</b>                       |                |                          |                                   | 5,350 % fällig am 17.03.2028                  | \$ 1.200       | 1.210                    | 0,10                              |
| (a)                                         |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 16.10.2029                  | 700            | 710                      | 0,06                              | <b>Stoneweg Ereit Lux Finco SARL</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Lendlease Finance Ltd.</b>               |                |                          |                                   | <b>Nuveen LLC</b>                             |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 30.01.2031                  | € 1.000        | 1.187                    | 0,09                              |
| 3,400 % fällig am 27.10.2027                | AUD 1.600      | 1.013                    | 0,08                              | 5,550 % fällig am 15.01.2030                  | 1.000          | 1.042                    | 0,08                              | <b>Store Capital LLC</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Lloyds Banking Group PLC</b>             |                |                          |                                   | <b>Nykredit Realkredit A/S</b>                |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 30.04.2030                  | \$ 600         | 608                      | 0,05                              |
| 4,500 % fällig am 11.01.2029                | € 1.300        | 1.597                    | 0,13                              | 1,375 % fällig am 12.07.2027                  | € 2.000        | 2.299                    | 0,18                              | <b>Suci Second Investment Co.</b>             |                |                          |                                   |
| 5,985 % fällig am 07.08.2027                | \$ 595         | 604                      | 0,05                              | 3,375 % fällig am 10.01.2030                  | 1.000          | 1.185                    | 0,09                              | 4,375 % fällig am 10.09.2027                  | 2.000          | 1.989                    | 0,16                              |
| <b>Logicor Financing SARL</b>               |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 09.07.2029                  | 1.000          | 1.212                    | 0,10                              | <b>Sumitomo Mitsui Banking Corp.</b>          |                |                          |                                   |
| 1,625 % fällig am 15.07.2027                | € 800          | 916                      | 0,07                              | <b>Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.</b>     |                |                          |                                   | 0,010 % fällig am 10.09.2025                  | € 4.000        | 4.677                    | 0,37                              |
| 4,250 % fällig am 18.07.2029                | 700            | 847                      | 0,07                              | 3,290 % fällig am 11.06.2027                  | 700            | 839                      | 0,07                              | <b>Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.</b>  |                |                          |                                   |
| <b>Lseg Netherlands BV</b>                  |                |                          |                                   | <b>P3 Group SARL</b>                          |                |                          |                                   | 3,040 % fällig am 16.07.2029                  | \$ 2.000       | 1.896                    | 0,15                              |
| 4,125 % fällig am 29.09.2026                | 2.400          | 2.870                    | 0,23                              | 1,625 % fällig am 26.01.2029                  | 500            | 554                      | 0,04                              | <b>Synchrony Bank</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>LSEGA Financing PLC</b>                  |                |                          |                                   | <b>Pacific Life Global Funding</b>            |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 22.08.2025                  | 1.400          | 1.400                    | 0,11                              |
| 1,375 % fällig am 06.04.2026                | \$ 1.600       | 1.563                    | 0,12                              | 1,375 % fällig am 14.04.2026                  | \$ 1.300       | 1.271                    | 0,10                              | <b>TAG Immobilien AG</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Marsh &amp; McLennan Cos., Inc.</b>      |                |                          |                                   | 4,850 % fällig am 10.02.2030                  | 2.000          | 2.032                    | 0,16                              | 4,250 % fällig am 04.03.2030                  | € 900          | 1.085                    | 0,09                              |
| 4,550 % fällig am 08.11.2027                | 1.700          | 1.713                    | 0,14                              | <b>Piedmont Operating Partnership LP</b>      |                |                          |                                   | <b>Toronto-Dominion Bank</b>                  |                |                          |                                   |
| <b>MassMutual Global Funding</b>            |                |                          |                                   | 3,150 % fällig am 15.08.2030                  | 600            | 539                      | 0,04                              | 2,776 % fällig am 03.09.2027                  | 2.500          | 2.969                    | 0,24                              |
| 4,500 % fällig am 10.04.2026                | 200            | 200                      | 0,02                              | <b>Protective Life Global Funding</b>         |                |                          |                                   | 3,765 % fällig am 08.09.2026                  | 4.000          | 4.787                    | 0,38                              |
| 5,325 % fällig am 10.07.2026                | 6.000          | 6.042                    | 0,48                              | 1,170 % fällig am 15.07.2025                  | 1.000          | 999                      | 0,08                              | <b>TP ICAP Finance PLC</b>                    |                |                          |                                   |
| <b>Maybank Singapore Ltd.</b>               |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 06.07.2027                  | 3.100          | 3.122                    | 0,25                              | 2,625 % fällig am 18.11.2028                  | £ 600          | 758                      | 0,06                              |
| 3,439 % fällig am 07.06.2027                | € 2.000        | 2.405                    | 0,19                              | <b>QNB Finance Ltd.</b>                       |                |                          |                                   | <b>TSB Bank PLC</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Mercury General Corp.</b>                |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 26.01.2026                  | 300            | 294                      | 0,02                              | 3,319 % fällig am 05.03.2029                  | € 600          | 724                      | 0,06                              |
| 4,400 % fällig am 15.03.2027                | \$ 223         | 221                      | 0,02                              | <b>Radian Group, Inc.</b>                     |                |                          |                                   | <b>UBS AG</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>Mitsubishi HC Capital UK PLC</b>         |                |                          |                                   | 6,200 % fällig am 15.05.2029                  | 800            | 832                      | 0,07                              | 0,250 % fällig am 05.01.2026                  | 300            | 349                      | 0,03                              |
| 3,733 % fällig am 02.02.2027                | € 1.800        | 2.153                    | 0,17                              | <b>RGa Global Funding</b>                     |                |                          |                                   | <b>UBS Group AG</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Mitsubishi HC Capital, Inc.</b>          |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 09.01.2030                  | 1.000          | 1.027                    | 0,08                              | 1,494 % fällig am 10.08.2027                  | \$ 1.800       | 1.741                    | 0,14                              |
| 5,080 % fällig am 15.09.2027                | \$ 1.200       | 1.214                    | 0,10                              | 5,500 % fällig am 11.01.2031                  | 1.000          | 1.032                    | 0,08                              | 3,869 % fällig am 12.01.2029                  | 1.750          | 1.723                    | 0,14                              |
| <b>Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.</b> |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 21.11.2028                  | 900            | 945                      | 0,07                              | 6,246 % fällig am 22.09.2029                  | 1.500          | 1.576                    | 0,13                              |
| 3,195 % fällig am 18.07.2029                | 2.000          | 1.909                    | 0,15                              | <b>Royal Bank of Canada</b>                   |                |                          |                                   | 6,373 % fällig am 15.07.2026                  | 3.000          | 3.003                    | 0,24                              |
| <b>Mizuho Financial Group, Inc.</b>         |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 05.07.2028                  | € 2.700        | 3.307                    | 0,26                              | 6,442 % fällig am 11.08.2028                  | 2.235          | 2.323                    | 0,18                              |
| 5,382 % fällig am 10.07.2030                | 1.500          | 1.544                    | 0,12                              | 4,869 % fällig am 18.03.2027                  | £ 2.600        | 3.573                    | 0,28                              | <b>UBS Switzerland AG</b>                     |                |                          |                                   |
| 5,628 % fällig am 13.06.2028                | £ 2.100        | 2.969                    | 0,24                              | <b>Sabra Health Care LP</b>                   |                |                          |                                   | 2,583 % fällig am 23.09.2027                  | € 2.000        | 2.364                    | 0,19                              |
| <b>Moere Boligkreditt A/S</b>               |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 15.08.2026                  | \$ 700         | 701                      | 0,06                              | <b>VICI Properties LP</b>                     |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 25.09.2029                | € 500          | 588                      | 0,05                              | <b>Sagax Euro MTN NL BV</b>                   |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.08.2030                  | \$ 2.100       | 2.016                    | 0,16                              |
| <b>Morgan Stanley</b>                       |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 24.02.2026                  | € 1.500        | 1.749                    | 0,14                              | 4,250 % fällig am 01.12.2026                  | 800            | 795                      | 0,06                              |
| 0,495 % fällig am 26.10.2029                | 100            | 109                      | 0,01                              | <b>Sammons Financial Group Global Funding</b> |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.09.2026                  | 400            | 399                      | 0,03                              |
| 3,772 % fällig am 24.01.2029                | \$ 600         | 592                      | 0,05                              | 5,100 % fällig am 10.12.2029                  | \$ 1.000       | 1.022                    | 0,08                              | 4,750 % fällig am 15.02.2028                  | 300            | 302                      | 0,02                              |
| 3,790 % fällig am 21.03.2030                | € 2.500        | 3.023                    | 0,24                              | <b>Santander Holdings USA, Inc.</b>           |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 01.04.2028                  | 1.600          | 1.613                    | 0,13                              |
| 4,656 % fällig am 02.03.2029                | 2.200          | 2.710                    | 0,22                              | 5,353 % fällig am 06.09.2030                  | 1.300          | 1.324                    | 0,10                              | <b>Virgin Money UK PLC</b>                    |                |                          |                                   |
| 4,813 % fällig am 25.10.2028                | 1.720          | 2.118                    | 0,17                              | 6,499 % fällig am 09.03.2029                  | 4.000          | 4.172                    | 0,33                              | 4,000 % fällig am 03.09.2027                  | £ 900          | 1.224                    | 0,10                              |
| 5,123 % fällig am 01.02.2029                | \$ 1.455       | 1.481                    | 0,12                              |                                               |                |                          |                                   | <b>Volkswagen Financial Services AG</b>       |                |                          |                                   |
|                                             |                |                          |                                   |                                               |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 19.05.2027                  | € 1.000        | 1.187                    | 0,09                              |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                         |    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            |     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                             |    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------|----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|-----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------|----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 3,625 % fällig am 19.05.2029         | €  | 1.400          | 1.666                    | 0,13                              | BHP Billiton Finance Ltd.               |     |                |                          |                                   | 5,900 % fällig am 15.11.2026                             | \$ | 1.300          | 1.323                    | 0,11                              |
| 3,750 % fällig am 10.09.2026         |    | 1.700          | 2.025                    | 0,16                              | 3,250 % fällig am 24.09.2027            | €   | 300            | \$ 358                   | 0,03                              | Energy Transfer LP                                       |    |                |                          |                                   |
| Volkswagen Financial Services NV     |    |                |                          |                                   | BMW U.S. Capital LLC                    |     |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 01.07.2029                             |    | 1.204          | 1.234                    | 0,10                              |
| 5,500 % fällig am 07.12.2026         | £  | 2.000          | 2.768                    | 0,22                              | 4,650 % fällig am 13.08.2029            | \$  | 1.000          | 1.004                    | 0,08                              | 5,500 % fällig am 01.06.2027                             |    | 850            | 866                      | 0,07                              |
| 6,500 % fällig am 18.09.2027         |    | 500            | 708                      | 0,06                              | 4,750 % fällig am 21.03.2028            |     | 2.300          | 2.327                    | 0,19                              | Eni SpA                                                  |    |                |                          |                                   |
| Volkswagen Leasing GmbH              |    |                |                          |                                   | Boeing Co.                              |     |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 23.01.2030                             | €  | 600            | 637                      | 0,05                              |
| 3,875 % fällig am 11.10.2028         | €  | 200            | 241                      | 0,02                              | 2,196 % fällig am 04.02.2026            |     | 1.900          | 1.871                    | 0,15                              | 4,750 % fällig am 12.09.2028                             | \$ | 1.000          | 1.011                    | 0,08                              |
| 4,625 % fällig am 25.03.2029         |    | 500            | 619                      | 0,05                              | 6,259 % fällig am 01.05.2027            |     | 1.500          | 1.544                    | 0,12                              | EQT Corp.                                                |    |                |                          |                                   |
| Wells Fargo & Co.                    |    |                |                          |                                   | 6,298 % fällig am 01.05.2029            |     | 2.900          | 3.067                    | 0,24                              | 6,375 % fällig am 01.04.2029                             |    | 400            | 413                      | 0,03                              |
| 0,625 % fällig am 14.08.2030         |    | 2.156          | 2.245                    | 0,18                              | Booking Holdings, Inc.                  |     |                |                          |                                   | Expand Energy Corp.                                      |    |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 02.02.2027         |    | 400            | 459                      | 0,04                              | 4,000 % fällig am 15.11.2026            | €   | 800            | 959                      | 0,08                              | 6,750 % fällig am 15.04.2029                             |    | 1.000          | 1.013                    | 0,08                              |
| 1,741 % fällig am 04.05.2030         |    | 600            | 675                      | 0,05                              | Booz Allen Hamilton, Inc.               |     |                |                          |                                   | Fresenius Medical Care AG                                |    |                |                          |                                   |
| 2,393 % fällig am 02.06.2028         | \$ | 1.000          | 964                      | 0,08                              | 3,875 % fällig am 01.09.2028            | \$  | 100            | 97                       | 0,01                              | 3,125 % fällig am 08.12.2028                             | €  | 600            | 712                      | 0,06                              |
| 2,879 % fällig am 30.10.2030         |    | 1.000          | 935                      | 0,07                              | Brisbane Airport Corp. Pty. Ltd.        |     |                |                          |                                   | Gatwick Funding Ltd.                                     |    |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 23.10.2026         |    | 1.500          | 1.475                    | 0,12                              | 4,500 % fällig am 30.12.2030            | AUD | 2.600          | 1.680                    | 0,13                              | 6,125 % fällig am 02.03.2028                             | £  | 600            | 831                      | 0,07                              |
| 4,540 % fällig am 15.08.2026         |    | 1.100          | 1.100                    | 0,09                              | Burberry Group PLC                      |     |                |                          |                                   | Glencore Funding LLC                                     |    |                |                          |                                   |
| 5,574 % fällig am 25.07.2029         |    | 8.500          | 8.777                    | 0,70                              | 5,750 % fällig am 20.06.2030            | £   | 400            | 549                      | 0,04                              | 4,000 % fällig am 27.03.2027                             | \$ | 1.500          | 1.488                    | 0,12                              |
| Welltower OP LLC                     |    |                |                          |                                   | Canadian Natural Resources Ltd.         |     |                |                          |                                   | 5,403 % fällig am 04.04.2027                             |    | 2.000          | 2.010                    | 0,16                              |
| 3,100 % fällig am 15.01.2030         |    | 700            | 663                      | 0,05                              | 5,000 % fällig am 15.12.2029            | \$  | 300            | 303                      | 0,02                              | Haleon Netherlands Capital BV                            |    |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 01.07.2030         |    | 1.200          | 1.206                    | 0,10                              | Carlsberg Breweries A/S                 |     |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 29.03.2026                             | €  | 2.400          | 2.796                    | 0,22                              |
| Westpac Banking Corp.                |    |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 28.08.2029            | €   | 500            | 591                      | 0,05                              | Haleon U.S. Capital LLC                                  |    |                |                          |                                   |
| 3,703 % fällig am 16.01.2026         | €  | 300            | 355                      | 0,03                              | Carnival Corp.                          |     |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 24.03.2027                             | \$ | 750            | 739                      | 0,06                              |
| Weyerhaeuser Co.                     |    |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.08.2028            | \$  | 1.400          | 1.371                    | 0,11                              | HCA, Inc.                                                |    |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 15.05.2026         | \$ | 2.500          | 2.505                    | 0,20                              | 5,750 % fällig am 15.03.2030            |     | 800            | 814                      | 0,06                              | 4,125 % fällig am 15.06.2029                             |    | 800            | 786                      | 0,06                              |
| 6,950 % fällig am 01.10.2027         |    | 400            | 421                      | 0,03                              | CDW LLC                                 |     |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 01.06.2028                             |    | 1.100          | 1.124                    | 0,09                              |
| Yorkshire Building Society           |    |                |                          |                                   | 2,670 % fällig am 01.12.2026            |     | 1.800          | 1.756                    | 0,14                              | 5,625 % fällig am 01.09.2028                             |    | 1.000          | 1.030                    | 0,08                              |
| 0,500 % fällig am 01.07.2028         | €  | 400            | 439                      | 0,03                              | Cencora, Inc.                           |     |                |                          |                                   | Heathrow Finance PLC                                     |    |                |                          |                                   |
|                                      |    |                | 453.032                  | 35,98                             | 2,875 % fällig am 22.05.2028            | €   | 1.500          | 1.768                    | 0,14                              | 4,125 % fällig am 01.09.2029                             | £  | 2.000          | 2.527                    | 0,20                              |
| <b>INDUSTRIEWERTE</b>                |    |                |                          |                                   | Centene Corp.                           |     |                |                          |                                   | Heineken NV                                              |    |                |                          |                                   |
| Abertis Infraestructuras S.A.        |    |                |                          |                                   | 2,450 % fällig am 15.07.2028            | \$  | 1.200          | 1.115                    | 0,09                              | 3,625 % fällig am 15.11.2026                             | €  | 1.000          | 1.193                    | 0,09                              |
| 3,375 % fällig am 27.11.2026         | £  | 300            | 403                      | 0,03                              | 3,000 % fällig am 15.10.2030            |     | 1.908          | 1.706                    | 0,14                              | Highland Holdings SARL                                   |    |                |                          |                                   |
| Adnoc Murban Rsc Ltd.                |    |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 15.02.2030            |     | 2.000          | 1.843                    | 0,15                              | 2,875 % fällig am 19.11.2027                             |    | 2.000          | 2.364                    | 0,19                              |
| 5,250 % fällig am 11.09.2029         | \$ | 1.500          | 1.494                    | 0,12                              | CGI, Inc.                               |     |                |                          |                                   | Holding d'Infrastructures de Transport SASU              |    |                |                          |                                   |
| Air Canada Pass-Through Trust        |    |                |                          |                                   | 1,450 % fällig am 14.09.2026            |     | 2.700          | 2.608                    | 0,21                              | 0,625 % fällig am 14.09.2029                             |    | 400            | 438                      | 0,03                              |
| 3,600 % fällig am 15.09.2028         |    | 124            | 121                      | 0,01                              | Chanel Ceres PLC                        |     |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 18.09.2029                             |    | 600            | 665                      | 0,05                              |
| 3,750 % fällig am 15.06.2029         |    | 566            | 551                      | 0,04                              | 0,500 % fällig am 31.07.2026            | €   | 1.700          | 1.956                    | 0,16                              | Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement |    |                |                          |                                   |
| Alaska Airlines Pass-Through Trust   |    |                |                          |                                   | Charter Communications Operating LLC    |     |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 16.09.2028                             |    | 1.500          | 1.612                    | 0,13                              |
| 4,800 % fällig am 15.02.2029         |    | 777            | 778                      | 0,06                              | 6,150 % fällig am 10.11.2026            | \$  | 800            | 816                      | 0,06                              | Hyatt Hotels Corp.                                       |    |                |                          |                                   |
| Alttrad Investment Authority S.A.S.  |    |                |                          |                                   | Cheniere Energy Partners LP             |     |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 30.06.2029                             | \$ | 1.000          | 1.018                    | 0,08                              |
| 3,704 % fällig am 23.06.2029         | €  | 1.200          | 1.411                    | 0,11                              | 4,500 % fällig am 01.10.2029            |     | 1.900          | 1.880                    | 0,15                              | Hyundai Capital America                                  |    |                |                          |                                   |
| Amadeus IT Group S.A.                |    |                |                          |                                   | China Modern Dairy Holdings Ltd.        |     |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 15.06.2026                             |    | 500            | 486                      | 0,04                              |
| 3,375 % fällig am 25.03.2030         |    | 400            | 476                      | 0,04                              | 2,125 % fällig am 14.07.2026            |     | 1.400          | 1.361                    | 0,11                              | 2,750 % fällig am 27.09.2026                             |    | 1.900          | 1.858                    | 0,15                              |
| Ancor Flexibles North America, Inc.  |    |                |                          |                                   | Cie de Saint-Gobain S.A.                |     |                |                          |                                   | 5,509 % fällig am 04.08.2025                             |    | 500            | 500                      | 0,04                              |
| 5,100 % fällig am 17.03.2030         | \$ | 700            | 712                      | 0,06                              | 2,750 % fällig am 04.04.2028            | €   | 2.000          | 2.364                    | 0,19                              | 6,000 % fällig am 11.07.2025                             |    | 1.400          | 1.400                    | 0,11                              |
| American Airlines Pass-Through Trust |    |                |                          |                                   | Coty, Inc.                              |     |                |                          |                                   | Icon Investments Six DAC                                 |    |                |                          |                                   |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029         |    | 417            | 404                      | 0,03                              | 4,500 % fällig am 15.05.2027            |     | 2.300          | 2.747                    | 0,22                              | 5,809 % fällig am 08.05.2027                             |    | 300            | 306                      | 0,02                              |
| 3,600 % fällig am 22.03.2029         |    | 1.448          | 1.411                    | 0,11                              | CPUK Finance Ltd.                       |     |                |                          |                                   | Illumina, Inc.                                           |    |                |                          |                                   |
| Amgen, Inc.                          |    |                |                          |                                   | 5,940 % fällig am 28.02.2047            | £   | 1.325          | 1.873                    | 0,15                              | 5,800 % fällig am 12.12.2025                             |    | 500            | 502                      | 0,04                              |
| 5,150 % fällig am 02.03.2028         |    | 1.943          | 1.986                    | 0,16                              | CRH SMW Finance DAC                     |     |                |                          |                                   | Imperial Brands Finance PLC                              |    |                |                          |                                   |
| Amprion GmbH                         |    |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 09.01.2030            | \$  | 900            | 923                      | 0,07                              | 5,500 % fällig am 28.09.2026                             | £  | 400            | 554                      | 0,04                              |
| 3,000 % fällig am 05.12.2029         | €  | 1.400          | 1.647                    | 0,13                              | CSL Finance PLC                         |     |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 27.07.2027                             | \$ | 995            | 1.027                    | 0,08                              |
| Amize Finance U.S. LLC               |    |                |                          |                                   | 3,850 % fällig am 27.04.2027            |     | 800            | 795                      | 0,06                              | Informa PLC                                              |    |                |                          |                                   |
| 4,950 % fällig am 07.04.2030         | \$ | 1.100          | 1.115                    | 0,09                              | DAA Finance PLC                         |     |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 22.04.2028                             | €  | 500            | 564                      | 0,04                              |
| Anglo American Capital PLC           |    |                |                          |                                   | 1,554 % fällig am 07.06.2028            | €   | 1.100          | 1.256                    | 0,10                              | 3,000 % fällig am 23.10.2027                             |    | 1.900          | 2.250                    | 0,18                              |
| 3,375 % fällig am 11.03.2029         | £  | 500            | 652                      | 0,05                              | Daimler Truck Finance North America LLC |     |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 23.10.2030                             |    | 600            | 703                      | 0,06                              |
| ArcelorMittal S.A.                   |    |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 13.01.2028            | \$  | 800            | 811                      | 0,06                              | InterContinental Hotels Group PLC                        |    |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 13.12.2028         | €  | 1.800          | 2.126                    | 0,17                              | 5,125 % fällig am 19.01.2028            |     | 1.300          | 1.320                    | 0,10                              | 2,125 % fällig am 24.08.2026                             | £  | 500            | 665                      | 0,05                              |
| Ashtead Capital, Inc.                |    |                |                          |                                   | Danfoss Finance BV                      |     |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 08.10.2028                             |    | 800            | 1.051                    | 0,08                              |
| 1,500 % fällig am 12.08.2026         | \$ | 400            | 387                      | 0,03                              | 0,125 % fällig am 28.04.2026            | €   | 1.800          | 2.075                    | 0,17                              | International Distribution Services PLC                  |    |                |                          |                                   |
| Assa Abloy AB                        |    |                |                          |                                   | Dell International LLC                  |     |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 14.09.2030                             |    | 600            | 865                      | 0,07                              |
| 3,750 % fällig am 13.09.2026         | €  | 1.000          | 1.192                    | 0,09                              | 4,900 % fällig am 01.10.2026            | \$  | 400            | 402                      | 0,03                              | JB Hunt Transport Services, Inc.                         |    |                |                          |                                   |
| Astrazeneca Finance LLC              |    |                |                          |                                   | Diamondback Energy, Inc.                |     |                |                          |                                   | 4,900 % fällig am 15.03.2030                             | \$ | 1.300          | 1.320                    | 0,10                              |
| 3,121 % fällig am 05.08.2030         |    | 1.200          | 1.431                    | 0,11                              | 5,200 % fällig am 18.04.2027            |     | 400            | 406                      | 0,03                              | JDE Peet's NV                                            |    |                |                          |                                   |
| Aurizon Network Pty. Ltd.            |    |                |                          |                                   | DS Smith PLC                            |     |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 16.01.2029                             | €  | 1.000          | 1.080                    | 0,09                              |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026         |    | 100            | 118                      | 0,01                              | 2,875 % fällig am 26.07.2029            | £   | 400            | 510                      | 0,04                              | Kering S.A.                                              |    |                |                          |                                   |
| BAE Systems Holdings, Inc.           |    |                |                          |                                   | DSV Finance BV                          |     |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 23.11.2026                             | £  | 900            | 1.239                    | 0,10                              |
| 3,850 % fällig am 15.12.2025         | \$ | 1.100          | 1.096                    | 0,09                              | 1,375 % fällig am 16.03.2030            | €   | 600            | 658                      | 0,05                              | L3Harris Technologies, Inc.                              |    |                |                          |                                   |
| Barry Callebaut Services NV          |    |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 06.11.2026            |     | 2.000          | 2.361                    | 0,19                              | 5,400 % fällig am 15.01.2027                             | \$ | 400            | 407                      | 0,03                              |
| 3,750 % fällig am 19.02.2028         | €  | 400            | 474                      | 0,04                              | DT Midstream, Inc.                      |     |                |                          |                                   | Las Vegas Sands Corp.                                    |    |                |                          |                                   |
| Bayer U.S. Finance LLC               |    |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.06.2029            | \$  | 100            | 97                       | 0,01                              | 3,500 % fällig am 18.08.2026                             |    | 1.700          | 1.678                    | 0,13                              |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028         | \$ | 800            | 793                      | 0,06                              | Dynobel Ltd.                            |     |                |                          |                                   | 3,900 % fällig am 08.08.2029                             |    | 1.800          | 1.715                    | 0,14                              |
| 6,125 % fällig am 21.11.2026         |    | 5.277          | 5.365                    | 0,43                              | 4,300 % fällig am 18.03.2026            | AUD | 800            | 524                      | 0,04                              | 6,000 % fällig am 15.08.2029                             |    | 1.400          | 1.439                    | 0,11                              |
| Becton Dickinson & Co.               |    |                |                          |                                   | ELO SACA                                |     |                |                          |                                   | LG Energy Solution Ltd.                                  |    |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 08.02.2029         |    | 500            | 507                      | 0,04                              | 5,875 % fällig am 17.04.2028            | €   | 2.000          | 2.250                    | 0,18                              | 5,250 % fällig am 02.04.2028                             |    | 2.350          | 2.360                    | 0,19                              |
| 5,081 % fällig am 07.06.2029         |    | 1.000          | 1.022                    | 0,08                              | Enbridge, Inc.                          |     |                |                          |                                   |                                                          |    |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Linde PLC                               |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.04.2028                     | \$ 500         | \$ 507                   | 0,04                              | 4,125 % fällig am 15.08.2030              | £ 400          | \$ 496                   | 0,04                              |
| 2,625 % fällig am 18.02.2029            | € 600          | \$ 707                   | 0,06                              | RTX Corp.                                        |                |                          |                                   | Vmed O2 UK Financing PLC                  |                |                          |                                   |
| Live Nation Entertainment, Inc.         |                |                          |                                   | 2,150 % fällig am 18.05.2030                     | € 2.950        | 3.344                    | 0,27                              | 4,000 % fällig am 31.01.2029              | 500            | 638                      | 0,05                              |
| 3,750 % fällig am 15.01.2028            | \$ 500         | 485                      | 0,04                              | Safran S.A.                                      |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.07.2031              | 1.000          | 1.231                    | 0,10                              |
| Lonza Finance International NV          |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 16.03.2026                     | 300            | 347                      | 0,03                              | 5,625 % fällig am 15.04.2032              | € 2.200        | 2.621                    | 0,21                              |
| 3,250 % fällig am 04.09.2030            | € 1.100        | 1.304                    | 0,10                              | Sage Group PLC                                   |                |                          |                                   | (a)                                       |                |                          |                                   |
| Marriott International, Inc.            |                |                          |                                   | 3,820 % fällig am 15.02.2028                     | 1.000          | 1.208                    | 0,10                              | VMware LLC                                |                |                          |                                   |
| 4,800 % fällig am 15.03.2030            | \$ 1.200       | 1.212                    | 0,10                              | Sandoz Finance BV                                |                |                          |                                   | 1,400 % fällig am 15.08.2026              | \$ 2.600       | 2.515                    | 0,20                              |
| Mars, Inc.                              |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 12.09.2029                     | 1.800          | 2.143                    | 0,17                              | 3,900 % fällig am 21.08.2027              | 1.793          | 1.778                    | 0,14                              |
| 4,450 % fällig am 01.03.2027            | 1.900          | 1.907                    | 0,15                              | 3,970 % fällig am 17.04.2027                     | 800            | 962                      | 0,08                              | Volkswagen Group of America Finance LLC   |                |                          |                                   |
| Marvell Technology, Inc.                |                |                          |                                   | Santos Finance Ltd.                              |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 25.03.2027              | 300            | 301                      | 0,02                              |
| 2,450 % fällig am 15.04.2028            | 1.800          | 1.711                    | 0,14                              | 4,125 % fällig am 14.09.2027                     | \$ 1.700       | 1.676                    | 0,13                              | Warnermedia Holdings, Inc.                |                |                          |                                   |
| Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.      |                |                          |                                   | Sartorius Finance BV                             |                |                          |                                   | 3,755 % fällig am 15.03.2027              | 300            | 292                      | 0,02                              |
| 4,875 % fällig am 25.07.2029            | 1.000          | 1.009                    | 0,08                              | 4,250 % fällig am 14.09.2026                     | € 1.800        | 2.154                    | 0,17                              | Weir Group PLC                            |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 21.05.2030            | 700            | 708                      | 0,06                              | Schaeffler AG                                    |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 14.06.2028              | £ 400          | 575                      | 0,05                              |
| Mattel, Inc.                            |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 01.04.2028                     | 2.600          | 3.077                    | 0,24                              | Werfen S.A.                               |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 01.04.2026            | 800            | 790                      | 0,06                              | Schlumberger Holdings Corp.                      |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 06.06.2028              | € 900          | 1.106                    | 0,09                              |
| McDonald's Corp.                        |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 29.05.2027                     | \$ 900         | 912                      | 0,07                              | Wessex Water Services Finance PLC         |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 28.11.2027            | € 1.000        | 1.207                    | 0,10                              | Sealed Air Corp.                                 |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 17.09.2029              | £ 2.300        | 2.725                    | 0,22                              |
| Mercedes-Benz Finance North America LLC |                |                          |                                   | 1,573 % fällig am 15.10.2026                     | 1.900          | 1.819                    | 0,14                              | WestConnex Finance Co. Pty. Ltd.          |                |                          |                                   |
| 4,900 % fällig am 15.11.2027            | \$ 2.400       | 2.428                    | 0,19                              | SEB S.A.                                         |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 09.10.2030              | AUD 2.280      | 1.573                    | 0,13                              |
| 5,000 % fällig am 01.04.2030            | 1.500          | 1.523                    | 0,12                              | 3,625 % fällig am 24.06.2030                     | € 1.000        | 1.178                    | 0,09                              | Westinghouse Air Brake Technologies Corp. |                |                          |                                   |
| Mercedes-Benz International Finance BV  |                |                          |                                   | Sika Capital BV                                  |                |                          |                                   | 3,450 % fällig am 15.11.2026              | \$ 450         | 444                      | 0,04                              |
| 3,000 % fällig am 10.07.2027            | € 700          | 832                      | 0,07                              | 3,750 % fällig am 03.11.2026                     | 2.300          | 2.747                    | 0,22                              | Whitbread Group PLC                       |                |                          |                                   |
| METRO AG                                |                |                          |                                   | Sky Ltd.                                         |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 31.05.2027              | £ 500          | 653                      | 0,05                              |
| 4,000 % fällig am 05.03.2030            | 1.400          | 1.696                    | 0,13                              | 2,500 % fällig am 15.09.2026                     | 300            | 352                      | 0,03                              | WMG Acquisition Corp.                     |                |                          |                                   |
| Motability Operations Group PLC         |                |                          |                                   | Snam SpA                                         |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 01.12.2029              | \$ 1.130       | 1.060                    | 0,08                              |
| 0,125 % fällig am 20.07.2028            | 1.500          | 1.635                    | 0,13                              | 5,000 % fällig am 28.05.2030                     | \$ 1.400       | 1.412                    | 0,11                              | Woodside Finance Ltd.                     |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 03.07.2029            | £ 500          | 618                      | 0,05                              | Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 19.05.2030              | 4.400          | 4.464                    | 0,35                              |
| 3,625 % fällig am 24.07.2029            | € 1.650        | 1.989                    | 0,16                              | 3,500 % fällig am 09.10.2025                     | € 200          | 235                      | 0,02                              | Worley Financial Services Pty. Ltd.       |                |                          |                                   |
| Netflix, Inc.                           |                |                          |                                   | Southern Co.                                     |                |                          |                                   | 5,950 % fällig am 13.10.2028              | AUD 2.600      | 1.760                    | 0,14                              |
| 3,625 % fällig am 15.05.2027            | 800            | 960                      | 0,08                              | 4,000 % fällig am 15.01.2051                     | \$ 2.500       | 2.490                    | 0,20                              | Worley U.S. Finance Sub Ltd.              |                |                          |                                   |
| News Corp.                              |                |                          |                                   | Stryker Corp.                                    |                |                          |                                   | 0,875 % fällig am 09.06.2026              | € 1.500        | 1.734                    | 0,14                              |
| 3,875 % fällig am 15.05.2029            | \$ 300         | 287                      | 0,02                              | 4,250 % fällig am 11.09.2029                     | 200            | 200                      | 0,02                              | Yorkshire Water Finance PLC               |                |                          |                                   |
| Novo Nordisk Finance Netherlands BV     |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 10.02.2028                     | 1.400          | 1.419                    | 0,11                              | 1,750 % fällig am 26.11.2026              | £ 400          | 523                      | 0,04                              |
| 2,340 % fällig am 27.05.2027            | € 2.000        | 2.350                    | 0,19                              | 4,850 % fällig am 08.12.2028                     | 1.000          | 1.020                    | 0,08                              | 3,625 % fällig am 01.08.2029              | 500            | 652                      | 0,05                              |
| NSW Ports Finance Co. Pty. Ltd.         |                |                          |                                   | Syngenta Finance NV                              |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 28.04.2030              | 1.000          | 1.364                    | 0,11                              |
| 5,042 % fällig am 19.09.2031            | AUD 1.400      | 930                      | 0,07                              | 3,375 % fällig am 16.04.2026                     | € 300          | 354                      | 0,03                              | Zimmer Biomet Holdings, Inc.              |                |                          |                                   |
| Occidental Petroleum Corp.              |                |                          |                                   | T-Mobile USA, Inc.                               |                |                          |                                   | 1,164 % fällig am 15.11.2027              | € 1.000        | 1.136                    | 0,09                              |
| 5,200 % fällig am 01.08.2029            | \$ 200         | 201                      | 0,02                              | 2,250 % fällig am 15.02.2026                     | \$ 1.100       | 1.084                    | 0,09                              |                                           |                | 273.733                  | 21,74                             |
| Open Text Corp.                         |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 15.04.2026                     | 600            | 591                      | 0,05                              | VERSORGUNGSUNTERNEHMEN                    |                |                          |                                   |
| 6,900 % fällig am 01.12.2027            | 2.200          | 2.279                    | 0,18                              | 3,875 % fällig am 15.04.2030                     | 800            | 777                      | 0,06                              | AES Corp.                                 |                |                          |                                   |
| Oracle Corp.                            |                |                          |                                   | 4,200 % fällig am 01.10.2029                     | 4.600          | 4.569                    | 0,36                              | 1,375 % fällig am 15.01.2026              | \$ 1.000       | 981                      | 0,08                              |
| 4,200 % fällig am 27.09.2029            | 1.300          | 1.291                    | 0,10                              | Tapestry, Inc.                                   |                |                          |                                   | 5,450 % fällig am 01.06.2028              | 1.200          | 1.227                    | 0,10                              |
| Origin Energy Finance Ltd.              |                |                          |                                   | 5,100 % fällig am 11.03.2030                     | 2.700          | 2.737                    | 0,22                              | Anglian Water Services Financing PLC      |                |                          |                                   |
| 1,000 % fällig am 17.09.2029            | € 600          | 643                      | 0,05                              | Targa Resources Corp.                            |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 15.01.2029              | £ 900          | 1.286                    | 0,10                              |
| Pandora A/S                             |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 01.07.2027                     | 1.400          | 1.419                    | 0,11                              | Appalachian Power Co.                     |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 31.05.2030            | 1.400          | 1.685                    | 0,13                              | Tennessee Gas Pipeline Co. LLC                   |                |                          |                                   | 3,300 % fällig am 01.06.2027              | \$ 600         | 589                      | 0,05                              |
| Permian Resources Operating LLC         |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 15.10.2028                     | 1.396          | 1.502                    | 0,12                              | AT&T, Inc.                                |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 15.01.2026            | \$ 2.000       | 2.003                    | 0,16                              | TenneT Holding BV                                |                |                          |                                   | 1,650 % fällig am 01.02.2028              | 400            | 375                      | 0,03                              |
| Petroleos Mexicanos                     |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 28.10.2028                     | € 400          | 485                      | 0,04                              | BG Energy Capital PLC                     |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027            | € 500          | 560                      | 0,04                              | Thales S.A.                                      |                |                          |                                   | 2,250 % fällig am 21.11.2029              | € 500          | 573                      | 0,05                              |
| Philip Morris International, Inc.       |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 14.06.2029                     | 2.300          | 2.793                    | 0,22                              | BP Capital Markets PLC                    |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 06.06.2029            | 1.400          | 1.633                    | 0,13                              | 4,125 % fällig am 18.10.2028                     | 1.000          | 1.226                    | 0,10                              | 1,637 % fällig am 26.06.2029              | 500            | 563                      | 0,04                              |
| 2,875 % fällig am 03.03.2026            | 300            | 354                      | 0,03                              | Transurban Finance Co. Pty. Ltd.                 |                |                          |                                   | British Telecommunications PLC            |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 13.02.2029            | \$ 1.800       | 1.832                    | 0,15                              | 4,125 % fällig am 02.02.2026                     | \$ 1.900       | 1.895                    | 0,15                              | 5,125 % fällig am 04.12.2028              | \$ 700         | 716                      | 0,06                              |
| Pioneer Natural Resources Co.           |                |                          |                                   | Uber Technologies, Inc.                          |                |                          |                                   | Brooklyn Union Gas Co.                    |                |                          |                                   |
| 5,100 % fällig am 29.03.2026            | 600            | 603                      | 0,05                              | 6,250 % fällig am 15.01.2028                     | 420            | 422                      | 0,03                              | 3,407 % fällig am 10.03.2026              | 617            | 611                      | 0,05                              |
| PRA Health Sciences, Inc.               |                |                          |                                   | Ubisoft Entertainment S.A.                       |                |                          |                                   | Cadent Finance PLC                        |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 15.07.2026            | 650            | 635                      | 0,05                              | 0,878 % fällig am 24.11.2027                     | € 700          | 742                      | 0,06                              | 0,625 % fällig am 19.03.2030              | € 600          | 631                      | 0,05                              |
| PVH Corp.                               |                |                          |                                   | UCB S.A.                                         |                |                          |                                   | CenterPoint Energy Houston Electric LLC   |                |                          |                                   |
| 4,125 % fällig am 16.07.2029            | € 3.100        | 3.716                    | 0,30                              | 4,250 % fällig am 20.03.2030                     | 1.000          | 1.205                    | 0,10                              | 5,200 % fällig am 01.10.2028              | \$ 900         | 928                      | 0,07                              |
| RELX Capital, Inc.                      |                |                          |                                   | United Airlines Pass-Through Trust               |                |                          |                                   | Centerpoint Energy, Inc.                  |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 18.03.2029            | \$ 400         | 397                      | 0,03                              | 4,300 % fällig am 15.02.2027                     | \$ 431         | 430                      | 0,03                              | 7,000 % fällig am 15.02.2055              | 3.461          | 3.631                    | 0,29                              |
| Republic Services, Inc.                 |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 15.04.2029 (g)                 | 397            | 406                      | 0,03                              | Columbia Pipelines Holding Co. LLC        |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.11.2027            | 300            | 295                      | 0,02                              | United Airlines, Inc.                            |                |                          |                                   | 6,055 % fällig am 15.08.2026              | 800            | 810                      | 0,06                              |
| REWE International Finance BV           |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.04.2026                     | 1.600          | 1.590                    | 0,13                              | Dominion Energy, Inc.                     |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 03.07.2028 (a)        | € 2.600        | 3.056                    | 0,24                              | Var Energi ASA                                   |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.06.2030              | 500            | 510                      | 0,04                              |
| Robert Bosch Finance LLC                |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 04.05.2029                     | € 600          | 756                      | 0,06                              | DTE Energy Co.                            |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 28.05.2028            | 1.600          | 1.886                    | 0,15                              | 7,500 % fällig am 15.01.2028                     | \$ 1.700       | 1.801                    | 0,14                              | 4,950 % fällig am 01.07.2027              | 1.400          | 1.417                    | 0,11                              |
| Robert Bosch GmbH                       |                |                          |                                   | Venture Global Calcasieu Pass LLC                |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 01.04.2030              | 1.100          | 1.126                    | 0,09                              |
| 3,625 % fällig am 02.06.2027            | 400            | 480                      | 0,04                              | 3,875 % fällig am 15.08.2029                     | 500            | 472                      | 0,04                              | Duke Energy Corp.                         |                |                          |                                   |
| Rolls-Royce PLC                         |                |                          |                                   | Venture Global LNG, Inc.                         |                |                          |                                   | 3,100 % fällig am 15.06.2028              | € 800          | 946                      | 0,07                              |
| 1,625 % fällig am 09.05.2028            | 700            | 802                      | 0,06                              | 7,000 % fällig am 15.01.2030                     | 2.775          | 2.808                    | 0,22                              |                                           |                |                          |                                   |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.            |                |                          |                                   | Virgin Media Secured Finance PLC                 |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Edison International<br>4,125 % fällig am 15.03.2028                                      | \$ 1.000       | \$ 966                   | 0,08                              | Systems Energy Resources, Inc.<br>2,140 % fällig am 09.12.2025                     | \$ 1.150       | \$ 1.137                 | 0,09                              | Cassa Depositi e Prestiti SpA<br>5,750 % fällig am 05.05.2026                       | \$ 2.000       | \$ 2.021                 | 0,16                              |
| 5,450 % fällig am 15.06.2029                                                              | 300            | 297                      | 0,02                              | TDC Net A/S<br>5,056 % fällig am 31.05.2028                                        | € 2.000        | 2.450                    | 0,19                              | CDP Financial, Inc.<br>4,250 % fällig am 25.07.2028                                 | 1.100          | 1.112                    | 0,09                              |
| ElectraNet Pty. Ltd.<br>2,474 % fällig am 15.12.2028 AUD                                  | 700            | 431                      | 0,03                              | Teollisuuden Voima Oyj<br>1,125 % fällig am 09.03.2026                             | 300            | 349                      | 0,03                              | CPPIB Capital, Inc.<br>4,250 % fällig am 20.07.2028                                 | 1.050          | 1.063                    | 0,08                              |
| EnBW International Finance BV<br>3,625 % fällig am 22.11.2026                             | € 1.600        | 1.911                    | 0,15                              | Wintershall Dea Finance BV<br>1,332 % fällig am 25.09.2028                         | 500            | 554                      | 0,04                              | Europäische Union<br>2,000 % fällig am 04.10.2027                                   | € 12.200       | 14.312                   | 1,14                              |
| Enel Finance International NV<br>1,625 % fällig am 12.07.2026                             | \$ 1.400       | 1.359                    | 0,11                              | 3,830 % fällig am 03.10.2029                                                       | 1.200          | 1.425                    | 0,11                              | 2,875 % fällig am 05.10.2029                                                        | 7.700          | 9.223                    | 0,73                              |
| 5,125 % fällig am 26.06.2029                                                              | 200            | 204                      | 0,02                              |                                                                                    |                | 84.825                   | 6,73                              | Hungary Government International Bond<br>4,000 % fällig am 25.07.2029               | 1.100          | 1.327                    | 0,11                              |
| EP Infrastructure A/S<br>1,698 % fällig am 30.07.2026                                     | € 1.200        | 1.393                    | 0,11                              | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel                                             |                | 811.590                  | 64,45                             | 4,500 % fällig am 16.06.2034                                                        | 1.200          | 1.422                    | 0,11                              |
| 2,045 % fällig am 09.10.2028                                                              | 600            | 677                      | 0,05                              |                                                                                    |                |                          |                                   | Israel Government International Bond<br>5,000 % fällig am 30.10.2026                | 800            | 966                      | 0,08                              |
| EPH Financing International A/S<br>6,651 % fällig am 13.11.2028                           | 500            | 637                      | 0,05                              | KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL                                                       |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 12.03.2029                                                        | \$ 1.800       | 1.838                    | 0,15                              |
| ETSA Utilities Finance Pty. Ltd.<br>5,108 % fällig am 03.06.2027 AUD                      | 2.600          | 1.739                    | 0,14                              | State Board of Administration Finance Corp., Florida<br>Revenue Notes, Series 2020 |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 19.02.2030                                                        | 1.000          | 1.020                    | 0,08                              |
| Eurogrid GmbH<br>3,075 % fällig am 18.10.2027                                             | € 1.400        | 1.665                    | 0,13                              | 1,258 % fällig am 01.07.2025                                                       | \$ 1.200       | 1.200                    | 0,09                              | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>0,000 % fällig am 01.04.2026 (b)               | € 2.700        | 3.125                    | 0,25                              |
| 3,598 % fällig am 01.02.2029                                                              | 500            | 603                      | 0,05                              | US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                                                              |                |                          |                                   | Korea Development Bank<br>3,000 % fällig am 13.01.2026                              | \$ 4.300       | 4.271                    | 0,34                              |
| Evergy Kansas Central, Inc.<br>4,700 % fällig am 13.03.2028                               | \$ 800         | 809                      | 0,06                              | Ginnie Mae, TBA<br>4,000 % fällig am 01.07.2055                                    | 4.800          | 4.464                    | 0,35                              | Korea Gas Corp.<br>5,000 % fällig am 08.07.2029                                     | 600            | 616                      | 0,05                              |
| Evergy Missouri West, Inc.<br>5,150 % fällig am 15.12.2027                                | 1.600          | 1.629                    | 0,13                              | 4,500 % fällig am 01.07.2055                                                       | 5.000          | 4.787                    | 0,38                              | Korea Housing Finance Corp.<br>2,733 % fällig am 02.07.2028                         | € 1.500        | 1.773                    | 0,14                              |
| Eversource Energy<br>5,450 % fällig am 01.03.2028                                         | 500            | 513                      | 0,04                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055                                                       | 700            | 688                      | 0,06                              | 2,742 % fällig am 05.03.2030                                                        | 1.100          | 1.293                    | 0,10                              |
| Iberdrola Finanzas S.A.<br>5,380 % fällig am 28.11.2030 AUD                               | 1.100          | 744                      | 0,06                              | 6,000 % fällig am 01.07.2055                                                       | 1.900          | 1.928                    | 0,15                              | 3,124 % fällig am 18.03.2029                                                        | 1.300          | 1.556                    | 0,12                              |
| KeySpan Gas East Corp.<br>2,742 % fällig am 15.08.2026                                    | \$ 1.300       | 1.272                    | 0,10                              | Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,000 % fällig am 01.05.2049                   | 9.769          | 9.271                    | 0,74                              | Mexico Government International Bond<br>3,000 % fällig am 03.12.2026 (c)MXN         | 136.014        | 7.051                    | 0,56                              |
| KT Corp.<br>4,375 % fällig am 03.01.2029 (a)                                              | 1.700          | 1.700                    | 0,13                              | 4,500 % fällig am 01.08.2052                                                       | 4.621          | 4.432                    | 0,35                              | Peru Government International Bond<br>6,950 % fällig am 12.08.2031 PEN              | 801            | 245                      | 0,02                              |
| National Grid North America, Inc.<br>3,247 % fällig am 25.11.2029                         | € 2.000        | 2.370                    | 0,19                              | 5,000 % fällig am 01.02.2053                                                       | 3.369          | 3.319                    | 0,26                              | Province of Ontario<br>1,550 % fällig am 01.11.2029 CAD                             | 18.600         | 12.846                   | 1,02                              |
| NBN Co. Ltd.<br>4,125 % fällig am 15.03.2029                                              | 1.000          | 1.228                    | 0,10                              | 5,500 % fällig am 01.03.2054                                                       | 18.625         | 18.644                   | 1,48                              | Romania Government International Bond<br>5,250 % fällig am 10.03.2030               | € 1.450        | 1.740                    | 0,14                              |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>2,200 % fällig am 02.12.2026 AUD                 | 2.500          | 1.599                    | 0,13                              | 6,000 % fällig am 01.01.2053                                                       | 2.184          | 2.227                    | 0,18                              | Saudi Arabia Government International Bond<br>3,625 % fällig am 04.03.2028          | \$ 2.200       | 2.163                    | 0,17                              |
| NiSource, Inc.<br>0,950 % fällig am 15.08.2025                                            | \$ 6.800       | 6.769                    | 0,54                              | Uniform Mortgage-Backed Security TBA<br>3,000 % fällig am 01.07.2055               | 4.000          | 3.462                    | 0,28                              | 5,125 % fällig am 13.01.2028                                                        | 10.600         | 10.779                   | 0,86                              |
| Ohio Edison Co.<br>4,950 % fällig am 15.12.2029                                           | 1.000          | 1.014                    | 0,08                              | 4,000 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055                                          | 32.600         | 30.312                   | 2,41                              | Spain Government International Bond<br>0,000 % fällig am 31.01.2028 (b)             | € 4.100        | 4.565                    | 0,36                              |
| ONEOK, Inc.<br>4,250 % fällig am 24.09.2027                                               | 2.600          | 2.597                    | 0,21                              | 4,500 % fällig am 01.08.2055                                                       | 7.400          | 7.076                    | 0,56                              |                                                                                     |                | 115.947                  | 9,21                              |
| 4,400 % fällig am 15.10.2029                                                              | 2.800          | 2.780                    | 0,22                              |                                                                                    |                | 90.610                   | 7,20                              | KURZFRISTIGE INSTRUMENTE<br>KURZFRISTIGE SCHULDITITEL                               |                |                          |                                   |
| Pacific Gas & Electric Co.<br>3,300 % fällig am 01.12.2027                                | 800            | 774                      | 0,06                              | NON-AGENCY-MBS                                                                     |                |                          |                                   | Pacific Gas & Electric Co.<br>5,339 % fällig am 04.09.2025                          | \$ 3.500       | 3.500                    | 0,28                              |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025                                                              | 100            | 100                      | 0,01                              | Braccan Mortgage Funding PLC<br>5,077 % fällig am 15.02.2067                       | £ 4.940        | 6.788                    | 0,54                              | Yango Justice International Ltd.<br>5,300 % fällig am 11.01.2022 ^                  | 200            | 1                        | 0,00                              |
| 5,000 % fällig am 04.06.2028                                                              | 3.700          | 3.712                    | 0,29                              | GSR Mortgage Loan Trust<br>5,293 % fällig am 25.09.2035                            | \$ 1           | 1                        | 0,00                              | Summe kurzfristige Instrumente                                                      |                | 3.501                    | 0,28                              |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara<br>4,125 % fällig am 15.05.2027 | 1.200          | 1.189                    | 0,09                              | Jubilee Place BV<br>2,804 % fällig am 17.09.2060                                   | € 3.427        | 4.035                    | 0,32                              | Summe Übertragbare Wertpapiere                                                      | \$ 1.044.710   | 82,96                    |                                   |
| Pinnacle West Capital Corp.<br>5,214 % fällig am 10.06.2026                               | 1.500          | 1.503                    | 0,12                              | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust<br>5,600 % fällig am 25.11.2034                 | \$ 1           | 2                        | 0,00                              | AKTIEN                                                                              |                |                          |                                   |
| Public Service Enterprise Group, Inc.<br>4,900 % fällig am 15.03.2030                     | 1.400          | 1.425                    | 0,11                              | 6,209 % fällig am 25.09.2034                                                       | 188            | 184                      | 0,01                              | INVESTMENTFONDS                                                                     |                |                          |                                   |
| RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR<br>2,750 % fällig am 20.06.2029               | € 500          | 586                      | 0,05                              | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust<br>5,649 % fällig am 25.01.2047      | 143            | 132                      | 0,01                              | ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN                                                   |                |                          |                                   |
| Southern California Edison Co.<br>4,700 % fällig am 01.06.2027                            | \$ 400         | 402                      | 0,03                              | 6,267 % fällig am 25.01.2033                                                       | 3              | 3                        | 0,00                              | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (d) | 2.083.333      | 21.751                   | 1,72                              |
| 5,250 % fällig am 15.03.2030                                                              | 1.000          | 1.011                    | 0,08                              |                                                                                    |                | 11.145                   | 0,88                              | PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)                    | 5.163          | 75                       | 0,01                              |
| 5,300 % fällig am 01.03.2028                                                              | 1.500          | 1.520                    | 0,12                              | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE<br>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE                        |                |                          |                                   |                                                                                     | 21.826         | 1,73                     |                                   |
| 5,350 % fällig am 01.03.2026                                                              | 3.100          | 3.116                    | 0,25                              | Bumper NL BV<br>2,569 % fällig am 22.03.2035                                       | € 2.906        | 3.415                    | 0,27                              | Summe Investmentfonds                                                               | \$ 21.826      | 1,73                     |                                   |
| 5,850 % fällig am 01.11.2027                                                              | 100            | 102                      | 0,01                              | HYPOTHEKEN SONSTIGE                                                                |                |                          |                                   |                                                                                     |                |                          |                                   |
| Southern California Gas Co.<br>2,950 % fällig am 15.04.2027                               | 1.226          | 1.202                    | 0,10                              | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust<br>5,054 % fällig am 25.12.2035             | \$ 159         | 157                      | 0,01                              |                                                                                     |                |                          |                                   |
| Southern Gas Corridor CJSC<br>6,875 % fällig am 24.03.2026                                | 800            | 811                      | 0,06                              | ABS SONSTIGE                                                                       |                |                          |                                   |                                                                                     |                |                          |                                   |
| Southern Power Co.<br>0,900 % fällig am 15.01.2026                                        | 2.000          | 1.958                    | 0,16                              | Atlantic Avenue Ltd.<br>5,529 % fällig am 20.01.2035                               | 1.000          | 1.000                    | 0,08                              |                                                                                     |                |                          |                                   |
| Spire, Inc.<br>5,300 % fällig am 01.03.2026                                               | 2.000          | 2.007                    | 0,16                              | Avoca Static CLO DAC<br>3,249 % fällig am 15.01.2035                               | € 925          | 1.086                    | 0,09                              |                                                                                     |                |                          |                                   |
| Statkraft A/S<br>2,875 % fällig am 13.09.2029                                             | € 500          | 592                      | 0,05                              | Tikehau CLO DAC<br>3,456 % fällig am 20.01.2037                                    | 3.000          | 3.522                    | 0,28                              |                                                                                     |                |                          |                                   |
| Stedin Holding NV<br>1,375 % fällig am 19.09.2028                                         | 1.100          | 1.241                    | 0,10                              |                                                                                    |                | 5.608                    | 0,45                              |                                                                                     |                |                          |                                   |
| SW Finance PLC<br>1,625 % fällig am 30.03.2027                                            | £ 1.500        | 1.833                    | 0,15                              | STAATSEMISSIONEN                                                                   |                |                          |                                   |                                                                                     |                |                          |                                   |
|                                                                                           |                |                          |                                   | Australia Government International Bond<br>2,750 % fällig am 21.11.2028 AUD        | 41.600         | 26.796                   | 2,13                              |                                                                                     |                |                          |                                   |
|                                                                                           |                |                          |                                   | Belgium Government International Bond<br>0,800 % fällig am 22.06.2028              | € 2.500        | 2.824                    | 0,22                              |                                                                                     |                |                          |                                   |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                                              | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsge-<br>schäfte, zum<br>Wert | Zu<br>erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensionsge-<br>schäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|
| BRC                     | 4,480 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 57.300     | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2027 | \$ (58.506)                | \$ 57.300                           | \$ 57.307                                                              | 4,55                              |
| DEU                     | 4,420      | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 57.300        | U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig<br>am 15.08.2041                          | (59.020)                   | 57.300                              | 57.307                                                                 | 4,55                              |
|                         | 4,470      | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 9.900         | U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig<br>am 15.05.2040                          | (10.202)                   | 9.900                               | 9.901                                                                  | 0,79                              |
| FICC                    | 4,400      | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 89.000        | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig<br>am 15.12.2027                          | (91.504)                   | 89.000                              | 89.011                                                                 | 7,06                              |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                                              | \$ (219.232)               | \$ 213.500                          | \$ 213.526                                                             | 16,95                             |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## FUTURES

| Beschreibung                              | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures             | Long  | 03.2027     | 733                     | \$ 547                                          | 0,04                         |
| 3-Month SOFR December Futures             | Long  | 03.2028     | 245                     | 537                                             | 0,04                         |
| 3-Month SOFR June Futures                 | Long  | 09.2027     | 731                     | 1.093                                           | 0,09                         |
| 3-Month SOFR March Futures                | Long  | 06.2027     | 600                     | 754                                             | 0,06                         |
| 3-Month SOFR September Futures            | Long  | 12.2026     | 744                     | 518                                             | 0,04                         |
| 3-Month SOFR September Futures            | Long  | 12.2027     | 338                     | 696                                             | 0,06                         |
| Euro-Bobl September Futures               | Long  | 09.2025     | 244                     | (153)                                           | (0,01)                       |
| Euro-Schatz September Futures             | Short | 09.2025     | 128                     | 25                                              | 0,00                         |
| US Treasury 2-Year Note September Futures | Long  | 09.2025     | 1.614                   | 1.259                                           | 0,10                         |
| US Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09.2025     | 125                     | (126)                                           | (0,01)                       |
|                                           |       |             |                         | \$ 5.150                                        | 0,41                         |

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld  | Marktwert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|-------------------------|----------|-----------|------------------------------|
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250     | 25.07.2025    | 6                       | \$ (2)   | \$ (1)    | 0,00                         |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500       | 25.07.2025    | 6                       | (1)      | (1)       | 0,00                         |
|                                                                |               |               |                         | \$ (3)   | \$ (2)    | 0,00                         |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                         | \$ 5.148 |           | 0,41                         |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit                       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Airbus Group Finance BV               | 1,000 %                        | 20.06.2029       | € 1.500                   | \$ 17                                           | 0,00                         |
| AT&T, Inc.                            | 1,000                          | 20.12.2025       | \$ 4.200                  | (15)                                            | 0,00                         |
| AT&T, Inc.                            | 1,000                          | 20.06.2028       | 1.200                     | 32                                              | 0,00                         |
| Bank Of America Corp.                 | 1,000                          | 20.12.2025       | 3.900                     | (14)                                            | 0,00                         |
| Bank Of America Corp.                 | 1,000                          | 20.12.2026       | 2.100                     | (7)                                             | 0,00                         |
| Barclays Bank PLC                     | 1,000                          | 20.12.2025       | € 500                     | (1)                                             | 0,00                         |
| Boeing Co.                            | 1,000                          | 20.12.2026       | \$ 200                    | 2                                               | 0,00                         |
| Elis S.A.                             | 5,000                          | 20.12.2029       | € 600                     | 7                                               | 0,00                         |
| General Electric Co.                  | 1,000                          | 20.06.2026       | \$ 3.700                  | (19)                                            | 0,00                         |
| General Electric Co.                  | 1,000                          | 20.12.2026       | 400                       | 0                                               | 0,00                         |
| General Motors Co.                    | 5,000                          | 20.12.2026       | 80                        | (9)                                             | 0,00                         |
| Glencore Finance Europe Ltd.          | 5,000                          | 20.06.2028       | € 500                     | (3)                                             | 0,00                         |
| Glencore Finance Europe Ltd.          | 5,000                          | 20.12.2028       | 400                       | 9                                               | 0,00                         |
| Goldman Sachs Group, Inc.             | 1,000                          | 20.06.2026       | \$ 500                    | 0                                               | 0,00                         |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000                          | 20.06.2026       | 300                       | (6)                                             | 0,00                         |
| Rolls-Royce PLC                       | 1,000                          | 20.12.2025       | € 500                     | 0                                               | 0,00                         |
| Verizon Communications, Inc.          | 1,000                          | 20.12.2027       | \$ 200                    | 5                                               | 0,00                         |
| Verizon Communications, Inc.          | 1,000                          | 20.06.2028       | 1.800                     | 33                                              | 0,00                         |
|                                       |                                |                  |                           | \$ 31                                           | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-43 5-Year Index             | 1,000 %                     | 20.12.2029       | \$ 11.100                 | \$ 7                                     | 0,00                 |
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000                       | 20.06.2030       | 112.600                   | 482                                      | 0,04                 |
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index   | 5,000                       | 20.06.2030       | € 450                     | 9                                        | 0,00                 |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2030       | 6.300                     | 23                                       | 0,00                 |
|                                    |                             |                  |                           | \$ 521                                   | 0,04                 |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex             | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                                  | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 31.800    | \$ 483                                   | 0,04                 |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                   | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 4,000           | 17.09.2030       | 9.000       | 87                                       | 0,01                 |
| Zahlung                                  | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 0,750           | 19.03.2030       | ¥ 1.690.000 | 88                                       | 0,01                 |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,281           | 15.02.2040       | \$ 11.400   | 744                                      | 0,06                 |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                    | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,620           | 30.11.2029       | 49.520      | (583)                                    | (0,05)               |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2029       | 51.600      | 530                                      | 0,04                 |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2034       | 34.700      | 632                                      | 0,05                 |
| Erhalt                                   | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,842           | 04.03.2030       | 20.800      | (92)                                     | (0,01)               |
| Zahlung                                  | 1-Year BRL-CDI                      | 12,030          | 04.01.2027       | BRL 61.900  | (272)                                    | (0,02)               |
| Zahlung                                  | 1-Year BRL-CDI                      | 13,402          | 02.01.2029       | 65.400      | 100                                      | 0,01                 |
| Zahlung                                  | 1-Year BRL-CDI                      | 13,926          | 04.01.2027       | 101.800     | (53)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 18.12.2025       | CAD 23.100  | 138                                      | 0,01                 |
| Zahlung                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.09.2025       | 34.300      | 748                                      | 0,06                 |
| Zahlung                                  | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2025       | 13.500      | 256                                      | 0,02                 |
| Zahlung                                  | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,250           | 19.03.2030       | AUD 9.800   | 125                                      | 0,01                 |
| Zahlung                                  | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,650           | 11.05.2027       | € 3.800     | (90)                                     | (0,01)               |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                   | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250           | 17.09.2030       | 3.300       | 19                                       | 0,00                 |
| Zahlung                                  | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520           | 27.03.2035       | 500         | (2)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                  | 28-Day MXN-TIIE                     | 7,582           | 02.04.2030       | MXN 23.100  | (5)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                   | 28-Day MXN-TIIE                     | 7,768           | 12.06.2030       | 18.600      | (3)                                      | 0,00                 |
|                                          |                                     |                 |                  |             | \$ 2.850                                 | 0,23                 |
|                                          |                                     |                 |                  |             | \$ 3.402                                 | 0,27                 |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|---------------|---------------|---------------------------|---------|-----------|----------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850 %       | 16.07.2025    | 1.800                     | \$ (3)  | \$ 0      | 0,00                 |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900         | 16.07.2025    | 3.600                     | (4)     | (1)       | 0,00                 |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 1,000         | 16.07.2025    | 1.700                     | (2)     | 0         | 0,00                 |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850         | 16.07.2025    | 1.900                     | (2)     | 0         | 0,00                 |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900         | 16.07.2025    | 1.700                     | (2)     | 0         | 0,00                 |
|            |                                  |                     |               |               |                           | \$ (13) | \$ (1)    | 0,00                 |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                      | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|--------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond | 1,000 %                     | 20.06.2026       | \$ 100                    | \$ (3)                                | \$ 4                                     | \$ 1      | 0,00                 |
| GST        | AT&T, Inc.                           | 1,000                       | 20.06.2028       | 800                       | (9)                                   | 22                                       | 13        | 0,00                 |
|            | Petroleos Mexicanos                  | 4,850                       | 07.05.2026       | 1.536                     | 0                                     | 19                                       | 19        | 0,00                 |
|            | SoftBank Group Corp.                 | 1,000                       | 20.06.2026       | 600                       | (5)                                   | 2                                        | (3)       | 0,00                 |
|            |                                      |                             |                  |                           | \$ (17)                               | \$ 47                                    | \$ 30     | 0,00                 |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.



(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

# DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                    | \$                       | 536                              | \$ 0                               | \$ (4)                                               | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      |                          | 461                              | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | AUD                      | 72.135                           | 416                                | 0                                                    | 0,03                         |
|            | 07.2025          |                        | £                        | 664                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | AUD                    | \$                       | 46.887                           | 0                                  | (417)                                                | (0,03)                       |
|            | 08.2025          | CNH                    |                          | 536                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | £                      |                          | 911                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 2.329                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | AUD                    | \$                       | 2.485                            | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      |                          | 302.612                          | 0                                  | (9.795)                                              | (0,78)                       |
| BOA        | 07.2025          | \$                     | ILS                      | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | KRW                      | 553.284                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH                    | \$                       | 203                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 4.771                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | TWD                      | 978                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      | \$                       | 237                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | THB                    |                          | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | TRY                    |                          | 69                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | TWD                    |                          | 252                              | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025          | \$                     | THB                      | 3.640                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH                    | \$                       | 5.080                            | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 437                              | 0                                  | (59)                                                 | (0,01)                       |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 6.819                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | TWD                      | 4.063                            | 17                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      | \$                       | 2.737                            | 0                                  | (76)                                                 | (0,01)                       |
|            | 07.2025          | KRW                    |                          | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | PLN                    |                          | 69                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | TRY                    |                          | 201                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | £                        | 40.008                           | 390                                | 0                                                    | 0,03                         |
| BRC        | 07.2025          |                        | ¥                        | 6.804                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | TRY                      | 12.174                           | 6                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | £                      | \$                       | 54.442                           | 0                                  | (390)                                                | (0,03)                       |
|            | 09.2025          | \$                     | PEN                      | 51                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025          | PEN                    | \$                       | 306                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025          | \$                     | PEN                      | 32                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CNY                    | \$                       | 771                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | €                      |                          | 1.199                            | 0                                  | (32)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | £                      |                          | 400                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | KRW                    |                          | 359                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
| BSH        | 07.2025          | SGD                    |                          | 195                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | THB                    |                          | 212                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | TWD                    |                          | 490                              | 0                                  | (59)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | PEN                      | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | THB                      | 1.469                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | TWD                      | 45.783                           | 35                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CNH                    | \$                       | 171                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025          | INR                    |                          | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | TWD                    |                          | 864                              | 0                                  | (115)                                                | (0,01)                       |
|            | 08.2025          | \$                     | INR                      | 6.973                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 08.2025          |                        | PEN                      | 67                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | €                        | 272.430                          | 3.747                              | 0                                                    | 0,30                         |
|            | 07.2025          |                        | TWD                      | 1.029                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | €                      | \$                       | 316.046                          | 0                                  | (3.742)                                              | (0,30)                       |
|            | 08.2025          | INR                    |                          | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025          | MXN                    |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | AUD                    |                          | 44.068                           | 0                                  | (694)                                                | (0,06)                       |
|            | 07.2025          | BRL                    |                          | 228                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CHF                    |                          | 61                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CNH                    |                          | 274                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
| FAR        | 07.2025          | ¥                      |                          | 9.176                            | 0                                  | (71)                                                 | (0,01)                       |
|            | 07.2025          | \$                     |                          | 220                              | 10                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | BRL                      | 1.255                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | CHF                      | 50                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | ¥                        | 3.753.918                        | 0                                  | (179)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025          |                        | PLN                      | 1.772                            | 10                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | CHF                    | \$                       | 62                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | INR                    |                          | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          | \$                     | CNH                      | 2.177                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025          |                        | ¥                        | 1.330.694                        | 71                                 | 0                                                    | 0,01                         |
| GLM        | 09.2025          | MXN                    | \$                       | 7.222                            | 0                                  | (162)                                                | (0,01)                       |
|            | 09.2025          | \$                     | BRL                      | 1.278                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025          |                        | PEN                      | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | TWD                    | \$                       | 87                               | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | CNH                    |                          | 516                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025          | KRW                    |                          | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          | PLN                    |                          | 742                              | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | TWD                    |                          | 255                              | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025          | \$                     | PLN                      | 3.195                            | 19                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025          |                        | SGD                      | 67                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        |                  |                        |                          |                                  |                                    |                                                      |                              |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |        |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|--------|
| MBC        | 07.2025          | \$                  | 192 TWD               | 5.698                         | \$ 4                            | \$ 0                                          | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          |                     | 3 ZAR                 | 49                            | 0                               | 0                                             | 0,00                 |        |
|            | 08.2025          | CNH                 | 3.527 \$              | 489                           | 0                               | (5)                                           | 0,00                 |        |
|            | 08.2025          | INR                 | 479                   | 6                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |        |
|            | 08.2025          | TWD                 | 15.966                | 490                           | 0                               | (65)                                          | (0,01)               |        |
|            | 08.2025          | \$                  | 309 CNH               | 2.206                         | 1                               | 0                                             | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | CAD                 | 23.206                | \$ 16.896                     | 0                               | (111)                                         | (0,01)               |        |
|            | 07.2025          | CNH                 | 1.786                 | 248                           | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | €                   | 2.298                 | 2.629                         | 0                               | (69)                                          | (0,01)               |        |
|            | 07.2025          | £                   | 590                   | 811                           | 2                               | 0                                             | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | PLN                 | 1.992                 | 532                           | 0                               | (19)                                          | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | THB                 | 3.532                 | 107                           | 0                               | (2)                                           | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | TWD                 | 3.690                 | 113                           | 0                               | (14)                                          | 0,00                 |        |
|            | 07.2025          | \$                  | 16.888                | CAD 23.214                    | 125                             | 0                                             | 125                  | 0,01   |
|            | 07.2025          |                     | 1.146 ¥               | 164.665                       | 0                               | (6)                                           | (6)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          |                     | 138 SGD               | 177                           | 1                               | 0                                             | 1                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |                     | 66 THB                | 2.201                         | 2                               | 0                                             | 2                    | 0,00   |
|            | 07.2025          |                     | 172 TWD               | 5.454                         | 16                              | 0                                             | 16                   | 0,00   |
|            | MYI              | 08.2025             | CAD                   | 23.175                        | \$ 16.888                       | 0                                             | (125)                | (125)  |
| 08.2025    |                  | CNH                 | 4.360                 | 604                           | 0                               | (7)                                           | (7)                  | 0,00   |
| 08.2025    |                  | SGD                 | 16                    | 13                            | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| 08.2025    |                  | TWD                 | 13.148                | 407                           | 0                               | (50)                                          | (50)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | €                   | 267                   | 312                           | 0                               | (1)                                           | (1)                  | 0,00   |
| 07.2025    |                  | £                   | 123                   | 170                           | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  | ¥                   | 425.510               | 2.918                         | 0                               | (28)                                          | (28)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | \$                  | 36                    | £ 26                          | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                     | 587 ¥                 | 84.800                        | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                     | 3 PLN                 | 9                             | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| 08.2025    |                  |                     | 310 CNH               | 2.219                         | 1                               | 0                                             | 1                    | 0,00   |
| 08.2025    |                  |                     | 2.918 ¥               | 423.945                       | 28                              | 0                                             | 28                   | 0,00   |
| 08.2025    |                  |                     | 301 CNH               | 2.184                         | 5                               | 0                                             | 5                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  | ¥                   | 1.533.228             | \$ 10.575                     | 0                               | (39)                                          | (39)                 | 0,00   |
| 07.2025    |                  | \$                  | 774                   | CNY 5.543                     | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                     | 3 SGD                 | 3                             | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| 07.2025    |                  |                     | 1.743 TWD             | 51.588                        | 33                              | 0                                             | 33                   | 0,00   |
| 08.2025    |                  | CNY                 | 5.528                 | \$ 774                        | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
| RYL SCX    |                  | 08.2025             | INR                   | 497                           | 6                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
|            | 08.2025          | SGD                 | 3                     | 3                             | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
|            | 08.2025          | TWD                 | 3.994                 | 122                           | 0                               | (16)                                          | (16)                 | 0,00   |
|            | 08.2025          | \$                  | 1.883 CNH             | 13.586                        | 21                              | 0                                             | 21                   | 0,00   |
|            | 08.2025          |                     | 4 ¥                   | 526                           | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | €                   | 162                   | \$ 187                        | 0                               | (4)                                           | (4)                  | 0,00   |
|            | 07.2025          | ¥                   | 61.727                | 428                           | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
|            | 08.2025          | \$                  | 428                   | ¥ 61.500                      | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | £                   | 39.714                | \$ 53.773                     | 0                               | (649)                                         | (649)                | (0,05) |
|            | 07.2025          | THB                 | 566                   | 17                            | 0                               | 0                                             | 0                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | \$                  | 382                   | ¥ 55.331                      | 1                               | 0                                             | 1                    | 0,00   |
|            | 09.2025          |                     | 177 MXN               | 3.425                         | 3                               | 0                                             | 3                    | 0,00   |
|            | 07.2025          | ¥                   | 709.260               | \$ 4.925                      | 15                              | 0                                             | 15                   | 0,00   |
|            | 08.2025          | \$                  | 4.925                 | ¥ 706.649                     | 0                               | (15)                                          | (15)                 | 0,00   |
|            |                  |                     |                       |                               | \$ 4.993                        | \$ (17.222)                                   | \$ (12.229)          | (0,97) |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | €                   | 172.105               | \$ 201.514                    | \$ 0                            | \$ (512)                                      | (0,04)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 201.956               | € 172.105                     | 510                             | 0                                             | 0,04                 |
| BOA        | 07.2025          |                     | 207.217               | 182.241                       | 6.706                           | 0                                             | 0,53                 |
|            | 07.2025          |                     | 926                   | 808                           | 23                              | 0                                             | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | €                   | 907                   | \$ 1.039                      | 0                               | (26)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 207.453               | € 182.674                     | 6.980                           | 0                                             | 0,56                 |
| CBK        | 07.2025          | €                   | 285                   | \$ 328                        | 0                               | (6)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.644                 | € 1.425                       | 28                              | 0                                             | 0,00                 |
| DUB        | 07.2025          | €                   | 184.451               | \$ 213.982                    | 0                               | (2.537)                                       | (0,20)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 213.982               | € 184.047                     | 2.533                           | 0                                             | 0,20                 |
| MBC        | 07.2025          | €                   | 1.134                 | \$ 1.312                      | 0                               | (19)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 1.922                 | € 1.676                       | 46                              | 0                                             | 0,00                 |
| WST        | 07.2025          | €                   | 182.912               | \$ 214.491                    | 0                               | (219)                                         | (0,02)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 195.570               | € 173.114                     | 7.640                           | 0                                             | 0,61                 |
|            | 08.2025          |                     | 214.960               | 182.912                       | 219                             | 0                                             | 0,02                 |
|            |                  |                     |                       | \$ 24.685                     | \$ (3.319)                      | \$ 21.366                                     | 1,70                 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025          | £ 15.154               | \$ 20.794                | \$ 28                            | \$ 0                               | \$ 28                                                | 0,00                      |
|            | 08.2025          | \$ 20.797              | £ 15.154                 | 0                                | (28)                               | (28)                                                 | 0,00                      |
| BOA        | 07.2025          | 22                     | 16                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025          | £ 16.082               | \$ 21.881                | 0                                | (157)                              | (157)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025          | \$ 20.569              | £ 15.234                 | 306                              | 0                                  | 306                                                  | 0,02                      |
|            | 08.2025          | 21.835                 | 16.046                   | 157                              | 0                                  | 157                                                  | 0,01                      |
| CBK        | 07.2025          | £ 16                   | \$ 21                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025          | \$ 320                 | £ 235                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| JPM        | 07.2025          | 21.057                 | 15.631                   | 362                              | 0                                  | 362                                                  | 0,03                      |
| MBC        | 07.2025          | 694                    | 511                      | 7                                | (1)                                | 6                                                    | 0,00                      |
| SSB        | 07.2025          | £ 15.904               | \$ 21.807                | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025          | \$ 21.017              | £ 15.522                 | 254                              | 0                                  | 254                                                  | 0,02                      |
|            | 08.2025          | 21.810                 | 15.904                   | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                      |
| UAG        | 07.2025          | 10                     | 7                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            |                  |                        |                          | \$ 1.129                         | \$ (199)                           | \$ 930                                               | 0,07                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BPS        | 07.2025          | NOK 469                | \$ 47                    | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025          | \$ 749                 | NOK 7.633                | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025          | NOK 14                 | \$ 1                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025          | \$ 29                  | NOK 297                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MYI        | 07.2025          | NOK 6.817              | \$ 676                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025          | \$ 753                 | NOK 7.660                | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025          | 676                    | 6.816                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
| SOG        | 07.2025          | NOK 7.524              | \$ 749                   | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025          | \$ 749                 | NOK 7.522                | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                      |
| UAG        | 07.2025          | 680                    | 6.904                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            |                  |                        |                          | \$ 19                            | \$ (8)                             | \$ 11                                                | 0,00                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BRC        | 07.2025          | \$ 17                  | SEK 168                  | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025          | SEK 104.778            | \$ 11.055                | 61                               | 0                                  | 61                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025          | \$ 1                   | SEK 13                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025          | 11.019                 | 104.211                  | 0                                | (61)                               | (61)                                                 | 0,00                      |
| FAR        | 07.2025          | 10.783                 | 103.280                  | 54                               | 0                                  | 54                                                   | 0,00                      |
| IND        | 07.2025          | SEK 103.892            | \$ 10.982                | 81                               | 0                                  | 81                                                   | 0,01                      |
|            | 08.2025          | \$ 10.982              | SEK 103.668              | 0                                | (81)                               | (81)                                                 | (0,01)                    |
| MYI        | 07.2025          | 10.293                 | 98.913                   | 86                               | 0                                  | 86                                                   | 0,01                      |
| UAG        | 07.2025          | 10.783                 | 103.610                  | 89                               | 0                                  | 89                                                   | 0,01                      |
|            |                  |                        |                          | \$ 371                           | \$ (142)                           | \$ 229                                               | 0,02                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BOA        | 07.2025          | SGD 2.864              | \$ 2.237                 | \$ 0                             | \$ (12)                            | \$ (12)                                              | 0,00                      |
|            | 07.2025          | \$ 4.869               | SGD 6.276                | 59                               | 0                                  | 59                                                   | 0,01                      |
|            | 08.2025          | 2.237                  | 2.857                    | 12                               | 0                                  | 12                                                   | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025          | 3                      | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025          | 3.158                  | 4.069                    | 36                               | 0                                  | 36                                                   | 0,00                      |
| FAR        | 07.2025          | SGD 7.401              | \$ 5.803                 | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025          | \$ 6.439               | SGD 8.285                | 66                               | 0                                  | 66                                                   | 0,01                      |
|            | 08.2025          | 5.803                  | 7.384                    | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                      |
| GLM        | 07.2025          | SGD 3.075              | \$ 2.413                 | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025          | \$ 2.413               | SGD 3.068                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| MBC        | 07.2025          | SGD 7.150              | \$ 5.529                 | 0                                | (85)                               | (85)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025          | \$ 4.454               | SGD 5.714                | 32                               | 0                                  | 32                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025          | 5.529                  | 7.134                    | 86                               | 0                                  | 86                                                   | 0,01                      |
|            |                  |                        |                          | \$ 302                           | \$ (107)                           | \$ 195                                               | 0,02                      |

|                                  |  |  |  |  |  |              |        |
|----------------------------------|--|--|--|--|--|--------------|--------|
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |  |  |  |  |  | \$ 10.531    | 0,84   |
| Summe Anlagen                    |  |  |  |  |  | \$ 1.299.117 | 103,16 |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |  |  |  |  |  | \$ (39.847)  | (3,16) |
| Nettvermögen                     |  |  |  |  |  | \$ 1.259.270 | 100,00 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin,

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,11 %):

| Emittentenbeschreibung          | Kupon   | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum  | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---------------------------------|---------|------------------|------------|----------|-----------|----------------------|
| BMW International Investment BV | 2,812 % | 09.10.2026       | 05.12.2024 | \$ 1.270 | \$ 1.412  | 0,11                 |

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 406 USD (31. Dezember 2024: 19.917 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 20.860 USD (31. Dezember 2024: 14.566 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 4.620 USD (31. Dezember 2024: 7.480 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 1.040.438                                                    | \$ 4.272                                                     | \$ 1.044.710 |
| Investmentfonds               | 21.826                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 21.826       |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 213.500                                                         | 0                                                            | 213.500      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (130)                                                                       | 19.211                                                          | 0                                                            | 19.081       |
| Summen                        | \$ 21.696                                                                   | \$ 1.273.149                                                    | \$ 4.272                                                     | \$ 1.299.117 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 1.100.003                                                    | \$ 114                                                       | \$ 1.100.117 |
| Investmentfonds               | 52.751                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 52.751       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (255)                                                                       | (1.233)                                                         | 0                                                            | (1.488)      |
| Summen                        | \$ 52.496                                                                   | \$ 1.098.770                                                    | \$ 114                                                       | \$ 1.151.380 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus<br>Pensionsgeschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|------------|------------------|------------------|--------------|---------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                | 4,000 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025       | \$ (388)     | \$ (388)                                    | (0,03)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                  |                  |              | \$ (388)                                    | (0,03)                  |

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                        |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                        |                                       |                                     |
|------------|------------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarkt-<br>wert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarkt-<br>wert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (28)                                  | \$ 20                                 | \$ (8)                              | \$ (6)                                   | \$ 0                                  | \$ (6)                              |
| BOA        | (3.052)                                  | 2.910                                 | (142)                               | (19)                                     | 0                                     | (19)                                |
| BPS        | (59)                                     | 0                                     | (59)                                | 161                                      | 0                                     | 161                                 |
| BRC        | 7.191                                    | (6.730)                               | 461                                 | 416                                      | (330)                                 | 86                                  |
| BSH        | (9)                                      | (10)                                  | (19)                                | k. A.                                    | k. A.                                 | k. A.                               |
| CBK        | (162)                                    | 270                                   | 108                                 | 73                                       | 0                                     | 73                                  |
| DUB        | 38                                       | 0                                     | 38                                  | (4.565)                                  | 4.060                                 | (505)                               |
| FAR        | (896)                                    | 850                                   | (46)                                | 1.818                                    | (1.510)                               | 308                                 |

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                 | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                 |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement <sup>(1)</sup> |
| GLM        | \$ (10)                             | \$ 0                                  | \$ (10)                         | \$ (6)                              | \$ 0                                  | \$ (6)                          |
| GST        | 28                                  | 0                                     | 28                              | 13                                  | 0                                     | 13                              |
| JPM        | 253                                 | (320)                                 | (67)                            | 61                                  | (80)                                  | (19)                            |
| MBC        | (193)                               | 260                                   | 67                              | 885                                 | (630)                                 | 255                             |
| MYC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | 4                                   | 0                                     | 4                               |
| MYI        | 90                                  | (70)                                  | 20                              | 4                                   | 0                                     | 4                               |
| RYL        | 5                                   | 0                                     | 5                               | (107)                               | 0                                     | (107)                           |
| SCX        | (1)                                 | 0                                     | (1)                             | (3.881 )                            | 3.420                                 | (461)                           |
| SOG        | (4)                                 | 0                                     | (4)                             | 2                                   | 0                                     | 2                               |
| SSB        | (395)                               | 300                                   | (95)                            | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           | 3                                   | 0                                     | 3                               |
| UAG        | 95                                  | 0                                     | 95                              | (26)                                | 0                                     | (26)                            |
| WST        | 7.640                               | (7.290)                               | 350                             | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                           |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 54,29             | 60,20             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 19,40             | 23,18             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 1,06              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 1,56              | 4,01              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 15,28             | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,39              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,33              | 0,44              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,26              | 0,57              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 5,43              | 11,60             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,12              | 0,38              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 64,45             | 74,12             |
| Kommunalanleihen und Wechsel                                                           | 0,09              | 0,11              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 7,20              | 10,66             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | k. A.             | 5,16              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 0,88              | 0,97              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 0,73              | 0,84              |
| Staatsemissionen                                                                       | 9,21              | 8,84              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,28              | 0,32              |
| Investmentfonds                                                                        | 1,73              | 4,86              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 16,95             | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,41              | (0,04)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,01              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,04              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,23              | 0,37              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | 0,01              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,97)            | 0,70              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,81              | (1,18)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (3,16)            | (6,12)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                      |                |                          |                                   | 5,606 % fällig am 11.09.2028                   | \$ 1.400       | \$ 1.408                 | 0,05                              | Royal Bank of Canada                 | \$ 3.300       | \$ 3.307                 | 0,11                              |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>            |                |                          |                                   | 6,316 % fällig am 03.10.2029                   | 5.900          | 6.202                    | 0,20                              | Santander Holdings USA, Inc.         | 2.200          | 2.237                    | 0,07                              |
| Altice France S.A.                                   | \$ 1.288       | \$ 1.170                 | 0,04                              | Deutsche Bank AG                               | 2.800          | 2.772                    | 0,09                              | 5,473 % fällig am 20.03.2029         | 2.000          | 2.021                    | 0,06                              |
| 9,756 % fällig am 15.08.2028                         |                |                          |                                   | 2,129 % fällig am 24.11.2026                   | 4.500          | 4.372                    | 0,14                              | 6,016 % fällig am 20.03.2029         |                |                          |                                   |
| Envision Healthcare Corp.                            | 880            | 906                      | 0,03                              | 2,552 % fällig am 07.01.2028                   | 4.800          | 4.880                    | 0,16                              | Santander UK Group Holdings PLC      | 740            | 725                      | 0,02                              |
| 12,235 % fällig am 03.11.2028                        |                |                          |                                   | 5,706 % fällig am 08.02.2028                   | 200            | 210                      | 0,01                              | 3,823 % fällig am 03.11.2028         |                |                          |                                   |
| IHeartCommunications, Inc.                           | 6.364          | 5.205                    | 0,17                              | 6,720 % fällig am 18.01.2029                   | 5.700          | 6.083                    | 0,20                              | SBA Tower Trust                      | 2.500          | 2.505                    | 0,08                              |
| 10,216 % fällig am 01.05.2029                        |                |                          |                                   | 6,819 % fällig am 20.11.2029                   |                |                          |                                   | 4,831 % fällig am 15.10.2029         |                |                          |                                   |
| Lealand Finance Co. BV                               | 8              | 5                        | 0,00                              | EPR Properties                                 | 300            | 299                      | 0,01                              | Sirius Real Estate Ltd.              | € 4.700        | 5.417                    | 0,17                              |
| 7,441 % fällig am 30.06.2027                         |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.06.2027                   | 8              | 8                        | 0,00                              | 1,125 % fällig am 22.06.2026         |                |                          |                                   |
| Lealand Finance Co. BV (5,441 % bar und 3,000 % PIK) |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.12.2026                   | 34             | 34                       | 0,00                              | SLM Student Loan Trust               | 2.121          | 2.355                    | 0,08                              |
| 3,000 % - 5,441 % fällig am                          | 27             | 14                       | 0,00                              | 4,950 % fällig am 15.04.2028                   |                |                          |                                   | 2,525 % fällig am 15.12.2033         |                |                          |                                   |
| 31.12.2027 (a)                                       |                |                          |                                   | Equinix, Inc.                                  | 100            | 98                       | 0,00                              | Stellantis Finance U.S. Inc.         | \$ 4.905       | 4.947                    | 0,16                              |
| Pantheon Senior Debt Secondaries                     | 1.100          | 1.100                    | 0,03                              | Extra Space Storage LP                         | 12.000         | 12.452                   | 0,40                              | 5,350 % fällig am 17.03.2028         |                |                          |                                   |
| 6,317 % fällig am 26.03.2026 (g)                     |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.07.2030                   |                |                          |                                   | Thames Water Super Senior Issuer PLC | £ 42           | 54                       | 0,00                              |
| Poseidon Bidco SASU                                  | € 1.600        | 1.287                    | 0,04                              | Ford Motor Credit Co. LLC                      | 1.900          | 1.782                    | 0,06                              | 9,750 % fällig am 10.10.2025         |                |                          |                                   |
| 6,980 % fällig am 13.03.2030                         |                |                          |                                   | 2,900 % fällig am 16.02.2028                   | 1.500          | 1.448                    | 0,05                              | Titanium Bondco SARL (6,250 % PIK)   | € 9.089        | 3.146                    | 0,10                              |
| Project Alfa                                         | 473            | 555                      | 0,02                              | 3,815 % fällig am 02.11.2027                   | 2.800          | 2.738                    | 0,09                              | 6,250 % fällig am 14.01.2031 (a)     |                |                          |                                   |
| 4,256 % fällig am 27.02.2026 (g)                     |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 17.08.2027                   | 6.500          | 6.409                    | 0,21                              | UBS Group AG                         | \$ 5.000       | 4.897                    | 0,16                              |
| Project Hudson                                       | \$ 1.100       | 1.116                    | 0,04                              | 4,271 % fällig am 09.01.2027                   | 1.100          | 1.095                    | 0,04                              | 4,194 % fällig am 01.04.2031         |                |                          |                                   |
| 7,730 % fällig am 29.05.2026                         |                |                          |                                   | 4,389 % fällig am 08.01.2026                   | 500            | 497                      | 0,02                              | 5,428 % fällig am 08.02.2030         | 2.200          | 2.260                    | 0,07                              |
| Republic of Panama                                   | € 8.100        | 9.552                    | 0,31                              | 4,542 % fällig am 01.08.2026                   | 5.300          | 5.289                    | 0,17                              | 6,246 % fällig am 22.09.2029         | 16.600         | 17.442                   | 0,56                              |
| 4,804 % fällig am 01.04.2027                         |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 05.11.2026                   | 2.500          | 2.489                    | 0,08                              | 6,327 % fällig am 22.12.2027         | 3.100          | 3.184                    | 0,10                              |
| Subcalidora                                          | 1.800          | 2.123                    | 0,07                              | 5,810 % fällig am 05.11.2026                   | 300            | 303                      | 0,01                              | 6,442 % fällig am 11.08.2028         | 3.150          | 3.274                    | 0,11                              |
| 7,730 % fällig am 14.08.2029                         |                |                          |                                   | 6,950 % fällig am 06.03.2026                   | 350            | 355                      | 0,01                              | Uniti Group LP                       | 1.875          | 1.814                    | 0,06                              |
| Syniverse Holdings, Inc.                             | \$ 1.586       | 1.510                    | 0,05                              | 6,950 % fällig am 10.06.2026                   |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.02.2029         | 1.968          | 2.088                    | 0,07                              |
| 11,296 % fällig am 13.05.2027                        |                |                          |                                   | Hearstside Group Holdings LLC                  | 4.500          | 4.632                    | 0,15                              | 10,500 % fällig am 15.02.2028        |                |                          |                                   |
| TransDigim, Inc.                                     | 11.273         | 11.306                   | 0,36                              | 6,250 % fällig am 01.04.2030                   | 6.700          | 6.884                    | 0,22                              | VICI Properties LP                   | 3.800          | 3.743                    | 0,12                              |
| 6,796 % fällig am 28.02.2031                         |                |                          |                                   | GA Global Funding Trust                        |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.02.2027         | 7.100          | 6.873                    | 0,22                              |
| U.S. Renal Care, Inc.                                | 244            | 232                      | 0,01                              | 5,400 % fällig am 13.01.2030                   | € 14.500       | 17.189                   | 0,56                              | 3,875 % fällig am 15.02.2029         | 4.325          | 4.307                    | 0,14                              |
| 9,441 % fällig am 20.06.2028                         |                |                          |                                   | Roche Finance Europe BV                        |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.01.2028         | 4.900          | 4.816                    | 0,16                              |
| Westmoreland Coal Co.                                | 4              | 2                        | 0,00                              | 3,500 % fällig am 20.03.2030                   |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 01.12.2029         | 2.600          | 2.622                    | 0,08                              |
| 8,000 % fällig am 15.03.2029                         |                |                          |                                   | GLP Capital LP                                 | \$ 100         | 96                       | 0,00                              | 4,750 % fällig am 01.04.2028         |                |                          |                                   |
|                                                      | 36.083         | 1.17                     |                                   | 4,000 % fällig am 15.01.2030                   | 300            | 283                      | 0,01                              | Wells Fargo & Co.                    | 2.100          | 2.220                    | 0,07                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.01.2031                   | 14.688         | 14.861                   | 0,48                              | 6,303 % fällig am 23.10.2029         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,300 % fällig am 15.01.2029                   | 1.499          | 1.500                    | 0,05                              |                                      | 381.044        | 12,32                    |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 15.04.2026                   | 500            | 513                      | 0,02                              | <b>INDUSTRIEWERTE</b>                |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 01.06.2028                   | 300            | 321                      | 0,01                              | Alaska Airlines Pass-Through Trust   |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 01.12.2033                   |                |                          |                                   | 4,800 % fällig am 15.02.2029         | 2.589          | 2.593                    | 0,08                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.            | € 5.000        | 6.128                    | 0,20                              | Altice France S.A.                   | € 800          | 789                      | 0,03                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 03.05.2030                   | \$ 3.100       | 3.076                    | 0,10                              | 3,375 % fällig am 15.01.2028         | 100            | 99                       | 0,00                              |
|                                                      |                |                          |                                   | HSBC Holdings PLC                              | 200            | 203                      | 0,01                              | 4,125 % fällig am 15.01.2029         | \$ 200         | 165                      | 0,01                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 4,041 % fällig am 13.03.2028                   | € 4.100        | 5.048                    | 0,16                              | 5,125 % fällig am 15.07.2029         | 400            | 337                      | 0,01                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,887 % fällig am 14.08.2027                   |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.01.2028         | 600            | 498                      | 0,02                              |
|                                                      |                |                          |                                   | IHG Finance LLC                                | \$ 4.400       | 4.294                    | 0,14                              | 5,500 % fällig am 15.10.2029         | € 1.300        | 1.378                    | 0,04                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 28.11.2029                   | 700            | 786                      | 0,03                              | 5,875 % fällig am 01.02.2027         | \$ 1.400       | 1.261                    | 0,04                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Intesa Sanpaolo SpA                            | € 2.200        | 2.802                    | 0,09                              | 8,125 % fällig am 01.02.2027         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 23.09.2029                   |                |                          |                                   | Altrad Investment Authority S.A.S.   | € 3.600        | 4.232                    | 0,14                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 7,200 % fällig am 28.11.2033                   | € 2.200        | 2.802                    | 0,09                              | 3,704 % fällig am 23.06.2029         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | Iridium Capital PLC                            | 8.700          | 10.405                   | 0,34                              | American Airlines Pass-Through Trust | \$ 179         | 170                      | 0,01                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 18.06.2029                   |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 15.04.2030         | 50             | 49                       | 0,00                              |
|                                                      |                |                          |                                   | JAB Holdings BV                                | \$ 2.200       | 2.208                    | 0,07                              | 3,375 % fällig am 01.11.2028         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 25.04.2034                   | 2.100          | 2.169                    | 0,07                              | AppLovin Corp.                       | 9.300          | 9.424                    | 0,30                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Jackson National Life Global Funding           | 1.600          | 1.567                    | 0,05                              | 5,125 % fällig am 01.12.2029         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,315 % fällig am 14.01.2028                   | 2.500          | 2.479                    | 0,08                              | Bacardi-Martini BV                   | 5.100          | 5.237                    | 0,17                              |
|                                                      |                |                          |                                   | KBC Group NV                                   | 3.700          | 3.751                    | 0,12                              | 5,550 % fällig am 01.02.2030         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,796 % fällig am 19.01.2029                   | 4.100          | 4.179                    | 0,13                              | BAT International Finance PLC        | 6.300          | 6.613                    | 0,21                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Lloyds Banking Group PLC                       |                |                          |                                   | 5,931 % fällig am 02.02.2029         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 3,574 % fällig am 07.11.2028                   |                |                          |                                   | Bayer U.S. Finance LLC               | 11.100         | 11.285                   | 0,36                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 11.01.2027                   |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 21.11.2026         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,462 % fällig am 05.01.2028                   |                |                          |                                   | Boeing Co.                           | 2.600          | 2.522                    | 0,08                              |
|                                                      |                |                          |                                   | LPL Holdings, Inc.                             |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 01.02.2028         | 4.400          | 4.529                    | 0,15                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,700 % fällig am 20.05.2027                   |                |                          |                                   | 6,259 % fällig am 01.05.2027         | 5.900          | 6.239                    | 0,20                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Nationwide Building Society                    | 14.000         | 14.357                   | 0,46                              | 6,298 % fällig am 01.05.2029         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 6,557 % fällig am 18.10.2027                   |                |                          |                                   | British Airways Pass-Through Trust   | 1.423          | 1.368                    | 0,04                              |
|                                                      |                |                          |                                   | NatWest Group PLC                              | 700            | 715                      | 0,02                              | 4,250 % fällig am 15.05.2034         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,516 % fällig am 30.09.2028                   | 2.700          | 2.749                    | 0,09                              | Broadcom, Inc.                       | 1.800          | 1.826                    | 0,06                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,583 % fällig am 01.03.2028                   | 2.000          | 2.077                    | 0,07                              | 5,050 % fällig am 12.07.2027         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,808 % fällig am 13.09.2029                   |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 12.07.2029         | 500            | 512                      | 0,02                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                | 564            | 550                      | 0,02                              | Burberry Group PLC                   | £ 8.900        | 12.210                   | 0,39                              |
|                                                      |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 09.03.2026                   | 1.036          | 1.022                    | 0,03                              | 5,750 % fällig am 20.06.2030         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 5,300 % fällig am 13.09.2027                   |                |                          |                                   | Carvana Co. (13,000 % PIK)           | \$ 4.411       | 4.642                    | 0,15                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC | 9.100          | 6.476                    | 0,21                              | 13,000 % fällig am 01.06.2030 (a)    |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 05.04.2032 (c)               |                |                          |                                   | Carvana Co. (14,000 % PIK)           | 4.011          | 4.619                    | 0,15                              |
|                                                      |                |                          |                                   | Principal Life Global Funding                  | 6.900          | 7.020                    | 0,23                              | 14,000 % fällig am 01.06.2031 (a)    |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 27.11.2029                   |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>CDW LLC</b>                                |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 18.01.2033              | € 100          | \$ 77                    | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055                            | 46.100         | 47.240                   | 1,53                              |
| 2,670 % fällig am 01.12.2026                  | \$ 6.460       | \$ 6.302                 | 0,20                              | 4,375 % fällig am 03.07.2036              | £ 100          | 90                       | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Centene Corp.</b>                          |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 30.04.2033              | 100            | 93                       | 0,00                              | 3,500 % fällig am 01.11.2047                            | \$ 75          | \$ 69                    | 0,00                              |
| 2,625 % fällig am 01.08.2031                  | 600            | 514                      | 0,02                              | <b>Thames Water Utilities Ltd.</b>        |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.11.2042 -                          |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 15.02.2030                  | 300            | 277                      | 0,01                              | 0,000 % fällig am                         |                |                          |                                   | 01.03.2049                                              | 1.333          | 1.279                    | 0,04                              |
| 4,625 % fällig am 15.12.2029                  | 11.362         | 11.059                   | 0,36                              | 22.03.2027 (c)                            | 6              | 7                        | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security TBA</b>             |                |                          |                                   |
| <b>CGI, Inc.</b>                              |                |                          |                                   | <b>Topaz Solar Farms LLC</b>              |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 01.08.2055                            | 20.600         | 17.087                   | 0,55                              |
| 1,450 % fällig am 14.09.2026                  | 2.000          | 1.932                    | 0,06                              | 4,875 % fällig am 30.09.2039              | \$ 32          | 28                       | 0,00                              | 3,000 % fällig am 01.07.2055                            | 17.650         | 15.275                   | 0,49                              |
| 4,950 % fällig am 14.03.2030                  | 8.400          | 8.486                    | 0,27                              | 5,750 % fällig am 30.09.2039              | 175            | 172                      | 0,01                              | 3,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| <b>Cheplapharm Arzneimittel GmbH</b>          |                |                          |                                   | <b>U.S. Renal Care, Inc.</b>              |                |                          |                                   | 01.08.2055                                              | 60.750         | 54.688                   | 1,77                              |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028                  | 400            | 387                      | 0,01                              | 10,625 % fällig am 28.06.2028             | 14             | 12                       | 0,00                              | 4,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| <b>Dell International LLC</b>                 |                |                          |                                   | <b>United Airlines Pass-Through Trust</b> |                |                          |                                   | 01.08.2055                                              | 124.350        | 115.626                  | 3,74                              |
| 4,750 % fällig am 01.04.2028                  | 8.300          | 8.399                    | 0,27                              | 2,700 % fällig am 01.11.2033              | 303            | 271                      | 0,01                              | 4,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| <b>Delta Air Lines Pass-Through Trust</b>     |                |                          |                                   | 3,100 % fällig am 07.01.2030              | 1.692          | 1.619                    | 0,05                              | 01.08.2055                                              | 84.800         | 81.101                   | 2,62                              |
| 2,000 % fällig am 10.12.2029                  | 175            | 165                      | 0,01                              | 3,500 % fällig am 01.09.2031              | 340            | 321                      | 0,01                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| <b>DISH DBS Corp.</b>                         |                |                          |                                   | 4,150 % fällig am 25.02.2033              | 460            | 442                      | 0,01                              | 01.08.2055                                              | 120.600        | 118.160                  | 3,82                              |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026                  | 2.950          | 2.683                    | 0,09                              | 5,875 % fällig am 15.04.2029              | 3.657          | 3.735                    | 0,12                              | 5,500 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028                  | 4.620          | 4.008                    | 0,13                              | <b>Universal Music Group NV</b>           |                |                          |                                   | 01.08.2055                                              | 117.950        | 117.872                  | 3,81                              |
| <b>Energy Transfer LP</b>                     |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 30.06.2032              | € 1.100        | 1.325                    | 0,04                              | 6,000 % fällig am 01.07.2055 -                          |                |                          |                                   |
| 5,200 % fällig am 01.04.2030                  | 2.000          | 2.045                    | 0,07                              | <b>Var Energi ASA</b>                     |                |                          |                                   | 01.08.2055                                              | 550.400        | 558.926                  | 18,07                             |
| 5,250 % fällig am 01.07.2029                  | 2.600          | 2.664                    | 0,09                              | 3,875 % fällig am 12.03.2031              | 3.400          | 4.011                    | 0,13                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055                            | 528.250        | 544.684                  | 17,61                             |
| 6,050 % fällig am 01.12.2026                  | 7.300          | 7.456                    | 0,24                              | <b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>  |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 01.08.2055 -                          |                |                          |                                   |
| <b>Flora Food Management BV</b>               |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.08.2029              | \$ 300         | 283                      | 0,01                              | 01.09.2055                                              | 29.000         | 30.395                   | 0,98                              |
| 6,875 % fällig am 02.07.2029                  | € 1.600        | 1.910                    | 0,06                              | <b>Venture Global LNG, Inc.</b>           |                |                          |                                   |                                                         | 1.763.569      | 57,03                    |                                   |
| <b>Flutter Treasury DAC</b>                   |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 01.02.2029              | 13.800         | 15.042                   | 0,49                              | <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                             |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 29.04.2029                  | 10.000         | 12.195                   | 0,39                              | 9,875 % fällig am 01.02.2032              | 1.300          | 1.405                    | 0,05                              | <b>U.S. Treasury Bonds</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Global Payments, Inc.</b>                  |                |                          |                                   | <b>Whitbread Group PLC</b>                |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 15.05.2049                            | 4.900          | 3.519                    | 0,11                              |
| 1,200 % fällig am 01.03.2026                  | \$ 600         | 586                      | 0,02                              | 5,500 % fällig am 31.05.2032              | £ 6.100        | 8.305                    | 0,27                              | 4,625 % fällig am 15.05.2054                            | 36.600         | 35.559                   | 1,15                              |
| <b>HCA, Inc.</b>                              |                |                          |                                   | <b>Windstream Services LLC</b>            |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)</b> |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.03.2028                  | 1.500          | 1.523                    | 0,05                              | 8,250 % fällig am 01.10.2031              | \$ 8.400       | 8.804                    | 0,28                              | 0,125 % fällig am 15.10.2025                            | 6.305          | 6.283                    | 0,20                              |
| <b>Icon Investments Six DAC</b>               |                |                          |                                   |                                           |                | 278.506                  | 9,01                              | 0,125 % fällig am 15.10.2026                            | 15.729         | 15.550                   | 0,50                              |
| 5,849 % fällig am 08.05.2029                  | 4.300          | 4.463                    | 0,14                              | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>             |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.07.2030                            | 3.278          | 3.080                    | 0,10                              |
| <b>Imperial Brands Finance PLC</b>            |                |                          |                                   | <b>Dominion Energy, Inc.</b>              |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.01.2031                            | 246            | 228                      | 0,01                              |
| 6,000 % fällig am 26.07.2026                  | 200            | 198                      | 0,01                              | 5,000 % fällig am 15.06.2030              | 10.200         | 10.414                   | 0,34                              | 0,125 % fällig am 15.07.2031                            | 239            | 220                      | 0,01                              |
| <b>Intelsat Jackson Holdings S.A.</b>         |                |                          |                                   | <b>Edison International</b>               |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 15.07.2029                            | 5.269          | 5.061                    | 0,16                              |
| 6,500 % fällig am 15.03.2030 (h)              | 5.697          | 5.823                    | 0,19                              | 6,250 % fällig am 15.03.2030              | 900            | 914                      | 0,03                              | 0,250 % fällig am 15.02.2050                            | 1.372          | 798                      | 0,03                              |
| <b>JDE Peet's NV</b>                          |                |                          |                                   | <b>Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC</b>   |                |                          |                                   | 0,375 % fällig am 15.01.2027                            | 235            | 232                      | 0,01                              |
| 4,500 % fällig am 23.01.2034                  | € 2.800        | 3.442                    | 0,11                              | 2,950 % fällig am 15.04.2025              | € 11.000       | 11.298                   | 0,37                              | 0,375 % fällig am 15.07.2027                            | 66             | 65                       | 0,00                              |
| <b>JetBlue Pass-Through Trust</b>             |                |                          |                                   | <b>NorthWestern Corp.</b>                 |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.07.2032                            | 9.715          | 9.066                    | 0,29                              |
| 4,000 % fällig am 15.05.2034                  | \$ 2.328       | 2.185                    | 0,07                              | 5,073 % fällig am 21.03.2030              | \$ 5.500       | 5.589                    | 0,18                              | 0,750 % fällig am 15.07.2028                            | 1.240          | 1.225                    | 0,04                              |
| <b>JT International Financial Services BV</b> |                |                          |                                   | <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>     |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 15.02.2042                            | 426            | 331                      | 0,01                              |
| 3,625 % fällig am 11.04.2034                  | € 4.200        | 4.876                    | 0,16                              | 2,100 % fällig am 01.08.2027              | 6.040          | 5.722                    | 0,18                              | 0,750 % fällig am 15.02.2045                            | 1.090          | 796                      | 0,03                              |
| <b>KazMunayGas National Co. JSC</b>           |                |                          |                                   | 3,300 % fällig am 15.03.2027              | 773            | 756                      | 0,02                              | 0,875 % fällig am 15.01.2029                            | 2.510          | 2.472                    | 0,08                              |
| 4,750 % fällig am 19.04.2027                  | \$ 17.000      | 17.045                   | 0,55                              | 3,300 % fällig am 01.12.2027              | 20.052         | 19.407                   | 0,63                              | 0,875 % fällig am 15.02.2047                            | 1.727          | 1.253                    | 0,04                              |
| <b>LG Energy Solution Ltd.</b>                |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 01.07.2028              | 1.459          | 1.416                    | 0,05                              | 1,000 % fällig am 15.02.2046                            | 677            | 513                      | 0,02                              |
| 5,250 % fällig am 02.04.2028                  | 5.300          | 5.322                    | 0,17                              | 4,550 % fällig am 01.07.2030              | 4.717          | 4.606                    | 0,15                              | 1,000 % fällig am 15.02.2048                            | 1.821          | 1.341                    | 0,04                              |
| <b>Microchip Technology, Inc.</b>             |                |                          |                                   | 5,450 % fällig am 15.06.2027              | 2.600          | 2.631                    | 0,08                              | 1,000 % fällig am 15.02.2049                            | 3.582          | 2.601                    | 0,08                              |
| 5,050 % fällig am 15.02.2030                  | 7.900          | 8.017                    | 0,26                              | 6,100 % fällig am 15.01.2029              | 1.000          | 1.036                    | 0,03                              | 1,125 % fällig am 15.01.2033                            | 6.353          | 6.074                    | 0,20                              |
| <b>Mitchells &amp; Butlers Finance PLC</b>    |                |                          |                                   | <b>Rio Oil Finance Trust</b>              |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 15.07.2033                            | 33.269         | 32.324                   | 1,05                              |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030                  | £ 26           | 36                       | 0,00                              | 8,200 % fällig am 06.04.2028              | 623            | 650                      | 0,02                              | 1,375 % fällig am 15.02.2044                            | 138            | 116                      | 0,00                              |
| <b>Motorola Solutions, Inc.</b>               |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 06.01.2027              | 258            | 268                      | 0,01                              | 1,500 % fällig am 15.02.2053                            | 4.101          | 3.251                    | 0,11                              |
| 2,300 % fällig am 15.11.2030                  | \$ 4.383       | 3.892                    | 0,13                              | <b>Southern California Edison Co.</b>     |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 15.01.2034                            | 6.887          | 6.831                    | 0,22                              |
| 4,345 % fällig am 17.09.2027                  | 2.800          | 2.690                    | 0,09                              | 4,700 % fällig am 01.06.2027              | 3.035          | 3.047                    | 0,10                              | 1,875 % fällig am 15.07.2034                            | 46.307         | 46.370                   | 1,50                              |
| 4,810 % fällig am 17.09.2030 (h)              | 300            | 275                      | 0,01                              | 5,250 % fällig am 15.03.2030              | 3.400          | 3.437                    | 0,11                              | 2,125 % fällig am 15.02.2040                            | 297            | 293                      | 0,01                              |
| <b>NPC Ukregenergo</b>                        |                |                          |                                   | 5,850 % fällig am 01.11.2027              | 1.200          | 1.230                    | 0,04                              | 2,125 % fällig am 15.02.2041                            | 146            | 144                      | 0,00                              |
| 6,875 % fällig am 09.11.2028                  | 200            | 162                      | 0,01                              | <b>Southern Gas Corridor CJSC</b>         |                |                          |                                   | <b>U.S. Treasury Notes</b>                              |                |                          |                                   |
| <b>Oracle Corp.</b>                           |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 24.03.2026              | 3.900          | 3.956                    | 0,13                              | 2,375 % fällig am 31.03.2029                            | 15.600         | 14.867                   | 0,48                              |
| 4,800 % fällig am 03.08.2028                  | 600            | 610                      | 0,02                              |                                           |                | 76.377                   | 2,47                              | 2,875 % fällig am 15.05.2032                            | 4.500          | 4.200                    | 0,14                              |
| <b>Petroleos de Venezuela S.A.</b>            |                |                          |                                   | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel    |                | 735.927                  | 23,80                             |                                                         | 204.663        | 6,62                     |                                   |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^                | 220            | 28                       | 0,00                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>              |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>Petroleos Mexicanos</b>                    |                |                          |                                   | <b>Freddie Mac</b>                        |                |                          |                                   | <b>20 Times Square Trust</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,950 % fällig am 28.01.2031                  | 4.300          | 3.891                    | 0,13                              | 3,750 % fällig am 25.09.2055              | 5.958          | 5.469                    | 0,18                              | 3,203 % fällig am 15.05.2035                            | 3.800          | 3.541                    | 0,11                              |
| 6,700 % fällig am 16.02.2032                  | 1.831          | 1.703                    | 0,06                              | 4,750 % fällig am 25.07.2056              | 10.559         | 10.362                   | 0,34                              | <b>225 Liberty Street Trust</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>Rolls-Royce PLC</b>                        |                |                          |                                   | <b>Ginnie Mae</b>                         |                |                          |                                   | 4,803 % fällig am 10.02.2036                            | 1.023          | 896                      | 0,03                              |
| 3,375 % fällig am 18.06.2026                  | £ 2.067        | 2.804                    | 0,09                              | 5,096 % fällig am 20.02.2070              | 234            | 235                      | 0,01                              | <b>280 Park Avenue Mortgage Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 15.10.2027                  | \$ 7.000       | 7.189                    | 0,23                              | 5,196 % fällig am 20.02.2067              | 609            | 610                      | 0,02                              | 5,692 % fällig am 15.09.2034                            | 9.300          | 9.122                    | 0,29                              |
| <b>Spirit Airlines Pass-Through Trust</b>     |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 20.07.2053 -            |                |                          |                                   | <b>Avon Finance PLC</b>                                 |                |                          |                                   |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029                  | 344            | 316                      | 0,01                              | 20.08.2053                                | 19.888         | 20.017                   | 0,65                              | 5,139 % fällig am 28.12.2049                            | £ 6.473        | 8.885                    | 0,29                              |
| <b>Tennessee Gas Pipeline Co. LLC</b>         |                |                          |                                   | <b>Ginnie Mae, TBA</b>                    |                |                          |                                   | <b>Banc of America Merrill Lynch Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 2,900 % fällig am 01.03.2030                  | 1.900          | 1.756                    | 0,06                              | 2,500 % fällig am 01.07.2055              | 900            | 765                      | 0,03                              | 4,325 % fällig am 15.08.2046                            | \$ 680         | 611                      | 0,02                              |
| <b>Thames Water Super Senior Issuer PLC</b>   |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.07.2055              | 3.500          | 3.096                    | 0,10                              | <b>Barclays Commercial Mortgage Securities Trust</b>    |                |                          |                                   |
| 9,750 % fällig am 10.10.2027                  | £ 42           | 63                       | 0,00                              | 3,500 % fällig am 01.07.2055              | 5.000          | 4.546                    | 0,15                              | 3,966 % fällig am 10.08.2033                            | 635            | 587                      | 0,02                              |
| <b>Thames Water Utilities Finance PLC</b>     |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.07.2055              | 5.000          | 4.650                    | 0,15                              | <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                         |                |                          |                                   |
| 2,375 % fällig am 22.04.2042                  | 200            | 182                      | 0,01                              | 4,500 % fällig am 01.07.2055              | 10.900         | 10.435                   | 0,34                              | 4,909 % fällig am 25.09.2035                            | 2.090          | 718                      | 0,02                              |
| 4,000 % fällig am 18.04.2029                  | € 400          | 308                      | 0,01                              | 5,000 % fällig am 01.08.2055              | 1.000          | 982                      | 0,03                              | <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>     |                |                          |                                   |
|                                               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 5,062 % fällig am 26.01.2036                            | 3.480          | 2.478                    | 0,08                              |
|                                               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | <b>Bletchley Park Funding PLC</b>                       |                |                          |                                   |
|                                               |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 27.07.2070                            | £ 1.462        | 2.013                    | 0,07                              |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Brants Bridge PLC</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Natixis Commercial Mortgage Securities Trust</b>        |                |                          |                                   | <b>Flexicommercial ABS Trust</b>     |                |                          |                                   |
| 5,139 % fällig am 14.06.2066                                | £ 1.778        | \$ 2.442                 | 0,08                              | 3,858 % fällig am 10.04.2037                               | \$ 480         | \$ 421                   | 0,01                              | 4,876 % fällig am 14.06.2031         | AUD 4.700      | \$ 3.080                 | 0,10                              |
| <b>BX Trust</b>                                             |                |                          |                                   | <b>Newgate Funding PLC</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b> |                |                          |                                   |
| 6,379 % fällig am 15.05.2035                                | \$ 1.080       | 1.076                    | 0,03                              | 2,575 % fällig am 15.12.2050                               | € 205          | 237                      | 0,01                              | 2,747 % fällig am 20.12.2044         | € 12.700       | 14.939                   | 0,49                              |
| <b>Canterbury Finance PLC</b>                               |                |                          |                                   | 4,518 % fällig am 15.12.2050                               | £ 4.901        | 6.535                    | 0,21                              | 4,936 % fällig am 22.09.2043         | 1.579          | 1.895                    | 0,06                              |
| 5,073 % fällig am 16.05.2058                                | £ 5.664        | 7.771                    | 0,25                              | <b>Olympus Trust</b>                                       |                |                          |                                   | 5,636 % fällig am 22.09.2043         | 789            | 952                      | 0,03                              |
| <b>ChaseFlex Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 4,508 % fällig am 10.10.2056                               | AUD 15.775     | 10.337                   | 0,33                              | <b>Panorama Auto Trust</b>           |                |                          |                                   |
| 5,114 % fällig am 25.05.2037                                | \$ 10          | 10                       | 0,00                              | <b>PHH Alternative Mortgage Trust</b>                      |                |                          |                                   | 4,705 % fällig am 15.03.2033         | AUD 16.685     | 10.914                   | 0,35                              |
| <b>Cheshire PLC</b>                                         |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.02.2037                               | \$ 2.987       | 2.505                    | 0,08                              | <b>Pepper SPARKZ Trust</b>           |                |                          |                                   |
| 6,837 % fällig am 20.08.2045                                | £ 1.168        | 1.605                    | 0,05                              | <b>Primrose Residential DAC</b>                            |                |                          |                                   | 4,735 % fällig am 15.01.2033         | 7.591          | 4.973                    | 0,16                              |
| <b>Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates</b> |                |                          |                                   | 3,399 % fällig am 24.10.2061                               | € 2.318        | 2.723                    | 0,09                              |                                      |                |                          |                                   |
| 4,455 % fällig am 25.08.2035                                | \$ 776         | 640                      | 0,02                              | <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>              |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Commercial Mortgage Trust</b>                            |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.07.2036                               | \$ 1.018       | 936                      | 0,03                              |                                      |                |                          |                                   |
| 5,608 % fällig am 15.09.2033                                | 2.800          | 2.565                    | 0,08                              | 4,934 % fällig am 25.08.2037                               | 284            | 272                      | 0,01                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   | <b>Residential Asset Securitization Trust</b>              |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,812 % fällig am 25.08.2035                                | 818            | 727                      | 0,02                              | 6,609 % fällig am 25.02.2037                               | 10.618         | 2.346                    | 0,08                              |                                      |                |                          |                                   |
| 4,852 % fällig am 20.03.2046                                | 9              | 8                        | 0,00                              | <b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b> |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.03.2036                                | 32             | 32                       | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.08.2036                               | 872            | 730                      | 0,02                              |                                      |                |                          |                                   |
| 4,934 % fällig am 25.12.2046                                | 1.548          | 1.299                    | 0,04                              | <b>RMAC PLC</b>                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.08.2035                                | 304            | 290                      | 0,01                              | 5,437 % fällig am 15.02.2047                               | £ 8.214        | 11.297                   | 0,37                              |                                      |                |                          |                                   |
| 5,899 % fällig am 25.11.2035                                | 4              | 3                        | 0,00                              | <b>RMAC Securities PLC</b>                                 |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 25.04.2037                                | 1.468          | 677                      | 0,02                              | 4,804 % fällig am 12.06.2044                               | \$ 2.516       | 2.457                    | 0,08                              |                                      |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037                                | 199            | 92                       | 0,00                              | <b>Sapphire Trust Central Finance</b>                      |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 6,439 % fällig am 25.11.2035                                | 4              | 4                        | 0,00                              | 4,585 % fällig am 14.01.2066                               | AUD 61         | 40                       | 0,00                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust</b>       |                |                          |                                   | 5,005 % fällig am 14.01.2066                               | 4.200          | 2.759                    | 0,09                              |                                      |                |                          |                                   |
| 4,774 % fällig am 25.06.2035                                | 110            | 106                      | 0,00                              | <b>Shamrock Residential DAC</b>                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Credit Suisse Mortgage Capital Certificates</b>          |                |                          |                                   | 2,899 % fällig am 24.06.2071                               | € 10.983       | 12.897                   | 0,42                              |                                      |                |                          |                                   |
| 6,344 % fällig am 15.07.2032                                | 15.277         | 15.192                   | 0,49                              | <b>Southern Pacific Securities PLC</b>                     |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust</b> |                |                          |                                   | 2,489 % fällig am 10.03.2044                               | 1.243          | 1.448                    | 0,05                              |                                      |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036                                | 2.381          | 516                      | 0,02                              | <b>Stratton BTL Mortgage Funding PLC</b>                   |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>EMF-UK PLC</b>                                           |                |                          |                                   | 5,298 % fällig am 20.01.2054                               | £ 3.000        | 4.094                    | 0,13                              |                                      |                |                          |                                   |
| 5,338 % fällig am 13.03.2046                                | £ 413          | 565                      | 0,02                              | <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                       |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 6,178 % fällig am 13.03.2046                                | 5.248          | 7.090                    | 0,23                              | 5,139 % fällig am 28.06.2050                               | 6.464          | 8.868                    | 0,29                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Eurosail PLC</b>                                         |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 25.06.2049                               | 11.837         | 16.239                   | 0,53                              |                                      |                |                          |                                   |
| 2,409 % fällig am 10.09.2044                                | € 2.171        | 2.516                    | 0,08                              | 5,989 % fällig am 20.06.2060                               | 8.000          | 10.973                   | 0,35                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>GreenPoint Mortgage Funding Trust</b>                    |                |                          |                                   | <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>      |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.05.2037                                | \$ 1.533       | 1.472                    | 0,05                              | 5,409 % fällig am 25.09.2034                               | \$ 145         | 140                      | 0,00                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>GS Mortgage-Backed Securities Trust</b>                  |                |                          |                                   | <b>TBW Mortgage-Backed Trust</b>                           |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 25.10.2057                                | 2.733          | 2.671                    | 0,09                              | 5,965 % fällig am 25.07.2037                               | 104            | 30                       | 0,00                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   | <b>Temple Quay PLC</b>                                     |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037                                | 132            | 96                       | 0,00                              | 5,793 % fällig am 24.07.2085                               | £ 7.789        | 10.682                   | 0,35                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                       |                |                          |                                   | <b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>                 |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,812 % fällig am 19.09.2037                                | 1.338          | 1.153                    | 0,04                              | 4,963 % fällig am 25.12.2042                               | \$ 55          | 51                       | 0,00                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>HomeBanc Mortgage Trust</b>                              |                |                          |                                   | <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                     |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 5,244 % fällig am 25.10.2035                                | 100            | 96                       | 0,00                              | 5,223 % fällig am 20.07.2053                               | £ 23.332       | 32.044                   | 1,04                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>                 |                |                          |                                   | 5,637 % fällig am 20.02.2054                               | 12.740         | 17.509                   | 0,57                              |                                      |                |                          |                                   |
| 5,154 % fällig am 25.08.2035                                | 291            | 281                      | 0,01                              | 6,698 % fällig am 20.07.2053                               | 600            | 829                      | 0,03                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>                      |                |                          |                                   | 7,798 % fällig am 20.07.2053                               | 600            | 831                      | 0,03                              |                                      |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.03.2036                                | 2.371          | 1.999                    | 0,06                              | 8,798 % fällig am 20.07.2053                               | 600            | 831                      | 0,03                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>  |                |                          |                                   | <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 6,659 % fällig am 15.02.2035                                | 2.509          | 2.379                    | 0,08                              | 5,117 % fällig am 20.05.2066                               | 2.403          | 3.299                    | 0,11                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Jubilee Place BV</b>                                     |                |                          |                                   | <b>Trinity Square PLC</b>                                  |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 2,724 % fällig am 18.09.2062                                | € 8.926        | 10.484                   | 0,34                              | 5,217 % fällig am 15.07.2059                               | 14.100         | 19.369                   | 0,63                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Jupiter Mortgage PLC</b>                                 |                |                          |                                   | 5,617 % fällig am 15.07.2059                               | 3.017          | 4.132                    | 0,13                              |                                      |                |                          |                                   |
| 7,298 % fällig am 20.07.2055                                | £ 2.500        | 3.460                    | 0,11                              | <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>       |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Kinbane DAC</b>                                          |                |                          |                                   | 4,376 % fällig am 25.02.2037                               | \$ 587         | 543                      | 0,02                              |                                      |                |                          |                                   |
| 2,739 % fällig am 25.09.2062                                | € 11.691       | 13.913                   | 0,45                              | 5,194 % fällig am 25.01.2045                               | 53             | 53                       | 0,00                              |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Landmark Mortgage Securities PLC</b>                     |                |                          |                                   | <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through</b>             |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 3,101 % fällig am 17.06.2038                                | 865            | 1.007                    | 0,03                              | <b>Certificates Trust</b>                                  |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,558 % fällig am 17.06.2039                                | £ 4.334        | 5.848                    | 0,19                              | 6,000 % fällig am 25.04.2037                               | 3.895          | 3.213                    | 0,10                              |                                      |                |                          |                                   |
| 4,711 % fällig am 17.04.2044                                | 1.995          | 2.653                    | 0,09                              | <b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>                  |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Lehman Mortgage Trust</b>                                |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 25.07.2037                               | 2.907          | 2.605                    | 0,08                              |                                      |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036                                | \$ 127         | 60                       | 0,00                              | <b>Winchester PLC</b>                                      |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Lehman XS Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 5,188 % fällig am 21.10.2056                               | £ 9.199        | 12.627                   | 0,41                              |                                      |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.08.2046                                | 5.695          | 5.476                    | 0,18                              |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Luminent Mortgage Trust</b>                              |                |                          |                                   |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,509 % fällig am 25.04.2036                                | 3.023          | 2.009                    | 0,06                              |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>               |                |                          |                                   |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 5,124 % fällig am 25.08.2036                                | 1.533          | 1.528                    | 0,05                              |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Merrion Square Residential DAC</b>                       |                |                          |                                   |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 2,999 % fällig am 24.03.2081                                | € 18.034       | 21.196                   | 0,69                              |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>MortgageIT Trust</b>                                     |                |                          |                                   |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 4,954 % fällig am 25.12.2035                                | \$ 10          | 10                       | 0,00                              |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| <b>Mortimer BTL PLC</b>                                     |                |                          |                                   |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |
| 5,689 % fällig am 23.06.2053                                | £ 1.000        | 1.371                    | 0,04                              |                                                            |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| New Century Home Equity Loan Trust                                     |                |                          |                                   | Fair Oaks Loan Funding DAC                   |                |                          |                                   | 4,839 % fällig am 25.04.2036                       | 1.000          | 778                      | 0,03                              |
| 5,154 % fällig am 25.10.2035                                           | \$ 3.893       | \$ 3.827                 | 0,12                              | 3,159 % fällig am 15.04.2034                 | € 9.100        | \$ 10.661                | 0,35                              |                                                    |                |                          |                                   |
| NovaStar Mortgage Funding Trust                                        |                |                          |                                   | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.01.2037                                           | 3.108          | 1.029                    | 0,03                              | 2,949 % fällig am 25.02.2034                 | 10.208         | 12.025                   | 0,39                              | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
| 6,009 % fällig am 25.12.2034                                           | 2.543          | 2.455                    | 0,08                              | Golub Capital Partners CLO Ltd.              | \$ 7.200       | 7.208                    | 0,23                              | Lehman XS Trust                                    | \$ 1.221       | \$ 1.093                 | 0,04                              |
| Option One Mortgage Loan Trust                                         |                |                          |                                   | Hayfin Emerald CLO DAC                       | € 13.100       | 15.360                   | 0,50                              | 4,954 % fällig am 25.05.2046                       |                |                          |                                   |
| 4,684 % fällig am 25.03.2037                                           | 4.558          | 2.252                    | 0,07                              | 3,337 % fällig am 17.11.2037                 | 21.000         | 24.697                   | 0,80                              | 6,500 % fällig am 25.06.2046                       | 44             | 38                       | 0,00                              |
| 5,199 % fällig am 25.08.2035                                           | 1.188          | 1.160                    | 0,04                              | 3,586 % fällig am 18.07.2038                 | 7.700          | 9.051                    | 0,29                              | 6,734 % fällig am 25.12.2037                       | 1.651          | 1.610                    | 0,05                              |
| 5,859 % fällig am 25.11.2034                                           | 599            | 651                      | 0,02                              | 3,898 % fällig am 25.01.2037                 |                |                          |                                   | Residential Asset Mortgage Products Trust          | 2.000          | 1.993                    | 0,06                              |
| Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-<br>Through Certificates |                |                          |                                   | Henley CLO DAC                               | 3.200          | 3.752                    | 0,12                              | 5,514 % fällig am 25.03.2035                       |                |                          |                                   |
| 6,009 % fällig am 25.02.2035                                           | 4.988          | 4.911                    | 0,16                              | 3,148 % fällig am 25.04.2034                 |                |                          |                                   | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust | 1.396          | 763                      | 0,02                              |
| 6,309 % fällig am 25.09.2034                                           | 1.934          | 1.895                    | 0,06                              | Holland Park CLO DAC                         | 4.902          | 5.750                    | 0,19                              | 4,634 % fällig am 25.11.2037                       |                |                          |                                   |
| People's Choice Home Loan Securities Trust                             |                |                          |                                   | 3,059 % fällig am 14.11.2032                 |                |                          |                                   |                                                    | 6.275          | 0,20                     |                                   |
| 6,459 % fällig am 25.10.2034                                           | 477            | 403                      | 0,01                              | Indigo Credit Management DAC                 | 18.300         | 21.521                   | 0,70                              |                                                    | 658.630        | 21,30                    |                                   |
| Renaissance Home Equity Loan Trust                                     |                |                          |                                   | 3,479 % fällig am 15.07.2038                 |                |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                                   |                |                          |                                   |
| 5,580 % fällig am 25.11.2036                                           | 1.235          | 399                      | 0,01                              | Invesco Euro CLO DAC                         | 6.559          | 7.689                    | 0,25                              | Argentina Government International Bond            |                |                          |                                   |
| Soundview Home Loan Trust                                              |                |                          |                                   | 2,929 % fällig am 15.07.2031                 |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 09.07.2030                       | 2.197          | 1.607                    | 0,05                              |
| 4,674 % fällig am 25.11.2036                                           | 10.585         | 2.881                    | 0,09                              | Latitude Australia Personal Loans Series     |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 09.07.2029                       | 108            | 90                       | 0,00                              |
| Structured Asset Investment Loan Trust                                 |                |                          |                                   | 4,721 % fällig am 17.09.2033 AUD             | 21.249         | 13.924                   | 0,45                              | 3,500 % fällig am 09.07.2041                       | 3.463          | 2.156                    | 0,07                              |
| 5,154 % fällig am 25.01.2036                                           | 303            | 294                      | 0,01                              | Lyra Music Assets Delaware LP                | \$ 23.167      | 23.298                   | 0,75                              | 4,125 % fällig am 09.07.2035                       | 1.732          | 1.145                    | 0,04                              |
| 5,434 % fällig am 25.09.2034                                           | 1.703          | 1.659                    | 0,05                              | 5,760 % fällig am 22.12.2064                 |                |                          |                                   | Australia Government International Bond            | 2.500          | 891                      | 0,03                              |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                  |                |                          |                                   | Madison Park Euro Funding DAC                | € 1.895        | 2.219                    | 0,07                              | 1,750 % fällig am 21.06.2051 AUD                   |                |                          |                                   |
| 4,664 % fällig am 25.05.2047                                           | 133            | 130                      | 0,00                              | 3,079 % fällig am 15.07.2032                 |                |                          |                                   | Egypt Government International Bond                | 428.000        | 8.521                    | 0,28                              |
| 4,834 % fällig am 25.06.2037                                           | 6.943          | 4.601                    | 0,15                              | Man Euro CLO DAC                             | 7.600          | 8.946                    | 0,29                              | 21,954 % fällig am 04.03.2028 EGP                  |                |                          |                                   |
| 5,409 % fällig am 25.05.2035                                           | 2.900          | 2.840                    | 0,09                              | 4,029 % fällig am 15.10.2036                 |                |                          |                                   | Israel Government International Bond               |                |                          |                                   |
| Terwin Mortgage Trust                                                  |                |                          |                                   | Nassau Ltd.                                  | \$ 2.280       | 2.283                    | 0,07                              | 2,750 % fällig am 03.07.2030                       | \$ 4.100       | 3.719                    | 0,12                              |
| 5,814 % fällig am 25.03.2035                                           | 406            | 402                      | 0,01                              | 5,668 % fällig am 15.07.2031                 |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 19.02.2030                       | 17.700         | 18.060                   | 0,58                              |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust                  |                |                          |                                   | Navient Private Education Loan Trust         | 283            | 280                      | 0,01                              | Japan Government International Bond                |                |                          |                                   |
| 5,184 % fällig am 25.12.2035                                           | 344            | 343                      | 0,01                              | 4,100 % fällig am 16.12.2058                 |                |                          |                                   | 2,400 % fällig am 20.03.2045                       | ¥ 284.000      | 1.979                    | 0,06                              |
| 6,159 % fällig am 25.11.2035                                           | 2.385          | 2.384                    | 0,08                              | Nelnet Student Loan Trust                    | 1.025          | 1.025                    | 0,03                              | 2,400 % fällig am 20.03.2055                       | 74.000         | 471                      | 0,01                              |
|                                                                        |                | 109.606                  | 3,55                              | 4,874 % fällig am 27.09.2066                 |                |                          |                                   | Peru Government International Bond                 |                |                          |                                   |
| HYPOTHEKEN SEQUENTIELL                                                 |                |                          |                                   | Oak Hill European Credit Partners DAC        | € 934          | 1.096                    | 0,04                              | 5,350 % fällig am 12.08.2040 PEN                   | 1.522          | 369                      | 0,01                              |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                      |                |                          |                                   | 2,966 % fällig am 20.01.2032                 |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 12.08.2032                       | 4.088          | 1.192                    | 0,04                              |
| 3,114 % fällig am 25.01.2037                                           | 13.459         | 3.717                    | 0,12                              | Ocean Trails CLO                             | \$ 1.000       | 1.001                    | 0,03                              | Romania Government International Bond              | € 1.700        | 1.532                    | 0,05                              |
| Saxon Asset Securities Trust                                           |                |                          |                                   | 5,556 % fällig am 15.10.2034                 |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 14.04.2033                       | 1.200          | 1.205                    | 0,04                              |
| 4,774 % fällig am 25.10.2046                                           | 2.267          | 2.225                    | 0,07                              | Palmer Square BDC CLO Ltd.                   | 8.700          | 8.733                    | 0,28                              | 3,750 % fällig am 07.02.2034                       | 14.700         | 17.640                   | 0,57                              |
|                                                                        |                | 5.942                    | 0,19                              | 5,856 % fällig am 15.07.2037                 |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 10.03.2030                       | 4.230          | 4.893                    | 0,16                              |
| ABS SONSTIGE                                                           |                |                          |                                   | Palmer Square European Loan Funding DAC      | € 1.296        | 1.518                    | 0,05                              | 5,250 % fällig am 30.05.2032                       | 1.210          | 1.427                    | 0,05                              |
| AlbaCore Euro CLO DAC                                                  |                |                          |                                   | 2,999 % fällig am 15.10.2031                 |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 11.07.2032                       | 2.300          | 2.727                    | 0,09                              |
| 3,269 % fällig am 15.07.2035                                           | € 18.400       | 21.628                   | 0,70                              | 3,133 % fällig am 15.05.2034                 | 16.357         | 19.187                   | 0,62                              | Russia Government International Bond               | \$ 600         | 0                        | 0,00                              |
| Arbour CLO DAC                                                         |                |                          |                                   | 3,170 % fällig am 15.10.2034                 | 14.800         | 17.325                   | 0,56                              | 5,250 % fällig am 23.06.2047                       |                |                          |                                   |
| 2,795 % fällig am 15.09.2031                                           | 2.706          | 3.177                    | 0,10                              | 3,843 % fällig am 15.08.2033                 | 1.500          | 1.765                    | 0,06                              | Saudi Arabia Government International Bond         | € 1.100        | 1.287                    | 0,04                              |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                                           |                |                          |                                   | 4,033 % fällig am 15.05.2034                 | 600            | 706                      | 0,02                              | 3,750 % fällig am 05.03.2037 (h)                   | 1.600          | 1.831                    | 0,06                              |
| 5,359 % fällig am 21.10.2034                                           | \$ 10.400      | 10.411                   | 0,34                              | Pepper Iberia Consumer                       | 4.500          | 5.277                    | 0,17                              | Serbia Government International Bond               | 11.200         | 13.101                   | 0,42                              |
| 5,469 % fällig am 20.10.2034                                           | 9.600          | 9.623                    | 0,31                              | 2,789 % fällig am 25.04.2037                 |                |                          |                                   | 3,125 % fällig am 15.05.2027                       |                |                          |                                   |
| Ballyrock CLO Ltd.                                                     |                |                          |                                   | Sculptor European CLO DAC                    | 2.418          | 2.836                    | 0,09                              | Turkey Government International Bond               | \$ 1.000       | 953                      | 0,03                              |
| 5,792 % fällig am 25.07.2037                                           | 5.100          | 5.132                    | 0,17                              | 3,055 % fällig am 14.01.2032                 |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 13.03.2030                       | 741            | 557                      | 0,02                              |
| Barings Euro CLO DAC                                                   |                |                          |                                   | 2,708 % fällig am 25.07.2039                 | 1.076          | 1.192                    | 0,04                              | 5,750 % fällig am 11.05.2047                       | 11.400         | 275                      | 0,01                              |
| 3,239 % fällig am 15.10.2034                                           | € 15.000       | 17.506                   | 0,57                              | SMB Private Education Loan Trust             | \$ 550         | 535                      | 0,02                              | 47,469 % fällig am 06.09.2028 TRY                  | 1.100          | 28                       | 0,00                              |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.                               |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 16.12.2041                 |                |                          |                                   | 49,053 % fällig am 20.05.2026                      | 800            | 20                       | 0,00                              |
| 5,699 % fällig am 11.04.2045                                           | \$ 5.000       | 4.997                    | 0,16                              | Sound Point CLO Ltd.                         |                |                          |                                   | 49,053 % fällig am 19.08.2026                      | 176.800        | 4.310                    | 0,14                              |
| 5,709 % fällig am 11.04.2045                                           | 5.000          | 4.999                    | 0,16                              | 5,518 % fällig am 15.04.2031                 | 1.241          | 1.242                    | 0,04                              | 49,053 % fällig am 17.05.2028                      |                |                          |                                   |
| 5,781 % fällig am 11.04.2043                                           | 1.656          | 1.654                    | 0,05                              | St. Paul's CLO DAC                           | € 10.618       | 12.471                   | 0,40                              | Venezuela Government International Bond            | \$ 2.000       | 329                      | 0,01                              |
| 5,806 % fällig am 11.04.2043                                           | 5.150          | 5.149                    | 0,17                              | 2,988 % fällig am 25.04.2030                 | 9.725          | 11.365                   | 0,37                              | 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^                     | 1.600          | 258                      | 0,01                              |
| Blackrock European CLO DAC                                             |                |                          |                                   | 3,113 % fällig am 17.01.2032                 | 12.700         | 14.869                   | 0,48                              | 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^                     |                |                          |                                   |
| 3,116 % fällig am 19.07.2035                                           | € 12.700       | 14.843                   | 0,48                              | 3,138 % fällig am 25.10.2035                 |                |                          |                                   |                                                    | 92.573         | 2,99                     |                                   |
| 3,156 % fällig am 20.01.2036                                           | 4.500          | 5.271                    | 0,17                              | Taco Bell Funding LLC                        | \$ 16.408      | 15.653                   | 0,51                              | STAMMAKTIONEN                                      |                |                          |                                   |
| BlueMountain EUR CLO DAC                                               |                |                          |                                   | 1,946 % fällig am 25.08.2051                 |                |                          |                                   | KOMMUNIKATIONSDIENSTE                              |                |                          |                                   |
| 3,279 % fällig am 15.10.2035                                           | 2.100          | 2.458                    | 0,08                              | TIAA CLO Ltd.                                | 442            | 443                      | 0,01                              | Clear Channel Outdoor                              | 173.174        | 203                      | 0,01                              |
| Bosphorus CLO DAC                                                      |                |                          |                                   | 5,672 % fällig am 16.01.2031                 |                |                          |                                   | Holdings, Inc. (b)                                 | 41.444         | 73                       | 0,00                              |
| 2,964 % fällig am 12.12.2032                                           | 417            | 490                      | 0,02                              | Toro European CLO DAC                        | € 1.381        | 1.616                    | 0,05                              | iHeartMedia, Inc. 'A' (b)                          | 32.182         | 50                       | 0,00                              |
| Castlelake Aircraft Structured Trust                                   |                |                          |                                   | 2,953 % fällig am 15.02.2034                 |                |                          |                                   | iHeartMedia, Inc. 'B' (b)                          | 45.580         | 1.572                    | 0,05                              |
| 5,783 % fällig am 15.02.2050                                           | \$ 7.009       | 7.117                    | 0,23                              | Trinitas CLO Ltd.                            | \$ 11.100      | 11.045                   | 0,36                              | Intelsat Emergence S.A. (g)                        | 361            | 7                        | 0,00                              |
| College Avenue Student Loans LLC                                       |                |                          |                                   | 5,309 % fällig am 20.07.2035                 |                |                          |                                   | Windstream Holdings, Inc. (b)                      |                | 1.905                    | 0,06                              |
| 4,130 % fällig am 26.12.2047                                           | 13             | 13                       | 0,00                              | Voya Euro CLO DAC                            | € 12.700       | 14.896                   | 0,48                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,634 % fällig am 26.12.2047                                           | 13             | 13                       | 0,00                              | 3,249 % fällig am 15.10.2034                 |                |                          |                                   | FINANZWERTE                                        |                |                          |                                   |
| Cumulus Static CLO DAC                                                 |                |                          |                                   | Wind River CLO Ltd.                          | \$ 84          | 84                       | 0,00                              | Adler Group S.A. (b)                               | 1.601.197      | 0                        | 0,00                              |
| 3,343 % fällig am 15.11.2033                                           | € 9.562        | 11.253                   | 0,36                              | 5,581 % fällig am 18.07.2031                 |                |                          |                                   | GESUNDHEITSWESSEN                                  |                |                          |                                   |
| CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC                                 |                |                          |                                   |                                              | 452.404        | 14,63                    |                                   | AMSURG Corp. (b)(g)                                | 45.588         | \$ 2.058                 | 0,07                              |
| 2,983 % fällig am 15.08.2033                                           | 8.340          | 9.761                    | 0,32                              | SICHERHEITEN WHOLE LOANS                     |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| DB Master Finance LLC                                                  |                |                          |                                   | First Franklin Mortgage Loan Trust           |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 2,045 % fällig am 20.11.2051                                           | \$ 2.027       | 1.952                    | 0,06                              |                                              |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

|                                             |               |                    | % DES              |  |                                                        |               |                    | % DES              |  |
|---------------------------------------------|---------------|--------------------|--------------------|--|--------------------------------------------------------|---------------|--------------------|--------------------|--|
| BESCHREIBUNG                                | AKTIEN        | MARKT- WERT (000S) | NETTO- VERMÖ- GENS |  | BESCHREIBUNG                                           | PARI (000S)   | MARKT- WERT (000S) | NETTO- VERMÖ- GENS |  |
| INDUSTRIEWERTE                              |               |                    |                    |  |                                                        |               |                    |                    |  |
| Westmoreland Mining LLC (b)(g)              | 298           | \$ 0               | 0,00               |  | 30,864 % fällig am 26.06.2026 (c)(d)                   | NGN 4.214.971 | \$ 2.216           | 0,07               |  |
|                                             |               | 3.963              | 0,13               |  | 33,126 % fällig am 12.06.2026 (c)(d)                   | 2.892.000     | 1.532              | 0,05               |  |
| OPTIONSSCHEINE                              |               |                    |                    |  | 33,156 % fällig am 11.06.2026 (c)(d)                   | 2.894.800     | 1.534              | 0,05               |  |
| Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17.02.2027   | 661           | 1                  | 0,00               |  | Summe kurzfristige Instrumente                         |               | 7.707              | 0,25               |  |
| Windstream Holdings, Inc. - Exp. 08.04.2060 | 71            | 2                  | 0,00               |  | Summe Übertragbare Wertpapiere                         |               | \$ 3.863.260       | 124,93             |  |
|                                             |               | 3                  | 0,00               |  | AKTIEN                                                 |               |                    |                    |  |
| REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS               |               |                    |                    |  | INVESTMENTFONDS                                        |               |                    |                    |  |
| Uniti Group, Inc.                           | 247           | 1                  | 0,00               |  | ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN                      |               |                    |                    |  |
|                                             |               |                    |                    |  | PIMCO Select Funds                                     |               |                    |                    |  |
|                                             |               | PARI (000S)        |                    |  | plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) |               |                    |                    |  |
| KURZFRISTIGE INSTRUMENTE                    |               |                    |                    |  |                                                        | 29.722.149    | 296.382            | 9,58               |  |
| NIGERIA TREASURY BILLS                      |               |                    |                    |  | Summe Investmentfonds                                  |               | \$ 296.382         | 9,58               |  |
| 30,612 % fällig am 29.06.2026 (c)(d)        | NGN 4.618.817 | 2.425              | 0,08               |  |                                                        |               |                    |                    |  |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kredit- zins | Abrechnungs- datum | Fälligkeits- datum | Kapital- betrag | Besichert durch                                                   | Sicherheiten (erhalten) | Pensions- geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions- geschäft <sup>(1)</sup> | % des Netto- vermögens |
|-------------------------|--------------|--------------------|--------------------|-----------------|-------------------------------------------------------------------|-------------------------|-------------------------------|------------------------------------------------------------|------------------------|
| BOS                     | 4,480 %      | 30.06.2025         | 01.07.2025         | \$ 47.400       | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027                  | \$ (48.433)             | \$ 47.400                     | \$ 47.406                                                  | 1,53                   |
| BPS                     | 4,430        | 30.06.2025         | 01.07.2025         | 100             | U.S. Treasury Notes 1,625 % fällig am 15.05.2031                  | (102)                   | 100                           | 100                                                        | 0,00                   |
| CEW                     | 2,710        | 24.06.2025         | 08.07.2025         | CAD 50.000      | Province of Alberta 3,050 % fällig am 01.12.2048                  | (37.419)                | 36.643                        | 36.695                                                     | 1,18                   |
|                         | 2,720        | 26.06.2025         | 10.07.2025         | 10.000          | Province of Ontario 3,750 % fällig am 02.06.2032                  | (7.516)                 | 7.329                         | 7.339                                                      | 0,24                   |
|                         | 2,720        | 27.06.2025         | 07.07.2025         | 230.000         | Province of Quebec 3,250 % - 3,500 % fällig 01.09.2032-01.12.2045 | (172.838)               | 168.560                       | 168.731                                                    | 5,45                   |
|                         | 2,720        | 30.06.2025         | 09.07.2025         | 40.000          | Province of Ontario 3,750 % fällig am 02.12.2053                  | (30.202)                | 29.315                        | 29.342                                                     | 0,95                   |
|                         | 2,730        | 24.06.2025         | 08.07.2025         | 80.000          | Province of Alberta 3,050 % fällig am 01.12.2048                  | (24.402)                | 58.630                        | 58.713                                                     | 1,90                   |
| FICC                    | 2,730        | 25.06.2025         | 03.07.2025         | 140.000         | Province of British Columbia 4,250% fällig 18.12.2053             | (35.475)                |                               |                                                            |                        |
|                         | 4,400        | 30.06.2025         | 01.07.2025         | \$ 24.000       | Province of Quebec 4,200 % fällig am 01.12.2057                   | (104.940)               | 102.602                       | 102.685                                                    | 3,32                   |
| MEI                     | 2,680        | 24.06.2025         | 08.07.2025         | CAD 50.000      | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027                  | (24.675)                | 24.000                        | 24.003                                                     | 0,78                   |
|                         |              |                    |                    |                 | Canada Government International Bond 1,250 % fällig am 01.06.2030 | (37.450)                | 36.643                        | 36.695                                                     | 1,18                   |
| Summe Pensionsgeschäfte |              |                    |                    |                 |                                                                   | \$ (523.452)            | \$ 511.222                    | \$ 511.709                                                 | 16,53                  |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablauf- monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto- vermögens |
|------------------------------------------------------|-------|---------------|----------------------|-------------------------------------------|------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Short | 03.2026       | 23                   | \$ 87                                     | 0,00                   |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Short | 09.2025       | 245                  | 580                                       | 0,02                   |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Short | 06.2026       | 21                   | 64                                        | 0,00                   |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Short | 12.2025       | 17                   | 79                                        | 0,00                   |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures  | Long  | 09.2025       | 246                  | 149                                       | 0,01                   |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025       | 120                  | 69                                        | 0,00                   |
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025       | 130                  | 143                                       | 0,01                   |
| Euro-Schatz September Futures                        | Short | 09.2025       | 239                  | 46                                        | 0,00                   |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025       | 2.100                | 2.430                                     | 0,08                   |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025       | 4.035                | 8.031                                     | 0,26                   |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025       | 141                  | (356)                                     | (0,01)                 |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025       | 478                  | (1.929)                                   | (0,06)                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025       | 85                   | 303                                       | 0,01                   |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025       | 962                  | 2.830                                     | 0,09                   |
|                                                      |       |               |                      | \$ 12.526                                 | 0,41                   |

**VERKAUFSOPTIONEN****FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung                                                   | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld  | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|----------------------------------------------------------------|----------------|----------------|----------------------|----------|------------|-----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500     | 25.07.2025     | 65                   | \$ (22)  | \$ (2)     | 0,00                  |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000        | 25.07.2025     | 110                  | (43)     | (3)        | 0,00                  |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250        | 25.07.2025     | 66                   | (16)     | (8)        | 0,00                  |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000        | 25.07.2025     | 65                   | (22)     | (49)       | 0,00                  |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500        | 25.07.2025     | 110                  | (45)     | (58)       | (0,01)                |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750        | 25.07.2025     | 66                   | (20)     | (29)       | 0,00                  |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 129,000      | 25.07.2025     | 17                   | (8)      | (7)        | 0,00                  |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500        | 25.07.2025     | 17                   | (9)      | (3)        | 0,00                  |
|                                                                |                |                |                      | \$ (185) | \$ (159)   | (0,01)                |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |                |                |                      |          | \$ 12.367  | 0,40                  |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|-----------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------------|-----------------------|
| Ford Motor Co.  | (5,000) %                   | 20.06.2026        | \$ 100                     | \$ 1                                     | 0,00                  |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

| Referenzeinheit              | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------------|-----------------------|
| Airbus Finance BV            | 1,000 %                     | 20.12.2025        | € 7.600                    | \$ 128                                   | 0,01                  |
| Airbus Finance BV            | 1,000                       | 20.06.2026        | 3.100                      | (52)                                     | 0,00                  |
| Airbus Finance BV            | 1,000                       | 20.06.2028        | 200                        | 1                                        | 0,00                  |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                       | 20.12.2025        | \$ 11.200                  | (49)                                     | 0,00                  |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                       | 20.06.2026        | 1.500                      | (12)                                     | 0,00                  |
| AT&T, Inc.                   | 1,000                       | 20.06.2028        | 600                        | 13                                       | 0,00                  |
| Ford Motor Credit Co. LLC    | 5,000                       | 20.06.2027        | 200                        | 4                                        | 0,00                  |
| General Electric Co.         | 1,000                       | 20.06.2026        | 4.700                      | 8                                        | 0,00                  |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                       | 20.12.2025        | € 2.400                    | (1)                                      | 0,00                  |
| Rolls-Royce PLC              | 1,000                       | 20.06.2027        | 1.100                      | 123                                      | 0,00                  |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.06.2026        | \$ 3.000                   | (46)                                     | 0,00                  |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.12.2026        | 400                        | (6)                                      | 0,00                  |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.06.2028        | 3.400                      | 63                                       | 0,00                  |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.12.2028        | 900                        | 18                                       | 0,00                  |
|                              |                             |                   |                            | \$ 192                                   | 0,01                  |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------------|-----------------------|
| CDX.EM-34 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.12.2025        | \$ 1.196                   | \$ 50                                    | 0,00                  |
| CDX.EM-36 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2026        | 9.108                      | 457                                      | 0,02                  |
| CDX.EM-38 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2027        | 800                        | 70                                       | 0,00                  |
| CDX.EM-39 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2028        | 100                        | 7                                        | 0,00                  |
| CDX.EM-40 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2028        | 3.000                      | 129                                      | 0,00                  |
| CDX.EM-41 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2029        | 600                        | 18                                       | 0,00                  |
| CDX.EM-42 5-Year Index | 1,000                       | 20.12.2029        | 700                        | 10                                       | 0,00                  |
| CDX.EM-43 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2030        | 600                        | 7                                        | 0,00                  |
| CDX.HY-36 5-Year Index | 5,000                       | 20.06.2026        | 5.664                      | (315)                                    | (0,01)                |
| CDX.HY-37 5-Year Index | 5,000                       | 20.12.2026        | 2.208                      | (8)                                      | 0,00                  |
| CDX.HY-39 5-Year Index | 5,000                       | 20.12.2027        | 485                        | 24                                       | 0,00                  |
| CDX.HY-40 5-Year Index | 5,000                       | 20.06.2028        | 294                        | 20                                       | 0,00                  |
| CDX.HY-41 5-Year Index | 5,000                       | 20.12.2028        | 99                         | 2                                        | 0,00                  |
| CDX.HY-43 5-Year Index | 5,000                       | 20.12.2029        | 16.000                     | 50                                       | 0,00                  |
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000                       | 20.06.2030        | 56.300                     | 1.554                                    | 0,05                  |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2030        | 1.900                      | 10                                       | 0,00                  |
|                        |                             |                   |                            | \$ 2.085                                 | 0,06                  |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------|-------------------|-------------|------------------------------------------|-----------------------|
| Zahlung                           | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %         | 19.03.2030        | £ 30.500    | \$ 158                                   | 0,01                  |
| Erhalt                            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,700           | 28.03.2034        | 1.400       | 39                                       | 0,00                  |
| Erhalt                            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,750           | 19.03.2055        | 1.800       | 77                                       | 0,00                  |
| Erhalt                            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000           | 15.03.2029        | ¥ 8.473.000 | 1.326                                    | 0,04                  |
| Zahlung                           | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,176           | 27.04.2027        | 550.000     | (39)                                     | 0,00                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400 %            | 15.06.2032            | ¥ 1.467.200     | \$ 426                                          | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500              | 15.03.2042            | 702.000         | 657                                             | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,700              | 18.09.2029            | 7.040.000       | 128                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,711              | 27.04.2042            | 130.000         | 136                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000              | 18.09.2034            | 3.620.000       | 43                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,250              | 18.06.2035            | 732.000         | 137                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,500              | 16.06.2026            | \$ 88.900       | 1.223                                           | 0,04                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,500              | 16.06.2028            | 10.869          | (436)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,928              | 06.05.2026            | 2.200           | 76                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,940              | 08.06.2026            | 2.900           | 93                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000              | 15.06.2027            | 3.600           | 31                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000              | 15.06.2029            | 4.070           | 129                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000              | 16.12.2030            | 20.713          | 3.391                                           | 0,11                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,030              | 17.06.2026            | 3.600           | 112                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,235              | 12.05.2028            | 1.100           | 81                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 17.06.2030            | 4.400           | 275                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 15.06.2032            | 22.690          | (1.420)                                         | (0,05)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 16.12.2050            | 12.600          | 4.895                                           | 0,16                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 16.06.2051            | 8.700           | 2.836                                           | 0,09                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,317              | 16.12.2050            | 400             | (180)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,360              | 15.02.2027            | 6.700           | 272                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,360              | 20.07.2031            | 1.400           | 190                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,370              | 19.07.2031            | 900             | 122                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,380              | 04.01.2027            | 3.600           | (142)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,418              | 20.01.2027            | 1.300           | (50)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,425              | 18.01.2027            | 2.500           | (93)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,438              | 22.01.2051            | 9.000           | (3.991)                                         | (0,13)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450              | 17.02.2027            | 6.300           | 242                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450              | 16.07.2031            | 2.000           | 266                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500              | 15.12.2028            | 7.919           | (741)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500              | 18.12.2029            | 1.200           | 73                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500              | 17.06.2050            | 7.700           | 4.480                                           | 0,15                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,518              | 20.01.2029            | 800             | (58)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,570              | 12.01.2027            | 1.400           | (49)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,580              | 16.02.2027            | 2.800           | (94)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,580              | 13.01.2051            | 9.300           | (3.969)                                         | (0,13)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,600              | 16.01.2026            | 17.200          | 239                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,600              | 15.02.2027            | 26.800          | (870)                                           | (0,03)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,625              | 06.01.2030            | 300             | 32                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,630              | 26.01.2029            | 1.300           | (87)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,700              | 17.02.2027            | 25.000          | (745)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,730              | 24.02.2032            | 1.600           | (178)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.06.2029            | 3.538           | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.01.2030            | 4.600           | 437                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.06.2032            | 1.608           | 21                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.06.2052            | 28.100          | 6.729                                           | 0,22                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,765              | 16.03.2032            | 600             | (64)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,783              | 22.04.2027            | 2.100           | (67)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,785              | 12.08.2051            | 1.100           | 455                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,788              | 03.05.2027            | 2.300           | (72)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,815              | 24.01.2052            | 300             | (117)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,867              | 26.01.2052            | 300             | (114)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,910              | 17.10.2049            | 400             | 158                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,988              | 09.02.2032            | 1.100           | 109                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2027            | 2.100           | (54)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 10.12.2029            | 21.000          | 1.731                                           | 0,06                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2029            | 11.170          | (331)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 12.02.2030            | 2.500           | 221                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 10.03.2030            | 1.200           | 85                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2032            | 17.930          | 67                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,008              | 09.02.2032            | 1.900           | 189                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,250              | 12.03.2050            | 15.700          | 4.920                                           | 0,16                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,300              | 17.01.2026            | 12.300          | 241                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,385              | 08.06.2032            | 1.400           | 85                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,436              | 08.06.2032            | 6.800           | 397                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,450              | 04.10.2027            | 5.430           | 202                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,451              | 08.06.2032            | 8.700           | 502                                             | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,468              | 27.07.2028            | 1.500           | (36)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,537              | 24.07.2053            | 400             | (74)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,550              | 21.07.2053            | 400             | (73)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,590              | 23.07.2026            | 11.300          | 219                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,620              | 24.07.2025            | 15.900          | 216                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,675              | 24.07.2028            | 1.500           | (25)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,700              | 21.07.2028            | 1.500           | (24)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,900              | 04.10.2027            | 15.500          | (260)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 19.06.2026            | 12.700          | 624                                             | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 19.03.2030            | 52.030          | (1.111)                                         | (0,04)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2030            | 85.750          | 1.388                                           | 0,04                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2033            | 270             | (6)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2033            | 7.110           | 222                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,050              | 07.09.2027            | 1.400           | (22)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,050              | 06.09.2032            | 2.000           | (71)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,080              | 23.02.2053            | 1.200           | (168)                                           | (0,01)                       |



| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,231 %            | 18.09.2034            | \$ 5.700        | \$ 266                                          | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,232              | 10.09.2034            | 3.250           | 156                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,248              | 18.09.2034            | 5.700           | 257                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250              | 21.06.2028            | 850             | (12)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250              | 21.06.2028            | 42.970          | 184                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250              | 19.03.2032            | 36.840          | (703)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250              | 18.06.2032            | 5.190           | 23                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250              | 19.03.2055            | 45.200          | (989)                                           | (0,03)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300              | 28.02.2029            | 2.390           | 15                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300              | 30.06.2031            | 5.610           | 90                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300              | 06.03.2033            | 2.000           | (36)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300              | 15.11.2053            | 1.900           | 230                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,328              | 30.04.2031            | 1.870           | 17                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,350              | 14.12.2032            | 500             | 12                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,368              | 15.11.2049            | 820             | 83                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,370              | 01.03.2033            | 2.000           | (24)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,370              | 12.07.2053            | 2.800           | (287)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,375              | 15.10.2034            | 6.100           | (160)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,395              | 17.10.2034            | 10.900          | (268)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,400              | 23.02.2033            | 3.200           | (32)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,405              | 01.03.2033            | 2.100           | (20)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,410              | 05.09.2034            | 3.700           | 118                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,420              | 24.05.2033            | 7.600           | (58)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,430              | 27.02.2033            | 2.100           | (17)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,431              | 30.04.2031            | 3.070           | 10                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,446              | 23.10.2034            | 3.700           | (76)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,450              | 07.03.2033            | 3.900           | (28)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,450              | 11.10.2034            | 6.100           | (120)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,463              | 23.10.2034            | 6.600           | (125)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,464              | 15.11.2049            | 1.220           | 105                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,465              | 30.10.2034            | 13.700          | (253)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,481              | 29.10.2034            | 6.800           | (117)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,495              | 30.10.2034            | 6.400           | (102)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 21.06.2026            | 6.720           | 39                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 20.12.2030            | 10.970          | 15                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 20.12.2030            | 34.850          | (407)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 22.05.2033            | 29.710          | (465)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 21.06.2033            | 8.100           | (9)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 20.12.2033            | 600             | 33                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 20.12.2033            | 1.900           | (27)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 20.06.2054            | 19.500          | (96)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,510              | 30.11.2028            | 1.500           | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,514              | 04.09.2034            | 7.400           | 169                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,515              | 30.11.2028            | 2.360           | 3                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,515              | 06.11.2034            | 12.300          | (168)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,527              | 15.11.2049            | 540             | 41                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,532              | 20.08.2034            | 5.800           | 127                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,545              | 31.10.2030            | 4.100           | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,550              | 31.10.2030            | 8.300           | 7                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,555              | 05.03.2054            | 1.300           | (75)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,558              | 21.08.2034            | 6.600           | 128                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,569              | 14.08.2034            | 6.400           | 119                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,572              | 31.10.2030            | 9.000           | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,582              | 31.10.2030            | 16.400          | (16)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,594              | 09.01.2034            | 2.800           | 14                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,595              | 19.08.2034            | 6.300           | 104                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,600              | 17.01.2034            | 1.400           | 13                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,601              | 31.10.2030            | 8.300           | (17)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,602              | 31.10.2030            | 27.100          | (57)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,606              | 31.10.2030            | 8.400           | (19)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,610              | 12.12.2032            | 1.100           | 6                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,613              | 22.08.2034            | 5.800           | 86                                              | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620              | 30.11.2029            | 52.179          | (485)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,623              | 31.10.2030            | 9.000           | (29)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,645              | 07.08.2034            | 5.800           | 72                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,648              | 08.01.2034            | 2.700           | 15                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650              | 10.07.2033            | 4.600           | (13)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650              | 05.03.2034            | 3.400           | 14                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,664              | 31.10.2030            | 7.300           | (40)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,665              | 24.01.2034            | 2.600           | 12                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,670              | 08.01.2034            | 2.900           | 11                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,677              | 31.10.2030            | 5.900           | (37)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,679              | 13.08.2034            | 5.700           | 54                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,684              | 03.01.2034            | 1.300           | 3                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,685              | 24.01.2034            | 2.600           | 16                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,687              | 31.10.2030            | 7.600           | (52)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,691              | 31.10.2030            | 11.600          | (81)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700              | 06.06.2033            | 66.350          | 10                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,710              | 05.03.2034            | 3.300           | 27                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,721              | 31.10.2030            | 7.300           | (63)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,722              | 31.10.2030            | 7.300           | (64)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,725              | 07.02.2034            | 1.500           | 16                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,727              | 31.10.2030            | 7.300           | (66)                                            | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt    | variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|-----------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,730 %            | 03.08.2033            | \$ 1.400        | \$ 7                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,732              | 31.10.2030            | 4.900           | (45)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735              | 31.10.2030            | 7.300           | (69)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735              | 07.08.2033            | 1.600           | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735              | 23.01.2034            | 1.300           | 13                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,738              | 23.01.2034            | 800             | 8                                               | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,739              | 31.10.2030            | 7.300           | (71)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,749              | 31.10.2030            | 7.300           | (75)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2028            | 13.900          | 16                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2028            | 37.950          | (458)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2029            | 119.910         | (2.165)                                         | (0,07)                       |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2029            | 255.080         | 333                                             | 0,01                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2031            | 4.690           | (23)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2031            | 104.510         | 696                                             | 0,02                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2031            | 118.860         | (397)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup> |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 15.05.2032            | 51.340          | (734)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 12.07.2033            | 4.000           | 22                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 02.01.2034            | 1.300           | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2034            | 7.160           | 249                                             | 0,01                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2034            | 6.920           | 16                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2034            | 49.030          | (32)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 07.05.2035            | 9.100           | 90                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,783              | 07.02.2034            | 1.300           | 20                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,795              | 06.08.2034            | 5.800           | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800              | 10.03.2028            | 2.000           | 20                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800              | 22.08.2030            | 1.200           | 16                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,810              | 02.01.2034            | 1.300           | (10)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,840              | 08.01.2035            | 4.100           | 58                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,850              | 05.08.2034            | 6.100           | (29)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,854              | 29.12.2033            | 2.600           | (28)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,860              | 21.02.2034            | 6.200           | 128                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,865              | 20.11.2034            | 6.800           | 119                                             | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870              | 05.03.2035            | 2.300           | (26)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,874              | 05.03.2035            | 4.600           | (53)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,899              | 11.03.2035            | 7.500           | (103)                                           | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 30.08.2033            | 2.400           | 46                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 10.04.2034            | 3.100           | 73                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 15.04.2034            | 1.600           | 38                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 08.01.2035            | 4.100           | 80                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,908              | 04.03.2035            | 4.400           | (63)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,940              | 22.02.2029            | 9.100           | 179                                             | 0,01                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950              | 19.12.2033            | 2.900           | (53)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970              | 27.02.2029            | 3.100           | 64                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,994              | 02.07.2034            | 4.800           | (81)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,015              | 30.12.2034            | 7.000           | 208                                             | 0,01                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030              | 04.10.2033            | 4.900           | 151                                             | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030              | 15.12.2033            | 2.600           | (63)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,060              | 02.07.2034            | 3.400           | (76)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,071              | 15.01.2035            | 6.700           | 228                                             | 0,01                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,078              | 29.04.2034            | 3.300           | 121                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,080              | 17.04.2034            | 3.100           | 115                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,085              | 22.04.2034            | 3.100           | 118                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,090              | 30.04.2034            | 3.300           | 123                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,100              | 21.01.2035            | 3.400           | 125                                             | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup> |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,100              | 15.11.2052            | 16.241          | (397)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,130              | 03.05.2034            | 3.200           | 129                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150              | 12.10.2033            | 2.400           | 98                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,175              | 10.10.2033            | 2.400           | 102                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,200              | 18.10.2033            | 2.000           | 89                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,220              | 20.10.2033            | 2.400           | 111                                             | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,230              | 23.10.2033            | 1.300           | 61                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 20.03.2029            | 2.100           | 8                                               | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 20.03.2031            | 4.210           | 28                                              | 0,00                         |
| Erhalt                |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 22.11.2033            | 2.600           | (107)                                           | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,255              | 23.10.2033            | 1.300           | 64                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,393              | 25.10.2033            | 1.200           | 72                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,435              | 01.11.2033            | 1.300           | 83                                              | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,450              | 01.11.2033            | 2.600           | 170                                             | 0,01                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 9,874              | 02.01.2026            | 8.000           | (82)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 9,899              | 02.01.2026            | 4.000           | (41)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 9,939              | 02.01.2026            | 6.300           | (63)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 9,998              | 04.01.2027            | 12.000          | (167)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,037             | 04.01.2027            | 2.800           | (38)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,041             | 04.01.2027            | 11.300          | (155)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,052             | 02.01.2026            | 13.900          | (133)                                           | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,072             | 04.01.2027            | 6.980           | (81)                                            | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,085             | 02.01.2026            | 13.700          | (130)                                           | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,090             | 04.01.2027            | 21.200          | (286)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,098             | 04.01.2027            | 21.120          | (243)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,105             | 02.01.2026            | 13.600          | (128)                                           | 0,00                         |
| Zahlung               |                       | 1-Year BRL-CDI                | 10,138             | 04.01.2027            | 5.300           | (70)                                            | 0,00                         |

| Zahlung/<br>Erhalt     | variabler<br>Zinssatz | variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------|-----------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 10,165 %           | 04.01.2027            | BRL 10.710      | \$ (120)                                        | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 10,170             | 04.01.2027            | 17.870          | (200)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 10,183             | 04.01.2027            | 32.100          | (358)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 10,203             | 04.01.2027            | 25.010          | (277)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 10,210             | 04.01.2027            | 3.600           | (40)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 10,256             | 04.01.2027            | 24.990          | (271)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 10,328             | 04.01.2027            | 35.470          | (375)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 11,250             | 04.01.2027            | 200             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 11,275             | 04.01.2027            | 100             | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 11,290             | 04.01.2027            | 100             | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 11,746             | 04.01.2027            | 200             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 11,901             | 04.01.2027            | 500             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 12,047             | 04.01.2027            | 57.400          | (361)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 13,291             | 02.01.2029            | 33.600          | 53                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 13,354             | 02.01.2029            | 66.800          | 77                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 13,927             | 04.01.2027            | 51.300          | (29)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                | 1-Year BRL-CDI        |                         | 14,009             | 04.01.2027            | 36.500          | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month NZD-BBR       |                         | 4,750              | 19.06.2029            | NZD 14.100      | 337                                             | 0,01                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,000              | 03.01.2031            | ZAR 9.700       | 15                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,001              | 06.01.2031            | 9.700           | 15                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,010              | 07.01.2031            | 9.500           | 15                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,030              | 07.01.2031            | 9.500           | 15                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,053              | 07.01.2031            | 9.500           | 16                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,058              | 07.01.2031            | 9.500           | 16                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,063              | 08.01.2031            | 9.500           | 16                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,080              | 08.01.2031            | 32.800          | 56                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,203              | 10.01.2031            | 9.500           | 19                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,360              | 07.08.2028            | 37.400          | 81                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,380              | 04.08.2028            | 35.400          | 77                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,410              | 31.07.2028            | 24.200          | 54                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,410              | 07.08.2028            | 5.500           | 12                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,415              | 31.07.2028            | 6.500           | 15                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,415              | 04.08.2028            | 9.000           | 20                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,420              | 31.07.2028            | 24.200          | 55                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,421              | 04.08.2028            | 12.400          | 28                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,426              | 01.08.2028            | 9.800           | 22                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,460              | 01.08.2028            | 16.500          | 38                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,460              | 02.08.2028            | 16.700          | 39                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,543              | 04.08.2028            | 9.100           | 22                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 3-Month ZAR-JIBAR     |                         | 8,550              | 03.08.2028            | 19.800          | 49                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month AUD-BBR-BBSW  |                         | 3,000              | 21.03.2027            | AUD 12.400      | (339)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 6-Month AUD-BBR-BBSW  |                         | 4,500              | 20.09.2033            | 6.500           | 182                                             | 0,01                         |
| Zahlung                | 6-Month AUD-BBR-BBSW  |                         | 4,500              | 20.03.2034            | 19.100          | 565                                             | 0,02                         |
| Zahlung                | 6-Month AUD-BBR-BBSW  |                         | 4,500              | 18.09.2034            | 6.800           | 81                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month AUD-BBR-BBSW  |                         | 4,500              | 18.06.2035            | 98.700          | 1.067                                           | 0,03                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 0,250              | 18.03.2050            | € 2.500         | 1.221                                           | 0,04                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 0,329              | 30.12.2025            | 200             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 0,500              | 17.06.2050            | 600             | 311                                             | 0,01                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 0,650              | 11.05.2027            | 14.200          | (336)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 0,700              | 11.04.2027            | 4.800           | (124)                                           | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>  | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 0,830              | 09.12.2052            | 27.100          | 2.849                                           | 0,09                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 1,000              | 13.05.2027            | 9.800           | (191)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 1,000              | 18.05.2027            | 4.700           | (92)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 1,750              | 21.09.2027            | 3.500           | 7                                               | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup> | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,250              | 17.09.2030            | 16.820          | 210                                             | 0,01                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup> | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,250              | 17.09.2035            | 4.900           | (47)                                            | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>  | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,250              | 17.09.2055            | 85.000          | 5.166                                           | 0,17                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,280              | 04.03.2030            | 5.400           | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,380              | 31.12.2034            | 3.600           | (9)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,400              | 09.04.2030            | 4.800           | (29)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,400              | 12.02.2035            | 4.700           | 102                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,420              | 07.03.2035            | 2.700           | (38)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,460              | 13.03.2035            | 4.600           | (47)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,460              | 01.04.2035            | 2.800           | (30)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,510              | 09.04.2035            | 2.700           | 30                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,520              | 27.03.2035            | 2.700           | (12)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,520              | 09.04.2035            | 2.900           | 31                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,547              | 09.03.2033            | 4.900           | 143                                             | 0,00                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,590              | 19.08.2034            | 3.600           | (58)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                 | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,650              | 14.08.2029            | 2.900           | (104)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,750              | 05.03.2034            | 2.200           | 55                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,760              | 04.03.2034            | 2.200           | 57                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,770              | 16.04.2029            | 3.300           | 94                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,780              | 02.05.2029            | 3.200           | 93                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,827              | 06.05.2029            | 6.800           | 211                                             | 0,01                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 2,950              | 12.06.2029            | 2.700           | 99                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 3,270              | 21.08.2033            | 1.600           | 150                                             | 0,00                         |
| Zahlung                | 6-Month EUR-EURIBOR   |                         | 3,450              | 20.10.2028            | 2.900           | 216                                             | 0,01                         |
| Zahlung                | 28-Day MXN-TIIE       |                         | 8,990              | 18.12.2029            | MXN 15.900      | 44                                              | 0,00                         |
| Zahlung                | 28-Day MXN-TIIE       |                         | 9,108              | 13.03.2030            | 76.700          | 236                                             | 0,01                         |
| Zahlung                | 28-Day MXN-TIIE       |                         | 9,135              | 27.12.2029            | 30.800          | 94                                              | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,150 %            | 31.12.2029            | MXN 53.200      | \$ 164                                          | 0,01                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,000              | 15.09.2031            | £ 900           | (123)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,020              | 15.10.2031            | 1.200           | (154)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,055              | 15.09.2031            | 800             | (107)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,066              | 15.09.2031            | 1.700           | (195)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,140              | 15.10.2031            | 2.300           | (252)                                           | (0,01)                       |
|                                                |                        |                    |                       |                 | \$ 30.611                                       | 0,99                         |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                    |                       |                 | \$ 32.889                                       | 1,06                         |

- (1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung             | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Put - OTC EUR versus USD | \$ 1,150           | 27.08.2025         | 10.100                         | \$ 63  | \$ 51          | 0,00                         |
|            | Put - OTC EUR versus USD | 1,150              | 29.08.2025         | 40.500                         | 253    | 212            | 0,01                         |
|            |                          |                    |                    |                                | \$ 316 | \$ 263         | 0,01                         |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 2,110 %            | 26.07.2032         | 1.100                          | \$ 178   | \$ 73          | 0,00                         |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 2,110              | 26.07.2032         | 1.600                          | 259      | 501            | 0,02                         |
| MYC        | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 2,170              | 19.07.2032         | 1.200                          | 190      | 80             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 2,170              | 19.07.2032         | 1.400                          | 222      | 429            | 0,02                         |
|            | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 2,400              | 20.07.2027         | 1.200                          | 159      | 24             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 2,400              | 20.07.2027         | 1.400                          | 185      | 378            | 0,01                         |
|            |                                       |                        |                                             |                    |                    |                                | \$ 1.193 | \$ 1.485       | 0,05                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %            | 16.07.2025         | 9.600                          | \$ (13)  | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900              | 16.07.2025         | 37.700                         | (42)     | (2)            | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000              | 16.07.2025         | 18.200                         | (19)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850              | 16.07.2025         | 9.600                          | (12)     | (1)            | 0,00                         |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900              | 16.07.2025         | 18.200                         | (22)     | (1)            | 0,00                         |
|            |                                  |                         |                    |                    |                                | \$ (108) | \$ (6)         | 0,00                         |

##### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 39,750         | 11.08.2025         | 800                            | \$ (25)  | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 51,750             | 11.08.2025         | 800                            | (18)     | (4)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 40,575             | 19.08.2025         | 1.300                          | (46)     | (7)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 52,725             | 19.08.2025         | 1.300                          | (28)     | (7)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600             | 12.11.2025         | 900                            | (34)     | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900             | 12.11.2025         | 900                            | (25)     | (16)           | 0,00                         |
|            |                           |                    |                    |                                | \$ (176) | \$ (40)        | 0,00                         |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,555 %            | 24.07.2025         | 4.300                          | \$ (14)  | \$ (16)        | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770              | 09.07.2025         | 4.100                          | (13)     | (37)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,905              | 24.07.2025         | 4.300                          | (14)     | (8)            | 0,00                         |
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120              | 09.07.2025         | 4.100                          | (13)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564              | 24.07.2025         | 4.200                          | (14)     | (16)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605              | 23.07.2025         | 4.000                          | (14)     | (19)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914              | 24.07.2025         | 4.200                          | (13)     | (7)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955              | 23.07.2025         | 4.000                          | (13)     | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380              | 03.07.2025         | 1.700                          | (5)      | 0              | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 2.500                          | (8)      | (3)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640              | 03.07.2025         | 1.700                          | (5)      | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 2.500                          | (8)      | (4)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525              | 28.07.2025         | 7.700                          | (25)     | (25)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583              | 23.07.2025         | 2.000                          | (7)      | (8)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653              | 14.07.2025         | 4.000                          | (12)     | (17)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680              | 07.07.2025         | 3.400                          | (12)     | (13)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775              | 07.07.2025         | 6.800                          | (21)     | (60)           | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875              | 28.07.2025         | 7.700                          | (25)     | (20)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933              | 23.07.2025         | 2.000                          | (7)      | (3)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030              | 07.07.2025         | 3.400                          | (12)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053              | 14.07.2025         | 4.000                          | (12)     | (1)            | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125              | 07.07.2025         | 6.800                          | (21)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772              | 10.07.2025         | 4.000                          | (13)     | (38)           | 0,00                         |
| MYC        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122              | 10.07.2025         | 4.000                          | (13)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664              | 14.07.2025         | 4.000                          | (12)     | (19)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669              | 07.07.2025         | 4.300                          | (16)     | (14)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697              | 16.07.2025         | 4.100                          | (12)     | (28)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715              | 02.07.2025         | 4.200                          | (15)     | (17)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725              | 03.07.2025         | 4.300                          | (16)     | (23)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019              | 07.07.2025         | 4.300                          | (16)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064              | 14.07.2025         | 4.000                          | (12)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065              | 02.07.2025         | 4.200                          | (15)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075              | 03.07.2025         | 4.300                          | (16)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097              | 16.07.2025         | 4.100                          | (12)     | (1)            | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ (456) | \$ (405)       | (0,01)                       |

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung                                        | Variabler Zinssatzindex       | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|----------|------------|-----------------------|
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026 %        | 23.07.2025     | 15.900                     | \$ (139) | \$ (70)    | 0,00                  |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026          | 23.07.2025     | 15.900                     | (139)    | 0          | 0,00                  |
|            | Call - OTC 2-Year Interest Rate Cap <sup>(2)</sup>  | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026          | 23.07.2026     | 11.300                     | (200)    | (192)      | (0,01)                |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,026          | 23.07.2026     | 11.300                     | (200)    | (7)        | 0,00                  |
|            |                                                     |                               |                |                |                            | \$ (678) | \$ (269)   | (0,01)                |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | \$ 92,469          | 07.07.2025         | 2.200                          | \$ (12) | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469             | 07.07.2025         | 2.200                          | (10)    | (1)            | 0,00                         |
|            |                                                                               |                    |                    |                                | \$ (22) | \$ (1)         | 0,00                         |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                            | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Colombia Government International Bond     | 1,000 %                        | 20.12.2027            | \$ 500                         | \$ (45)                                      | \$ 41                                           | \$ (4)         | 0,00                         |
| BRC        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2026            | 900                            | (41)                                         | 41                                              | 0              | 0,00                         |
| CBK        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027            | 400                            | (14)                                         | 13                                              | (1)            | 0,00                         |
|            | Israel Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2030            | 1.400                          | (19)                                         | 25                                              | 6              | 0,00                         |
| DUB        | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026            | 100                            | (5)                                          | 5                                               | 0              | 0,00                         |
| GST        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027            | 500                            | (18)                                         | 17                                              | (1)            | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2027            | 300                            | (27)                                         | 25                                              | (2)            | 0,00                         |
|            | SoftBank Group Corp.                       | 1,000                          | 20.06.2026            | 2.400                          | (20)                                         | 9                                               | (11)           | 0,00                         |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2025            | 200                            | (11)                                         | 12                                              | 1              | 0,00                         |
| JPM        | Israel Government International Bond       | 1,000                          | 20.06.2030            | 1.400                          | (15)                                         | 21                                              | 6              | 0,00                         |
| MYC        | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.06.2027            | 700                            | (27)                                         | 25                                              | (2)            | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond     | 1,000                          | 20.12.2027            | 800                            | (71)                                         | 65                                              | (6)            | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond       | 1,000                          | 20.12.2025            | 200                            | (3)                                          | 4                                               | 1              | 0,00                         |
|            | South Africa Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026            | 1.400                          | (62)                                         | 67                                              | 5              | 0,00                         |
|            |                                            |                                |                       |                                | \$ (378)                                     | \$ 370                                          | \$ (8)         | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|----------------------------------------|-------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                     | 20.12.2029       | € 4.331                   | \$ 850                                 | \$ 87                                     | \$ 937    | 0,03                 |
| GST        | CMBX.NA.AAA.13 Index             | 0,500                       | 16.12.2072       | \$ 62.300                 | 92                                     | 133                                       | 225       | 0,01                 |
| MEI        | CMBX.NA.AAA.12 Index             | 0,500                       | 17.08.2061       | 15.300                    | (74)                                   | 155                                       | 81        | 0,00                 |
| MYC        | CMBX.NA.AAA.10 Index             | 0,500                       | 17.11.2059       | 25.375                    | (78)                                   | 187                                       | 109       | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.11 Index             | 0,500                       | 18.11.2054       | 25.375                    | (194)                                  | 347                                       | 153       | 0,01                 |
|            | CMBX.NA.AAA.12 Index             | 0,500                       | 17.08.2061       | 300                       | (2)                                    | 4                                         | 2         | 0,00                 |
|            | CMBX.NA.AAA.13 Index             | 0,500                       | 16.12.2072       | 25.500                    | 86                                     | 6                                         | 92        | 0,00                 |
|            |                                  |                             |                  |                           | \$ 680                                 | \$ 919                                    | \$ 1.599  | 0,05                 |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CNH                 | 22.527                | \$ 3.127                      | \$ (21)                         | \$ (21)                                        | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 1.529                 | 1.769                         | (26)                            | (26)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £                   | 1.600                 | 2.196                         | 0                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 76.673                | AUD 118.031                   | 679                             | 679                                            | 0,02                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.579                 | NZD 2.624                     | 14                              | 14                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD                 | 118.031               | \$ 76.718                     | 0                               | (683)                                          | (0,02)               |
|            | 08.2025          | CNH                 | 34.025                | 4.732                         | 0                               | (36)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NZD                 | 2.624                 | 1.581                         | 0                               | (14)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$                  | 1.074                 | € 915                         | 3                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 2.196                 | £ 1.600                       | (3)                             | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD                 | 14.672                | \$ 9.502                      | 0                               | (113)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNY                 | 113                   | 16                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SGD                 | 164                   | 127                           | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 609                   | IDR 9.942.040                 | 3                               | 3                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.258                 | KRW 1.715.495                 | 10                              | 10                                             | 0,00                 |
| BOA        | 07.2025          |                     | 241                   | SGD 309                       | 1                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD                 | 308                   | \$ 241                        | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 497                   | 15                            | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD                 | 420.369               | 307.253                       | 225                             | (1.134)                                        | (0,03)               |
|            | 07.2025          | €                   | 211                   | 244                           | 0                               | (5)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 1.815                 | 179                           | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | SEK                 | 2.975                 | 310                           | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | THB                 | 752                   | 23                            | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TRY                 | 44                    | 1                             | 0                               | 0                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD                 | 88.571                | 2.726                         | 0                               | (323)                                          | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$                  | 822                   | BRL 4.583                     | 18                              | 18                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 19.613                | € 16.919                      | 248                             | 248                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.629                 | IDR 26.588.625                | 8                               | 8                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 110                   | THB 3.603                     | 1                               | 1                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 426                   | TWD 12.676                    | 10                              | 10                                             | 0,00                 |
| BPS        | 08.2025          | CNH                 | 8.869                 | \$ 1.242                      | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TRY                 | 24.716                | 595                           | 0                               | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD                 | 72.954                | 2.238                         | 0                               | (298)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 856                   | INR 74.423                    | 9                               | 9                                              | 0,00                 |
|            | 08.2025          |                     | 223                   | TWD 7.300                     | 31                              | 31                                             | 0,00                 |
|            | 05.2026          |                     | 650                   | KWD 198                       | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 06.2026          |                     | 470                   | 144                           | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 06.2027          |                     | 228                   | 69                            | 0                               | (2)                                            | 0,00                 |
|            | 05.2029          | KWD                 | 974                   | \$ 3.350                      | 147                             | 147                                            | 0,00                 |
|            | 07.2029          |                     | 131                   | 450                           | 20                              | 20                                             | 0,00                 |
|            | 05.2030          |                     | 733                   | 2.523                         | 101                             | 101                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | €                   | 502.898               | 571.110                       | 0                               | (19.216)                                       | (0,62)               |
|            | 07.2025          | ILS                 | 12.490                | 3.588                         | 0                               | (122)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | KRW                 | 110.864               | 81                            | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK                 | 1.215                 | 120                           | 0                               | (1)                                            | 0,00                 |
| BRC        | 07.2025          | TRY                 | 21.704                | 528                           | 0                               | (7)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 264.996               | £ 194.803                     | 1.952                           | 1.952                                          | 0,06                 |
|            | 07.2025          |                     | 1.779                 | ILS 6.006                     | 5                               | 5                                              | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 691                   | ¥ 99.341                      | 0                               | (3)                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          |                     | 10.166                | TRY 416.762                   | 177                             | 177                                            | 0,01                 |
|            | 07.2025          |                     | 8.549                 | ZAR 154.539                   | 133                             | 133                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £                   | 191.184               | \$ 260.162                    | 0                               | (1.865)                                        | (0,06)               |
|            | 08.2025          | TWD                 | 60.917                | 1.871                         | 0                               | (246)                                          | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$                  | 6.398                 | TRY 265.806                   | 74                              | 74                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | PEN                 | 3.354                 | \$ 903                        | 0                               | (42)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$                  | 6.925                 | PEN 25.015                    | 123                             | 123                                            | 0,00                 |
|            | 12.2025          | PEN                 | 25.114                | \$ 6.925                      | 0                               | (121)                                          | 0,00                 |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
| BSH        |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |
|            |                  |                     |                       |                               |                                 |                                                |                      |

|     | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |        |
|-----|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|--------|
| CBK | 07.2025               | BRL                    | 136.214                  | \$ 23.814                        | \$ 0                               | \$ (1.143)                                           | \$ (1.143)                | (0,04) |
|     | 07.2025               | CAD                    | 143.802                  | 104.846                          | 0                                  | (547)                                                | (547)                     | (0,02) |
|     | 07.2025               | €                      | 3.494                    | 4.033                            | 0                                  | (68)                                                 | (68)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | KRW                    | 9.400.179                | 6.854                            | 0                                  | (96)                                                 | (96)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | PEN                    | 33.232                   | 9.049                            | 0                                  | (315)                                                | (315)                     | (0,01) |
|     | 07.2025               | THB                    | 39.339                   | 1.183                            | 0                                  | (28)                                                 | (28)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | TWD                    | 155.573                  | 4.782                            | 0                                  | (574)                                                | (574)                     | (0,02) |
|     | 07.2025               | \$                     | 3.208                    | AUD 4.953                        | 38                                 | 0                                                    | 38                        | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 3.288                    | CAD 4.503                        | 12                                 | 0                                                    | 12                        | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 5.830                    | CNY 41.798                       | 5                                  | 0                                                    | 5                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 2.189                    | £ 1.600                          | 8                                  | (4)                                                  | 4                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 1.827                    | IDR 29.752.970                   | 5                                  | 0                                                    | 5                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 3.245                    | PEN 11.569                       | 15                                 | 0                                                    | 15                        | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 7.514                    | TWD 223.379                      | 176                                | 0                                                    | 176                       | 0,01   |
|     | 08.2025               | CNH                    | 7.643                    | \$ 1.063                         | 0                                  | (8)                                                  | (8)                       | 0,00   |
|     | 08.2025               | CNY                    | 72                       | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 08.2025               | PEN                    | 26.963                   | 7.283                            | 0                                  | (307)                                                | (307)                     | (0,01) |
|     | 08.2025               | TWD                    | 175.902                  | 5.399                            | 0                                  | (715)                                                | (715)                     | (0,02) |
|     | 08.2025               | \$                     | 6.411                    | INR 552.600                      | 21                                 | (4)                                                  | 17                        | 0,00   |
|     | 09.2025               | MXN                    | 3.189                    | \$ 166                           | 0                                  | (1)                                                  | (1)                       | 0,00   |
|     | 09.2025               | PEN                    | 11.596                   | 3.245                            | 0                                  | (15)                                                 | (15)                      | 0,00   |
|     | 10.2025               | \$                     | 32.812                   | PEN 119.854                      | 867                                | 0                                                    | 867                       | 0,03   |
|     | 11.2025               | PEN                    | 34.526                   | \$ 9.435                         | 0                                  | (257)                                                | (257)                     | (0,01) |
|     | 12.2025               |                        | 4.722                    | 1.275                            | 0                                  | (49)                                                 | (49)                      | 0,00   |
| DUB | 07.2025               | ILS                    | 6.066                    | 1.750                            | 0                                  | (51)                                                 | (51)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | KRW                    | 136.362                  | 100                              | 0                                  | (1)                                                  | (1)                       | 0,00   |
|     | 07.2025               | SGD                    | 54                       | 42                               | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 07.2025               | \$                     | 1.483                    | AUD 2.303                        | 26                                 | 0                                                    | 26                        | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 555.258                  | € 478.629                        | 6.580                              | 0                                                    | 6.580                     | 0,21   |
|     | 07.2025               |                        | 95                       | IDR 1.539.127                    | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 370                      | TWD 10.997                       | 9                                  | 0                                                    | 9                         | 0,00   |
|     | 08.2025               | €                      | 477.580                  | \$ 555.258                       | 0                                  | (6.571)                                              | (6.571)                   | (0,21) |
|     | 08.2025               | \$                     | 2.972                    | INR 256.433                      | 12                                 | (1)                                                  | 11                        | 0,00   |
|     | 08.2025               |                        | 2.219                    | TWD 72.056                       | 286                                | 0                                                    | 286                       | 0,01   |
|     | 09.2025               | PEN                    | 13.644                   | \$ 3.710                         | 0                                  | (127)                                                | (127)                     | 0,00   |
|     | 09.2025               | \$                     | 0                        | MXN 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 07.2025               | ¥                      | 2.399.005                | \$ 16.481                        | 0                                  | (127)                                                | (127)                     | 0,00   |
|     | 07.2025               | \$                     | 4.549                    | CHF 3.642                        | 26                                 | 0                                                    | 26                        | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 1.844                    | PLN 6.802                        | 37                                 | 0                                                    | 37                        | 0,00   |
| FAR | 07.2025               |                        | 194                      | SGD 247                          | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 08.2025               | CHF                    | 3.627                    | \$ 4.549                         | 0                                  | (26)                                                 | (26)                      | 0,00   |
|     | 08.2025               | CNH                    | 9.361                    | 1.308                            | 0                                  | (4)                                                  | (4)                       | 0,00   |
|     | 08.2025               | SGD                    | 247                      | 194                              | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 08.2025               | \$                     | 1.420                    | INR 122.816                      | 9                                  | 0                                                    | 9                         | 0,00   |
|     | 08.2025               |                        | 16.481                   | ¥ 2.390.182                      | 127                                | 0                                                    | 127                       | 0,00   |
|     | 09.2025               |                        | 34.775                   | MXN 677.127                      | 778                                | 0                                                    | 778                       | 0,02   |
|     | 07.2025               | BRL                    | 145.331                  | \$ 26.356                        | 0                                  | (272)                                                | (272)                     | (0,01) |
|     | 07.2025               | TWD                    | 16.984                   | 522                              | 0                                  | (63)                                                 | (63)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | \$                     | 433                      | IDR 7.057.527                    | 2                                  | 0                                                    | 2                         | 0,00   |
| GLM | 07.2025               |                        | 75                       | SGD 96                           | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 56                       | TWD 1.808                        | 7                                  | 0                                                    | 7                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 36                       | ZAR 644                          | 1                                  | 0                                                    | 1                         | 0,00   |
|     | 08.2025               | SGD                    | 96                       | \$ 75                            | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 08.2025               | \$                     | 175                      | TWD 5.756                        | 25                                 | 0                                                    | 25                        | 0,00   |
|     | 09.2025               |                        | 26.356                   | BRL 147.578                      | 277                                | 0                                                    | 277                       | 0,01   |
|     | 07.2025               | CNH                    | 20.309                   | \$ 2.814                         | 0                                  | (24)                                                 | (24)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | KRW                    | 649.240                  | 475                              | 0                                  | (6)                                                  | (6)                       | 0,00   |
|     | 07.2025               | NZD                    | 2.624                    | 1.565                            | 0                                  | (28)                                                 | (28)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | PLN                    | 40                       | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 07.2025               | SGD                    | 2.096                    | 1.632                            | 0                                  | (14)                                                 | (14)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | TWD                    | 89.654                   | 2.757                            | 0                                  | (329)                                                | (329)                     | (0,01) |
|     | 07.2025               | \$                     | 960                      | AUD 1.465                        | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 47.251                   | BRL 276.687                      | 3.444                              | 0                                                    | 3.444                     | 0,11   |
|     | 07.2025               |                        | 3.319                    | PLN 12.267                       | 74                                 | 0                                                    | 74                        | 0,00   |
| JPM | 07.2025               |                        | 158                      | SGD 202                          | 1                                  | 0                                                    | 1                         | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 511                      | TWD 15.189                       | 11                                 | 0                                                    | 11                        | 0,00   |
|     | 07.2025               |                        | 2.452                    | ZAR 43.818                       | 10                                 | 0                                                    | 10                        | 0,00   |
|     | 08.2025               | AUD                    | 1.465                    | \$ 961                           | 0                                  | 0                                                    | 0                         | 0,00   |
|     | 08.2025               | CNH                    | 31.393                   | 4.364                            | 0                                  | (36)                                                 | (36)                      | 0,00   |
|     | 08.2025               | SGD                    | 202                      | 158                              | 0                                  | (1)                                                  | (1)                       | 0,00   |
|     | 08.2025               | TWD                    | 95.141                   | 2.920                            | 0                                  | (387)                                                | (387)                     | (0,01) |
|     | 08.2025               | \$                     | 957                      | INR 83.005                       | 8                                  | 0                                                    | 8                         | 0,00   |
|     | 08.2025               |                        | 3.567                    | TWD 116.771                      | 492                                | 0                                                    | 492                       | 0,02   |
|     | 07.2025               | AUD                    | 1.465                    | \$ 958                           | 0                                  | (2)                                                  | (2)                       | 0,00   |
|     | 07.2025               | CAD                    | 49.781                   | 36.423                           | 0                                  | (70)                                                 | (70)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | CHF                    | 3.622                    | 4.407                            | 0                                  | (143)                                                | (143)                     | 0,00   |
|     | 07.2025               | CNH                    | 11.091                   | 1.539                            | 0                                  | (11)                                                 | (11)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | €                      | 13.380                   | 15.535                           | 0                                  | (172)                                                | (172)                     | (0,01) |
|     | 07.2025               | £                      | 3.068                    | 4.168                            | 0                                  | (37)                                                 | (37)                      | 0,00   |
| MBC | 07.2025               | SGD                    | 5.035                    | 3.925                            | 0                                  | (28)                                                 | (28)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | THB                    | 19.747                   | 597                              | 0                                  | (11)                                                 | (11)                      | 0,00   |
|     | 07.2025               | TWD                    | 42.785                   | 1.313                            | 0                                  | (160)                                                | (160)                     | (0,01) |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| MYI        | 07.2025               | \$ 7.642               | CAD 10.504               | \$ 57                            | \$ 0                               | \$ 57                                                | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 27.465                 | € 23.719                 | 377                              | 0                                  | 377                                                  | 0,01                      |
|            | 07.2025               | 4.316                  | £ 3.190                  | 55                               | 0                                  | 55                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 418                    | IDR 6.793.869            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 16.733                 | ¥ 2.404.150              | 0                                | (89)                               | (89)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 4.164                  | SGD 5.385                | 64                               | 0                                  | 64                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 1.540                  | TWD 48.742               | 138                              | 0                                  | 138                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CAD 10.487             | \$ 7.642                 | 0                                | (57)                               | (57)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH 19.808             | 2.750                    | 0                                | (25)                               | (25)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD 5.373              | 4.164                    | 0                                | (65)                               | (65)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD 72.275             | 2.234                    | 0                                | (279)                              | (279)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | € 2.186                | 2.561                    | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥ 764.297              | 5.241                    | 0                                | (50)                               | (50)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD 394                | 309                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 9                   | £ 7                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 8.570                  | ¥ 1.238.097              | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 272                    | NOK 2.744                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 10                     | PLN 36                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH 9.541              | \$ 1.333                 | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | NOK 2.744              | 272                      | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
| RBC        | 08.2025               | \$ 1.140               | CNH 8.312                | 25                               | 0                                  | 25                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 5.241                  | ¥ 761.488                | 50                               | 0                                  | 50                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CAD 997                | \$ 725                   | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CHF 25                 | 30                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                      |
| RYL        | 08.2025               | \$ 2.017               | CNH 14.610               | 30                               | 0                                  | 30                                                   | 0,00                      |
| SCX        | 07.2025               | CAD 535                | \$ 394                   | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| SOG        | 07.2025               | CNY 41.823             | 5.840                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ILS 92                 | 27                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥ 948                  | 7                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD 2.960              | 102                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 2.014               | IDR 32.822.337           | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 832                    | SGD 1.073                | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 3.760                  | TWD 110.111              | 30                               | 0                                  | 30                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH 34.653             | \$ 4.844                 | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD 1.070              | 832                      | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD 23.878             | 732                      | 0                                | (98)                               | (98)                                                 | 0,00                      |
| SSB        | 08.2025               | \$ 6.130               | CNH 44.303               | 78                               | 0                                  | 78                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 5.840                  | CNY 41.711               | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 1.002                  | INR 86.040               | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 7                      | ¥ 945                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | € 569                  | \$ 656                   | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥ 110.873              | 768                      | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 28                  | NOK 286                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | NOK 286                | \$ 28                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 6                   | INR 496                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 768                    | ¥ 110.466                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                      |
| UAG        | 07.2025               | £ 194.925              | \$ 263.932               | 0                                | (3.183)                            | (3.183)                                              | (0,10)                    |
|            | 08.2025               | TWD 64.101             | 1.971                    | 0                                | (258)                              | (258)                                                | (0,01)                    |
|            | 12.2025               | PEN 7.400              | 2.001                    | 0                                | (75)                               | (75)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ILS 918                | 256                      | 0                                | (17)                               | (17)                                                 | 0,00                      |
| WST        | 07.2025               | KRW 110.635            | 82                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB 3.136              | 94                       | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 5.581               | ¥ 807.840                | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 82                     | KRW 110.688              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 1.768                  | CNH 12.832               | 30                               | 0                                  | 30                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 388                    | TRY 17.265               | 29                               | 0                                  | 29                                                   | 0,00                      |
|            | 09.2025               | MXN 808                | \$ 42                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 11.2025               | \$ 153                 | TRY 7.211                | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | AUD 110.615            | \$ 71.323                | 0                                | (1.169)                            | (1.169)                                              | (0,04)                    |
|            | 07.2025               | ¥ 1.273.967            | 8.846                    | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 15.694              | € 13.383                 | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               | € 13.383               | \$ 15.728                | 0                                | (16)                               | (16)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 8.846               | ¥ 1.269.278              | 0                                | (27)                               | (27)                                                 | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 18.434                        | \$ (42.600)                        | \$ (24.166)                                          | (0,78)                    |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD 73.942             | \$ 48.033                | \$ 0                             | \$ (425)                           | \$ (425)                                             | (0,01)                    |
|            | 08.2025               | \$ 48.061              | AUD 73.942               | 428                              | 0                                  | 428                                                  | 0,01                      |
| BOA        | 07.2025               | 1.426                  | 2.199                    | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | 47.426                 | 73.590                   | 802                              | 0                                  | 802                                                  | 0,03                      |
| CBK        | 07.2025               | 77                     | 120                      | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | 42.909                 | 66.634                   | 759                              | 0                                  | 759                                                  | 0,02                      |
| FAR        | 07.2025               | AUD 73.505             | \$ 48.057                | 0                                | (114)                              | (114)                                                | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 48.087              | AUD 73.505               | 115                              | 0                                  | 115                                                  | 0,00                      |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| JPM        | 07.2025               | AUD 67.675             | \$ 44.355                | \$ 4                             | \$ 0                               | \$ 4                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 44.382              | AUD 67.675               | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                      |
| MBC        | 07.2025               | AUD 1.017              | \$ 652                   | 0                                | (14)                               | (14)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 3                   | AUD 5                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| WST        | 07.2025               | 47.450                 | 73.590                   | 777                              | 0                                  | 777                                                  | 0,02                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 2.902                         | \$ (557)                           | \$ 2.345                                             | 0,07                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CHF 2.368              | \$ 2.965                 | \$ 0                             | \$ (10)                            | \$ (10)                                              | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 2.965               | CHF 2.359                | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | 101                    | 82                       | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025               | 61                     | 49                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
| FAR        | 07.2025               | CHF 2.376              | \$ 2.968                 | 0                                | (17)                               | (17)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 2.968               | CHF 2.366                | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,00                      |
| MBC        | 07.2025               | 2.827                  | 2.324                    | 92                               | 0                                  | 92                                                   | 0,01                      |
| RBC        | 07.2025               | 2.827                  | 2.319                    | 86                               | 0                                  | 86                                                   | 0,00                      |
| SCX        | 07.2025               | 2.643                  | 2.169                    | 82                               | 0                                  | 82                                                   | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 290                           | \$ (27)                            | \$ 263                                               | 0,01                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 376.033              | \$ 440.290               | \$ 0                             | \$ (1.117)                         | \$ (1.117)                                           | (0,04)                    |
|            | 08.2025               | \$ 441.254             | € 376.033                | 1.115                            | 0                                  | 1.115                                                | 0,04                      |
| BOA        | 07.2025               | 446.995                | 393.119                  | 14.467                           | 0                                  | 14.467                                               | 0,47                      |
| BPS        | 07.2025               | 1.312                  | 1.140                    | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | € 950                  | \$ 1.073                 | 0                                | (41)                               | (41)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 458.676             | € 403.803                | 15.328                           | 0                                  | 15.328                                               | 0,50                      |
| CBK        | 07.2025               | € 66                   | \$ 76                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 5.218               | € 4.517                  | 85                               | 0                                  | 85                                                   | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | € 404.265              | \$ 468.988               | 0                                | (5.559)                            | (5.559)                                              | (0,18)                    |
|            | 08.2025               | \$ 468.988             | € 403.379                | 5.551                            | 0                                  | 5.551                                                | 0,18                      |
| MBC        | 07.2025               | 15.003                 | 12.943                   | 190                              | 0                                  | 190                                                  | 0,01                      |
| WST        | 07.2025               | € 400.891              | \$ 470.105               | 0                                | (481)                              | (481)                                                | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | \$ 415.928             | € 368.169                | 16.248                           | 0                                  | 16.248                                               | 0,52                      |
|            | 08.2025               | 471.131                | 400.891                  | 481                              | 0                                  | 481                                                  | 0,02                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 53.491                        | \$ (7.200)                         | \$ 46.291                                            | 1,50                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £ 75.512               | \$ 103.617               | \$ 140                           | \$ 0                               | \$ 140                                               | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 103.631             | £ 75.512                 | 0                                | (139)                              | (139)                                                | 0,00                      |
| BOA        | 07.2025               | 176                    | 130                      | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | £ 81.844               | \$ 111.357               | 0                                | (797)                              | (797)                                                | (0,03)                    |
|            | 07.2025               | \$ 101.650             | £ 75.286                 | 1.518                            | 0                                  | 1.518                                                | 0,05                      |
|            | 08.2025               | 111.345                | 81.823                   | 798                              | 0                                  | 798                                                  | 0,03                      |
| CBK        | 07.2025               | 1.449                  | 1.074                    | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,00                      |
| JPM        | 07.2025               | 108.584                | 80.601                   | 1.867                            | 0                                  | 1.867                                                | 0,06                      |
| MBC        | 07.2025               | 2.107                  | 1.555                    | 24                               | 0                                  | 24                                                   | 0,00                      |
| SSB        | 07.2025               | £ 81.109               | \$ 111.216               | 69                               | 0                                  | 69                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 108.737             | £ 80.307                 | 1.311                            | 0                                  | 1.311                                                | 0,04                      |
|            | 08.2025               | 111.231                | 81.109                   | 0                                | (67)                               | (67)                                                 | 0,00                      |
| UAG        | 07.2025               | £ 489                  | \$ 662                   | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 5.751                         | \$ (1.011)                         | \$ 4.740                                             | 0,15                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BOA        | 07.2025               | SGD 8.358              | \$ 6.527                 | \$ 0                             | \$ (35)                            | \$ (35)                                              | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 14.309              | SGD 18.444               | 172                              | 0                                  | 172                                                  | 0,01                      |
|            | 08.2025               | 6.527                  | 8.338                    | 36                               | 0                                  | 36                                                   | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | 43                     | 55                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025               | SGD 400                | \$ 311                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 967                 | SGD 1.238                | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | 8.921                  | 11.492                   | 102                              | 0                                  | 102                                                  | 0,00                      |
| FAR        | 07.2025               | SGD 18.650             | \$ 14.623                | 0                                | (20)                               | (20)                                                 | 0,00                      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Low Duration Income Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |       |        |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|-------|--------|
|                                  | 08.2025               | \$                     | 14.623                   | SGD                              | 18.605                             | \$ 22                                                | \$ 0                      | \$ 22 | 0,00   |
| GLM                              | 07.2025               | SGD                    | 8.323                    | \$                               | 6.530                              | 0                                                    | (5)                       | (5)   | 0,00   |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 6.530                    | SGD                              | 8.303                              | 6                                                    | 0                         | 6     | 0,00   |
| JPM                              | 07.2025               | SGD                    | 8.448                    | \$                               | 6.598                              | 0                                                    | (35)                      | (35)  | 0,00   |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 17.135                   | SGD                              | 22.010                             | 146                                                  | 0                         | 146   | 0,01   |
|                                  | 08.2025               |                        | 6.598                    |                                  | 8.429                              | 36                                                   | 0                         | 36    | 0,00   |
| MBC                              | 07.2025               | SGD                    | 20.752                   | \$                               | 16.047                             | 0                                                    | (246)                     | (246) | (0,01) |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 13.387                   | SGD                              | 17.174                             | 97                                                   | 0                         | 97    | 0,00   |
|                                  | 08.2025               |                        | 16.047                   |                                  | 20.705                             | 250                                                  | 0                         | 250   | 0,01   |
| MYI                              | 07.2025               | SGD                    | 23                       | \$                               | 18                                 | 0                                                    | 0                         | 0     | 0,00   |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 957                      | SGD                              | 1.230                              | 8                                                    | 0                         | 8     | 0,00   |
| SCX                              | 07.2025               | SGD                    | 3.530                    | \$                               | 2.737                              | 0                                                    | (35)                      | (35)  | 0,00   |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 2.737                    | SGD                              | 3.522                              | 35                                                   | 0                         | 35    | 0,00   |
| SSB                              | 07.2025               |                        | 154                      |                                  | 196                                | 0                                                    | 0                         | 0     | 0,00   |
| UAG                              | 07.2025               |                        | 108                      |                                  | 138                                | 1                                                    | 0                         | 1     | 0,00   |
|                                  |                       |                        |                          |                                  | \$ 916                             | \$ (379)                                             | \$ 537                    | 0,02  |        |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      | \$ 32.628                 | 1,06  |        |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                          |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 1.900       | \$ 228                   | 0,01                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | \$ 228                   | 0,01                         |
| Summe Anlagen                              |                | \$ 4.748.976             | 153,57                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |                | \$ (1.656.608)           | (53,57)                      |
| Nettovermögen                              |                | \$ 3.092.368             | 100,00                       |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,14 %):

| Emittentenbeschreibung                                              | Kauf-<br>datum        | Kosten    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------------------------------|-----------------------|-----------|----------------|------------------------------|
| AMSURG Corp.                                                        | 02.11.2023–06.11.2023 | \$ 1.905  | \$ 2.058       | 0,07                         |
| Credit Agricole Opportunities Partners 6,520 % fällig am 20.03.2028 | 20.02.2025            | 6.200     | 6.242          | 0,20                         |
| Intelsat Emergence S.A.                                             | 05.09.2018–23.02.2022 | 3.227     | 1.572          | 0,05                         |
| Pantheon Senior Debt Secondaries 6,317% fällig 26/03/2026           | 18.03.2025            | 1.100     | 1.100          | 0,03                         |
| Project Alfa 4,256 % fällig am 27.02.2026                           | 28.02.2025            | 491       | 555            | 0,02                         |
| Westmoreland Mining LLC                                             | 26.03.2019            | 0         | 0              | 0,00                         |
| Westmoreland Mining LLC                                             | 07.03.2023            | 1         | 0              | 0,00                         |
|                                                                     |                       | \$ 12.924 | \$ 11.527      | 0,37                         |

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 7.014 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 388 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 70.883 USD (31. Dezember 2024: 60.222 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 6.493 USD) und Barmittel in Höhe von 7.040 USD (31. Dezember 2024: 10.769 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 277                                                                      | \$ 3.820.844                                                    | \$ 42.139                                                    | \$ 3.863.260        |
| Investmentfonds                     | 296.382                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 296.382             |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 511.222                                                         | 0                                                            | 511.222             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 3.229                                                                       | 74.655                                                          | 0                                                            | 77.884              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 228                                                             | 0                                                            | 228                 |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 299.888</b>                                                           | <b>\$ 4.406.949</b>                                             | <b>\$ 42.139</b>                                             | <b>\$ 4.748.976</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 455                                                                      | \$ 4.268.203                                                    | \$ 14.849                                                    | \$ 4.283.507        |
| Investmentfonds                     | 293.517                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 293.517             |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 51.766                                                          | 0                                                            | 51.766              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (1.235)                                                                     | 47.445                                                          | 0                                                            | 46.210              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 237                                                             | 0                                                            | 237                 |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (38.024)                                                        | 0                                                            | (38.024)            |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 292.737</b>                                                           | <b>\$ 4.329.627</b>                                             | <b>\$ 14.849</b>                                             | <b>\$ 4.637.213</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:**

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOS                                       | 4,250 %         | 23.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (209)          | \$ (209)                                                        | (0,01)                       |
|                                           | 4,270           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (4.338)           | (4.343)                                                         | (0,14)                       |
| BRC                                       | 1,500           | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (788)           | (926)                                                           | (0,03)                       |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                   | <b>\$ (5.478)</b>                                               | <b>(0,18)</b>                |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (82)                             | \$ 120                                | \$ 38                               | \$ (138)                            | \$ 0                                  | \$ (138)                            |
| BOA        | 14.493                              | (13.820)                              | 673                                 | (525)                               | 500                                   | (25)                                |
| BPS        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | 2.503                               | (2.182)                               | 321                                 |
| BRC        | (1.510)                             | 1.490                                 | (20)                                | (530)                               | 572                                   | 42                                  |
| BSH        | (40)                                | 20                                    | (20)                                | 17                                  | 0                                     | 17                                  |
| CBK        | (2.926)                             | 2.760                                 | (166)                               | (1.565)                             | 1.674                                 | 109                                 |
| DUB        | 1.015                               | (1.030)                               | (15)                                | (8.952)                             | 7.982                                 | (970)                               |
| FAR        | 823                                 | (850)                                 | (27)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| GLM        | 668                                 | 0                                     | 668                                 | 730                                 | (270)                                 | 460                                 |
| GST        | 209                                 | (160)                                 | 49                                  | (108)                               | 74                                    | (34)                                |
| JPM        | 5.196                               | (4.860)                               | 336                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MBC        | (65)                                | 130                                   | 65                                  | (5.878)                             | 4.626                                 | (1.252)                             |
| MEI        | 81                                  | 0                                     | 81                                  | 4                                   | 0                                     | 4                                   |
| MYC        | 893                                 | 0                                     | 893                                 | 362                                 | 593                                   | 955                                 |
| MYI        | 25                                  | 0                                     | 25                                  | (461)                               | 470                                   | 9                                   |
| RBC        | 77                                  | 0                                     | 77                                  | 35                                  | 0                                     | 35                                  |
| RYL        | 30                                  | 0                                     | 30                                  | (25)                                | 0                                     | (25)                                |
| SAL        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SCX        | 89                                  | 0                                     | 89                                  | 2.968                               | (2.060)                               | 908                                 |
| SOG        | (13)                                | 0                                     | (13)                                | (83)                                | 0                                     | (83)                                |
| SSB        | (2.203)                             | 2.520                                 | 317                                 | 15                                  | 0                                     | 15                                  |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (601)                               | 581                                   | (20)                                |
| UAG        | 11                                  | 0                                     | 11                                  | (36)                                | 190                                   | 154                                 |
| WST        | 15.856                              | (15.190)                              | 666                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 15,14             | 20,46             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 38,62             | 44,46             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,05              | 0,05              |
| Investmentfonds                                                        | 4,13              | 4,46              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 7,12              | 0,79              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,21              | 0,04              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,92              | 1,23              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,19              | 0,36              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,00              | 0,00              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 32,62             | 28,15             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 1,17              | 1,11              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 23,80             | 26,18             |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 57,03             | 63,03             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 6,62              | 6,83              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 11,64             | 20,91             |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 21,30             | 23,32             |
| Staatsemissionen                                                                       | 2,99              | 4,52              |
| Stammaktien                                                                            | 0,13              | 0,14              |
| Optionsscheine                                                                         | 0,00              | 0,00              |
| Real Estate Investment Trusts                                                          | 0,00              | 0,00              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,25              | 0,39              |
| Investmentfonds                                                                        | 9,58              | 10,03             |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 16,53             | 1,77              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,41              | (0,07)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | (0,01)            | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,02              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,06              | 0,03              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,99              | 2,02              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,05              | 0,05              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,00              | (0,07)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Zinsscaps                                                                              | (0,01)            | (0,02)            |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,05              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,78)            | 0,75              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,75              | (1,12)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,01              | 0,01              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | k. A.             | (1,30)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (53,57)           | (58,52)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE           |                |                          |                                   |                                                        |                |                          |                                   | INDUSTRIEWERTE                                          |                |                          |                                   |
| KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG |                |                          |                                   |                                                        |                |                          |                                   |                                                         |                |                          |                                   |
| American Airlines, Inc.            |                |                          |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC                              | \$ 600         | \$ 596                   | 0,07                              | Air Canada                                              | \$ 1.200       | \$ 1.189                 | 0,15                              |
| 6,522 % fällig am 20.04.2028       | \$ 715         | \$ 711                   | 0,09                              | 3,375 % fällig am 13.11.2025                           | 500            | 505                      | 0,06                              | 3,875 % fällig am 15.08.2026                            |                |                          |                                   |
| 9,281 % fällig am 20.04.2028       | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,918 % fällig am 20.03.2028                           | 100            | 99                       | 0,01                              | Alaska Airlines Pass-Through Trust                      | 1.359          | 1.362                    | 0,17                              |
| IRB Holding Corp.                  |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.                              |                |                          |                                   | 4,800 % fällig am 15.02.2029                            |                |                          |                                   |
| 6,827 % fällig am 15.12.2027       | 3.282          | 3.285                    | 0,41                              | 3,691 % fällig am 05.06.2028                           | 300            | 300                      | 0,04                              | Altice France S.A.                                      | 2.100          | 1.743                    | 0,22                              |
| LifePoint Health, Inc.             |                |                          |                                   | Greengrove RE Ltd.                                     |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.10.2029                            |                |                          |                                   |
| 7,820 % fällig am 19.05.2031       | 298            | 294                      | 0,04                              | 12,044 % fällig am 08.04.2032                          |                |                          |                                   | American Airlines Pass-Through Trust                    | 510            | 470                      | 0,06                              |
| 8,006 % fällig am 19.05.2031       | 1.128          | 1.118                    | 0,14                              | Intesa Sanpaolo SpA                                    |                |                          |                                   | 3,150 % fällig am 15.08.2033                            | 15             | 14                       | 0,00                              |
| Republic of Panama                 |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am                                      | € 1.700        | 2.104                    | 0,26                              | 3,250 % fällig am 15.04.2030                            | 849            | 828                      | 0,10                              |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027       | € 500          | 591                      | 0,07                              | 11.01.2027 (g)(i)                                      | 1.137          | 1.326                    | 0,16                              | 3,375 % fällig am 01.11.2028                            | 615            | 595                      | 0,07                              |
|                                    |                | 5.999                    | 0,75                              | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.                 |                |                          |                                   | 3,650 % fällig am 15.08.2030                            | 184            | 181                      | 0,02                              |
|                                    |                |                          |                                   | Logicor Financing SARL                                 |                |                          |                                   | 3,700 % fällig am 01.04.2028                            |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 13.11.2028                           | 700            | 823                      | 0,10                              | Ashtead Capital, Inc.                                   |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Longleaf Pine RE Ltd.                                  |                |                          |                                   | 5,950 % fällig am 15.10.2033                            | 1.700          | 1.762                    | 0,22                              |
|                                    |                |                          |                                   | 21,794 % fällig am 27.05.2031                          | \$ 400         | 413                      | 0,05                              | Boeing Co.                                              | 2.100          | 2.076                    | 0,26                              |
|                                    |                |                          |                                   | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.                   |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 01.02.2026                            |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 5,242 % fällig am 19.04.2029                           | 600            | 614                      | 0,08                              | British Airways Pass-Through Trust                      | 75             | 70                       | 0,01                              |
|                                    |                |                          |                                   | Mizuho Financial Group, Inc.                           |                |                          |                                   | 3,300 % fällig am 15.06.2034                            | 267            | 257                      | 0,03                              |
|                                    |                |                          |                                   | 3,477 % fällig am 12.04.2026                           | 2.550          | 2.533                    | 0,31                              | 4,250 % fällig am 15.05.2034                            |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | NatWest Group PLC                                      |                |                          |                                   | Burberry Group PLC                                      |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am                                      |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 20.06.2030                            | £ 700          | 960                      | 0,12                              |
|                                    |                |                          |                                   | 10.08.2025 (g)(i)                                      | 300            | 302                      | 0,04                              | Chanel Ceres PLC                                        |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                        |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 31.07.2026                            | € 800          | 920                      | 0,11                              |
|                                    |                |                          |                                   | 2,450 % fällig am 15.09.2028                           | 800            | 709                      | 0,09                              | 1,000 % fällig am 31.07.2031                            | 2.100          | 2.168                    | 0,27                              |
|                                    |                |                          |                                   | Norinchukin Bank                                       |                |                          |                                   | DAE Funding LLC                                         |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 16.10.2029                           | 800            | 812                      | 0,10                              | 3,375 % fällig am 20.03.2028                            | \$ 1.900       | 1.830                    | 0,23                              |
|                                    |                |                          |                                   | Orange Capital RE DAC                                  |                |                          |                                   | DSV Finance BV                                          |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 8,323 % fällig am 17.01.2029                           | € 250          | 293                      | 0,04                              | 2,875 % fällig am 06.11.2026                            | € 700          | 826                      | 0,10                              |
|                                    |                |                          |                                   | Palm RE Ltd.                                           |                |                          |                                   | Exela Intermediate LLC (11,500 % PIK)                   |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 13,794 % fällig am 09.06.2031                          | \$ 250         | 256                      | 0,03                              | 11,500 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC         |                |                          |                                   | 15.04.2026 (c)                                          | \$ 195         | 10                       | 0,00                              |
|                                    |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am                                      |                |                          |                                   | Flora Food Management BV                                |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 05.04.2032 (e)                                         | 1.048          | 746                      | 0,09                              | 6,875 % fällig am 02.07.2029                            | € 1.400        | 1.671                    | 0,21                              |
|                                    |                |                          |                                   | Peugeot Invest S.A.                                    |                |                          |                                   | Greene King Finance PLC                                 |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 1,875 % fällig am 30.10.2026                           | € 2.300        | 2.660                    | 0,33                              | 5,318 % fällig am 15.09.2031                            | £ 276          | 380                      | 0,05                              |
|                                    |                |                          |                                   | Polestar Re Ltd.                                       |                |                          |                                   | 6,158 % fällig am 15.12.2034                            | 100            | 128                      | 0,02                              |
|                                    |                |                          |                                   | 14,794 % fällig am 07.01.2028                          | \$ 250         | 258                      | 0,03                              | Haleon U.S. Capital LLC                                 |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 17,544 % fällig am 07.01.2027                          | 700            | 731                      | 0,09                              | 3,375 % fällig am 24.03.2027                            | \$ 1.000       | 986                      | 0,12                              |
|                                    |                |                          |                                   | Purple Re Ltd.                                         |                |                          |                                   | InterContinental Hotels Group PLC                       |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 13,294 % fällig am 06.06.2031                          | 300            | 307                      | 0,04                              | 2,125 % fällig am 24.08.2026                            | £ 200          | 266                      | 0,03                              |
|                                    |                |                          |                                   | RCI Banque S.A.                                        |                |                          |                                   | 2,125 % fällig am 15.05.2027                            | € 700          | 817                      | 0,10                              |
|                                    |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 24.03.2037                           | € 700          | 829                      | 0,10                              | John Lewis PLC                                          |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Sagax AB                                               |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 18.12.2034                            | £ 1.300        | 1.453                    | 0,18                              |
|                                    |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 30.01.2027                           | 1.700          | 1.945                    | 0,24                              | Las Vegas Sands Corp.                                   |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Sagax Euro MTN NL BV                                   |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.06.2028                            | \$ 1.100       | 1.122                    | 0,14                              |
|                                    |                |                          |                                   | 0,750 % fällig am 26.01.2028                           | 600            | 666                      | 0,08                              | MGM China Holdings Ltd.                                 |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 17.05.2029                           | 1.000          | 1.077                    | 0,13                              | 5,875 % fällig am 15.05.2026                            | 200            | 200                      | 0,03                              |
|                                    |                |                          |                                   | Santander Holdings USA, Inc.                           |                |                          |                                   | Mitchells & Butlers Finance PLC                         |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 3,244 % fällig am 05.10.2026                           | \$ 100         | 98                       | 0,01                              | 5,111 % fällig am 15.12.2030                            | 77             | 75                       | 0,01                              |
|                                    |                |                          |                                   | Santander UK Group Holdings PLC                        |                |                          |                                   | 6,013 % fällig am 15.12.2030                            | £ 994          | 1.374                    | 0,17                              |
|                                    |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 14.01.2026                           | £ 100          | 136                      | 0,02                              | 6,469 % fällig am 15.09.2032                            | 400            | 547                      | 0,07                              |
|                                    |                |                          |                                   | 3,823 % fällig am 03.11.2028                           | \$ 300         | 294                      | 0,04                              | Prosus NV                                               |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Sirius Real Estate Ltd.                                |                |                          |                                   | 1,207 % fällig am 19.01.2026                            | € 1.000        | 1.167                    | 0,15                              |
|                                    |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 22.06.2026                           | € 1.100        | 1.268                    | 0,16                              | 3,680 % fällig am 21.01.2030                            | \$ 1.000       | 943                      | 0,12                              |
|                                    |                |                          |                                   | Sofina S.A.                                            |                |                          |                                   | Sabine Pass Liquefaction LLC                            |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 23.09.2028                           | 2.500          | 2.726                    | 0,34                              | 5,000 % fällig am 15.03.2027                            |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.                        |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 30.06.2026                            | 1.000          | 1.006                    | 0,13                              |
|                                    |                |                          |                                   | 3,629 % fällig am 06.04.2026                           | 2.600          | 3.085                    | 0,38                              | Sandoz Finance BV                                       |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Sun Communities Operating LP                           |                |                          |                                   | 3,970 % fällig am 17.04.2027                            | € 800          | 962                      | 0,12                              |
|                                    |                |                          |                                   | 4,200 % fällig am 15.04.2032                           | \$ 2.500       | 2.370                    | 0,29                              | Sands China Ltd.                                        |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | TP ICAP Finance PLC                                    |                |                          |                                   | 2,300 % fällig am 08.03.2027                            | \$ 200         | 192                      | 0,02                              |
|                                    |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 18.11.2028                           | £ 1.000        | 1.263                    | 0,16                              | Spirit AeroSystems, Inc.                                |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | UBS AG                                                 |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am                                       |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 0,250 % fällig am 01.09.2028                           | € 300          | 328                      | 0,04                              | 15.06.2028 (j)                                          | 1.100          | 1.082                    | 0,14                              |
|                                    |                |                          |                                   | UBS Group AG                                           |                |                          |                                   | Tesco Corporate Treasury Services PLC                   |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 24.06.2027                           |                |                          |                                   | 0,375 % fällig am 27.07.2029                            | € 900          | 959                      | 0,12                              |
|                                    |                |                          |                                   | 4,194 % fällig am 01.04.2031                           | \$ 800         | 784                      | 0,10                              | 0,875 % fällig am 29.05.2026                            | 1.600          | 1.854                    | 0,23                              |
|                                    |                |                          |                                   | 4,550 % fällig am 17.04.2026                           | 250            | 250                      | 0,03                              | Thales S.A.                                             |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am 01.03.2029                           | € 1.800        | 2.381                    | 0,30                              | 4,000 % fällig am 18.10.2025                            | 1.300          | 1.532                    | 0,19                              |
|                                    |                |                          |                                   | Unigel Netherlands Holding Corp. BV (15,000 % bar oder |                |                          |                                   | Ubisoft Entertainment S.A.                              |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 15,000 % PIK)                                          |                |                          |                                   | 0,878 % fällig am 24.11.2027                            | 1.000          | 1.059                    | 0,13                              |
|                                    |                |                          |                                   | 15,000 % fällig am                                     | \$ 131         | 4                        | 0,00                              | Unigel Luxembourg S.A. (11,000 % bar oder 12,000 % PIK) |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 31.12.2044 ^c)                                         |                |                          |                                   | 11,000 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Volkswagen Leasing GmbH                                |                |                          |                                   | 31.12.2028 (c)                                          | \$ 105         | 29                       | 0,00                              |
|                                    |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 11.10.2026                           | € 100          | 119                      | 0,01                              | 11,000 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.                                      |                |                          |                                   | 31.12.2028 ^c)                                          | 47             | 13                       | 0,00                              |
|                                    |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 26.10.2026                           | 2.400          | 2.783                    | 0,35                              | Unigel Luxembourg S.A. (13,500 % bar oder 15,000 % PIK) |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   | 4,808 % fällig am 25.07.2028                           | \$ 2.000       | 2.017                    | 0,25                              | 13,500 % fällig am                                      |                |                          |                                   |
|                                    |                |                          |                                   |                                                        |                |                          |                                   | 31.12.2027 (c)                                          | 30             | 24                       | 0,00                              |
|                                    |                |                          |                                   |                                                        |                | 83.605                   | 10,38                             |                                                         |                |                          |                                   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

|                                                       |    | PARI    |        | MARKT- | % DES                                                 |         |         |          | PARI                                                 |                                    | MARKT- | % DES  |      |      |  |
|-------------------------------------------------------|----|---------|--------|--------|-------------------------------------------------------|---------|---------|----------|------------------------------------------------------|------------------------------------|--------|--------|------|------|--|
|                                                       |    | (000S)  | WERT   | NETTO- | VERMO-                                                |         |         |          | (000S)                                               |                                    | WERT   | VERMO- |      |      |  |
|                                                       |    | (000S)  | (000S) | GENS   |                                                       |         |         |          | (000S)                                               |                                    | (000S) | GENS   |      |      |  |
| BESCHREIBUNG                                          |    |         |        |        | BESCHREIBUNG                                          |         |         |          |                                                      | BESCHREIBUNG                       |        |        |      |      |  |
| 13,500 % fällig am 31.12.2027 <sup>^(c)</sup>         | \$ | 41      | 33     | 0,00   | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA                 |         |         |          | GSMPS Mortgage Loan Trust                            |                                    |        |        |      |      |  |
| United Airlines Pass-Through Trust                    |    |         |        |        | 3,000 % fällig am 01.07.2055 -                        |         |         |          | 4,784 % fällig am 25.03.2035                         | \$                                 | 74     | \$     | 69   |      |  |
| 2,700 % fällig am 01.11.2033                          |    | 908     | 814    | 0,10   | 01.08.2055                                            | \$      | 37.200  | \$32.190 | 4,00                                                 |                                    |        |        | 0,01 |      |  |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC                     |    |         |        |        | 3,500 % fällig am 01.07.2055                          | 7.700   | 6.933   | 0,86     | GSR Mortgage Loan Trust                              |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,875 % fällig am 01.11.2033                          |    | 3.400   | 2.976  | 0,37   | 4,000 % fällig am 01.07.2055                          | 5.400   | 5.022   | 0,62     | 6,000 % fällig am 25.01.2037                         | 1.127                              | 662    | 0,08   |      |      |  |
| Vmed O2 UK Financing PLC                              |    |         |        |        | 4,500 % fällig am 01.07.2055                          | 25.100  | 24.012  | 2,98     | HarborView Mortgage Loan Trust                       |                                    |        |        |      |      |  |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032 (b)                      | €  | 1.700   | 2.025  | 0,25   | 5,000 % fällig am 01.07.2055 -                        |         |         |          | 4,812 % fällig am 19.01.2038                         | 30                                 | 26     | 0,00   |      |      |  |
| Volkswagen Group of America Finance LLC               |    |         |        |        | 01.08.2055                                            | 200.800 | 196.701 | 24,43    | 4,842 % fällig am 19.12.2036                         | 3.625                              | 2.846  | 0,35   |      |      |  |
| 5,050 % fällig am 27.03.2028                          | \$ | 700     | 704    | 0,09   | 5,500 % fällig am 01.07.2055                          | 46.500  | 46.497  | 5,78     | 6,399 % fällig am 19.10.2035                         | 423                                | 200    | 0,03   |      |      |  |
|                                                       |    |         |        |        | 6,000 % fällig am 01.08.2055                          | 159.500 | 161.941 | 20,12    | Harmony French Home Loans                            |                                    |        |        |      |      |  |
|                                                       |    |         |        |        |                                                       |         |         |          | 2,690 % fällig am 27.05.2062                         | €                                  | 4.362  | 5.132  | 0,64 |      |  |
|                                                       |    |         | 44.157 | 5,49   |                                                       |         |         |          | IndyMac Mortgage Loan Trust                          |                                    |        |        |      |      |  |
|                                                       |    |         |        |        |                                                       |         |         |          | 4,854 % fällig am 25.07.2036                         | \$                                 | 1.564  | 1.502  | 0,19 |      |  |
| VERSORGUNGSUNTERNEHMEN                                |    |         |        |        | US-SCHATZOBLIGATIONEN                                 |         |         |          |                                                      |                                    |        |        |      |      |  |
| AES Corp.                                             |    |         |        |        | U.S. Treasury Bonds                                   |         |         |          |                                                      | JPMorgan Alternative Loan Trust    |        |        |      |      |  |
| 2,450 % fällig am 15.01.2031                          |    | 3.000   | 2.624  | 0,33   | 1,875 % fällig am 15.02.2041                          | 15.600  | 10.735  | 1,33     | 4,794 % fällig am 25.06.2037                         | 3.660                              | 1.878  | 0,23   |      |      |  |
| 5,450 % fällig am 01.06.2028                          |    | 100     | 102    | 0,01   | U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)      |         |         |          | Jubilee Place BV                                     |                                    |        |        |      |      |  |
| Edison International                                  |    |         |        |        | 0,375 % fällig am 15.07.2025                          | 406     | 405     | 0,05     | 3,263 % fällig am 17.10.2057                         | €                                  | 1.020  | 1.199  | 0,15 |      |  |
| 6,250 % fällig am 15.03.2030                          |    | 500     | 508    | 0,06   | 0,625 % fällig am 15.07.2032                          | 14.462  | 13.496  | 1,68     | Landmark Mortgage Securities PLC                     |                                    |        |        |      |      |  |
| EPH Financing International A/S                       |    |         |        |        | 1,125 % fällig am 15.01.2033                          | 19.168  | 18.324  | 2,28     | 4,711 % fällig am 17.04.2044                         | €                                  | 107    | 142    | 0,02 |      |  |
| 6,651 % fällig am 13.11.2028                          | €  | 1.100   | 1.402  | 0,17   | 1,375 % fällig am 15.07.2033                          | 845     | 821     | 0,10     | Lehman XS Trust                                      |                                    |        |        |      |      |  |
| Pacific Gas & Electric Co.                            |    |         |        |        | 1,750 % fällig am 15.01.2034                          | 3.131   | 3.105   | 0,38     | 4,834 % fällig am 25.08.2046                         | \$                                 | 139    | 134    | 0,02 |      |  |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026                          | \$ | 1.300   | 1.288  | 0,16   | 1,875 % fällig am 15.07.2034                          | 16.151  | 16.173  | 2,01     | 4,884 % fällig am 25.08.2046                         | 304                                | 311    | 0,04   |      |      |  |
| 3,450 % fällig am 01.07.2025                          |    | 200     | 200    | 0,02   | 2,500 % fällig am 15.01.2029                          | 45      | 47      | 0,01     | Ludgate Funding PLC                                  |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,950 % fällig am 01.12.2047                          |    | 200     | 142    | 0,02   | U.S. Treasury Notes                                   |         |         |          | 2,175 % fällig am 01.12.2060                         | €                                  | 13     | 14     | 0,00 |      |  |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046                          |    | 300     | 215    | 0,03   | 0,250 % fällig am 30.09.2025                          | 24.400  | 24.158  | 3,00     | 4,547 % fällig am 01.12.2060                         | £                                  | 88     | 119    | 0,02 |      |  |
| Sprint LLC                                            |    |         |        |        | 0,375 % fällig am 30.11.2025                          | 15.600  | 15.351  | 1,91     | Mansard Mortgages PLC                                |                                    |        |        |      |      |  |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026                          |    | 800     | 808    | 0,10   | 4,250 % fällig am 15.11.2034                          | 40.800  | 40.946  | 5,08     | 4,616 % fällig am 15.04.2047                         |                                    | 23     | 31     | 0,00 |      |  |
| Systems Energy Resources, Inc.                        |    |         |        |        | 4,875 % fällig am 30.04.2026                          | 4.400   | 4.428   | 0,55     | 5,008 % fällig am 15.12.2049                         |                                    | 67     | 92     | 0,01 |      |  |
| 2,140 % fällig am 09.12.2025                          |    | 700     | 692    | 0,09   |                                                       |         |         |          | MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                |                                    |        |        |      |      |  |
|                                                       |    |         | 7.981  | 0,99   |                                                       |         |         |          | 6,684 % fällig am 25.11.2034                         | \$                                 | 483    | 475    | 0,06 |      |  |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel                |    | 135.743 | 16,86  |        | NON-AGENCY-MBS                                        |         |         |          |                                                      | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust |        |        |      |      |  |
| KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL                          |    |         |        |        | Adjustable Rate Mortgage Trust                        |         |         |          |                                                      | 3,824 % fällig am 25.12.2037       |        |        |      |      |  |
| Golden State, California Tobacco Securitization Corp. |    |         |        |        | 5,107 % fällig am 25.11.2035                          |         |         |          |                                                      | 232 163                            |        |        |      |      |  |
| Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021       |    |         |        |        | American Home Mortgage Investment Trust               |         |         |          | 0,02                                                 | 6,354 % fällig am 25.08.2036       | 10.236 | 1.728  | 0,22 |      |  |
| 3,000 % fällig am 01.06.2046                          |    | 315     | 277    | 0,04   | 5,014 % fällig am 25.11.2045                          | 1.169   | 1.054   | 0,13     | Mortgage Equity Conversion Asset Trust               |                                    |        |        |      |      |  |
| Golden State, California Tobacco Securitization Corp. |    |         |        |        | Banc of America Funding Trust                         |         |         |          | 10,000 % fällig am 25.05.2042                        | 140                                | 117    | 0,01   |      |      |  |
| Revenue Bonds, Series 2021                            |    |         |        |        | 4,752 % fällig am 20.02.2047                          | 497     | 477     | 0,06     | NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates      |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,487 % fällig am 01.06.2036                          |    | 1.300   | 1.085  | 0,14   | 4,812 % fällig am 20.07.2036                          | 450     | 448     | 0,06     | 6,500 % fällig am 25.02.2035                         | 390                                | 338    | 0,04   |      |      |  |
| Golden State, California Tobacco Securitization Corp. |    |         |        |        | 6,412 % fällig am 25.10.2036                          | 6       | 6       | 0,00     | New Century Alternative Mortgage Loan Trust          |                                    |        |        |      |      |  |
| Revenue Notes, Series 2021                            |    |         |        |        | Barley Hill PLC                                       |         |         |          | 4,512 % fällig am 25.10.2036                         | 484                                | 88     | 0,01   |      |      |  |
| 2,587 % fällig am 01.06.2029                          |    | 4.000   | 3.710  | 0,46   | 5,144 % fällig am 27.08.2058                          | £       | 108     | 148      | 0,02                                                 | Newgate Funding PLC                |        |        |      |      |  |
| Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia   |    |         |        |        | BCAP LLC Trust                                        |         |         |          | 2,575 % fällig am 15.12.2050                         | €                                  | 48     | 56     | 0,01 |      |  |
| Revenue Bonds, Series 2007                            |    |         |        |        | 3,498 % fällig am 26.11.2036                          | \$      | 243     | 260      | 0,03                                                 | 4,518 % fällig am 15.12.2050       | £      | 147    | 196  | 0,02 |  |
| 0,000 % fällig am 01.06.2047 (e)                      |    | 4.700   | 430    | 0,05   | 4,794 % fällig am 25.03.2037                          | 46      | 42      | 0,01     | NovaStar Mortgage Funding Trust                      |                                    |        |        |      |      |  |
| Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia   |    |         |        |        | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust           |         |         |          | 0,445 % fällig am 25.09.2046                         | \$                                 | 2.001  | 707    | 0,09 |      |  |
| Revenue Bonds, Series 2020                            |    |         |        |        | 6,530 % fällig am 25.02.2036                          | 8       | 8       | 0,00     | OBX Trust                                            |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,151 % fällig am 01.06.2032                          |    | 200     | 178    | 0,02   | 7,486 % fällig am 25.01.2035                          | 8       | 8       | 0,00     | 5,084 % fällig am 25.06.2057                         | 88                                 | 86     | 0,01   |      |      |  |
| 3,401 % fällig am 01.06.2034                          |    | 1.150   | 994    | 0,12   | Bear Stearns ALT-A Trust                              |         |         |          | Residential Accredi Loans, Inc. Trust                |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,501 % fällig am 01.06.2035                          |    | 1.700   | 1.444  | 0,18   | 4,624 % fällig am 25.09.2035                          | 83      | 34      | 0,00     | 5,750 % fällig am 25.06.2036                         | 17                                 | 14     | 0,00   |      |      |  |
|                                                       |    |         | 8.118  | 1,01   | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                   |         |         |          | 6,000 % fällig am 25.04.2036                         | 815                                | 666    | 0,08   |      |      |  |
| US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                                 |    |         |        |        | 6,180 % fällig am 25.09.2035                          | 2       | 2       | 0,00     | 6,000 % fällig am 25.06.2036                         | 110                                | 87     | 0,01   |      |      |  |
| Fannie Mae                                            |    |         |        |        | Countrywide Alternative Loan Trust                    |         |         |          | Residential Asset Securitization Trust               |                                    |        |        |      |      |  |
| 2,000 % fällig am 25.08.2052 (a)                      |    | 5.130   | 698    | 0,09   | 4,714 % fällig am 25.04.2047                          | 268     | 246     | 0,03     | 6,500 % fällig am 25.06.2037                         | 2.904                              | 568    | 0,07   |      |      |  |
| 2,500 % fällig am 25.02.2051 (a)                      |    | 1.624   | 282    | 0,03   | 4,754 % fällig am 25.09.2047                          | 27      | 25      | 0,00     | RMAC Securities PLC                                  |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,000 % fällig am 25.10.2051 (a)                      |    | 576     | 114    | 0,01   | 4,854 % fällig am 25.07.2046                          | 10      | 9       | 0,00     | 4,508 % fällig am 12.06.2044                         | £                                  | 32     | 43     | 0,01 |      |  |
| 3,500 % fällig am 25.01.2051 -                        |    |         |        |        | 5,072 % fällig am 20.12.2035                          | 771     | 728     | 0,09     | Stratton BTL Mortgage Funding PLC                    |                                    |        |        |      |      |  |
| 25.11.2051 (a)                                        |    | 13.521  | 2.378  | 0,30   | 5,399 % fällig am 25.12.2035                          | 37      | 31      | 0,00     | 5,028 % fällig am 20.01.2054                         | 3.710                              | 5.086  | 0,63   |      |      |  |
| Freddie Mac                                           |    |         |        |        | 5,500 % fällig am 25.04.2035                          | 919     | 635     | 0,08     | Structured Asset Mortgage Investments Trust          |                                    |        |        |      |      |  |
| 2,000 % fällig am 25.02.2051 -                        |    |         |        |        | 5,750 % fällig am 25.05.2036                          | 71      | 27      | 0,00     | 4,874 % fällig am 25.09.2047                         | \$                                 | 574    | 509    | 0,06 |      |  |
| 25.04.2051 (a)                                        |    | 17.276  | 1.936  | 0,24   | 6,000 % fällig am 25.11.2036                          | 120     | 62      | 0,01     | Twin Bridges PLC                                     |                                    |        |        |      |      |  |
| 2,500 % fällig am 25.05.2042 -                        |    |         |        |        | 6,000 % fällig am 25.07.2037                          | 429     | 220     | 0,03     | 5,089 % fällig am 12.03.2055                         | £                                  | 5.823  | 7.989  | 0,99 |      |  |
| 25.06.2051 (a)                                        |    | 13.155  | 1.673  | 0,21   | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust     |         |         |          | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust        |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,000 % fällig am 25.08.2050 (a)                      |    | 5.996   | 840    | 0,10   | 5,750 % fällig am 25.12.2035                          | 11      | 5       | 0,00     | 4,152 % fällig am 25.02.2037                         | \$                                 | 60     | 56     | 0,01 |      |  |
| 3,500 % fällig am 25.10.2050 -                        |    |         |        |        | 5,750 % fällig am 25.02.2037                          | 473     | 198     | 0,02     | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates |                                    |        |        |      |      |  |
| 25.12.2051 (a)                                        |    | 13.296  | 2.385  | 0,30   | 5,750 % fällig am 25.08.2037                          | 586     | 288     | 0,04     | Trust                                                |                                    |        |        |      |      |  |
| 4,500 % fällig am 25.08.2049 (a)                      |    | 2.803   | 459    | 0,06   | 6,000 % fällig am 25.07.2036                          | 258     | 125     | 0,02     | 5,034 % fällig am 25.07.2036                         | 88                                 | 56     | 0,01   |      |      |  |
| Ginnie Mae                                            |    |         |        |        | 6,500 % fällig am 25.11.2036                          | 7       | 2       | 0,00     | Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust         |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,500 % fällig am 15.07.2045                          |    | 15.226  | 14.164 | 1,76   | Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust |         |         |          | 6,490 % fällig am 25.07.2034                         | 5                                  | 5      | 0,00   |      |      |  |
| Ginnie Mae, TBA                                       |    |         |        |        | 4,622 % fällig am 19.10.2036                          | 341     | 308     | 0,04     |                                                      |                                    |        |        |      |      |  |
| 2,500 % fällig am 01.07.2055                          |    | 7.100   | 6.033  | 0,75   | EMF-UK PLC                                            | £       | 25      | 34       | 0,00                                                 | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE   |        |        |      |      |  |
| Uniform Mortgage-Backed Security                      |    |         |        |        | 5,338 % fällig am 13.03.2046                          |         |         |          | AUTOMOBILE ABS SONSTIGE                              |                                    |        |        |      |      |  |
| 3,500 % fällig am 01.12.2047 -                        |    |         |        |        | Eurohome UK Mortgages PLC                             |         |         |          | Golden Bar Securitisation SRL                        |                                    |        |        |      |      |  |
| 01.07.2048                                            |    | 10.559  | 9.611  | 1,19   | 4,508 % fällig am 15.06.2044                          | 22      | 31      | 0,00     | 3,086 % fällig am 22.09.2043                         |                                    |        |        |      |      |  |
| 6,000 % fällig am 01.04.2055                          |    | 6.654   | 6.854  | 0,85   | Eurosail PLC                                          |         |         |          | €                                                    | 1.263                              | 1.492  | 0,19   |      |      |  |
|                                                       |    |         |        |        | 5,308 % fällig am 13.06.2045                          | 107     | 147     | 0,02     | CMBS SONSTIGE                                        |                                    |        |        |      |      |  |
|                                                       |    |         |        |        |                                                       |         |         |          | LoanCore Issuer Ltd.                                 |                                    |        |        |      |      |  |
|                                                       |    |         |        |        |                                                       |         |         |          | 5,853 % fällig am 17.01.2037                         |                                    |        |        |      |      |  |
|                                                       |    |         |        |        |                                                       |         |         |          | \$                                                   | 409                                | 410    | 0,05   |      |      |  |

| BESCHREIBUNG                                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| HYPOTHEKEN SONSTIGE                                                         |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| Accredited Mortgage Loan Trust                                              |                |                          |                                   | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust  |                |                          |                                   | Sound Point CLO Ltd.                           |                |                          |                                   |
| 4,694 % fällig am 25.09.2036                                                | \$ 194         | \$ 194                   | 0,02                              | 5,234 % fällig am 25.02.2037                          | \$ 2.980       | \$ 834                   | 0,10                              | 5,644 % fällig am 26.07.2031                   | \$ 336         | \$ 336                   | 0,04                              |
| 5,379 % fällig am 25.09.2035                                                | 1.500          | 1.289                    | 0,16                              | NovaStar Mortgage Funding Trust                       |                |                          |                                   | 5,681 % fällig am 18.04.2031                   | 3.517          | 3.521                    | 0,44                              |
|                                                                             |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.05.2036                          | 20             | 20                       | 0,00                              |                                                |                | 38.888                   | 4,83                              |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                 |                |                          |                                   | Option One Mortgage Loan Trust                        |                |                          |                                   | WHOLE LOANS SICHERHEITEN                       |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.07.2036                                                | 85             | 64                       | 0,01                              | 4,574 % fällig am 25.03.2037                          | 583            | 534                      | 0,07                              |                                                |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                | 996            | 333                      | 0,04                              | 4,654 % fällig am 25.04.2037                          | 500            | 354                      | 0,04                              | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.            |                |                          |                                   |
| 5,049 % fällig am 25.12.2035                                                | 2.019          | 1.914                    | 0,24                              | 4,654 % fällig am 25.05.2037                          | 565            | 340                      | 0,04                              | 7,250 % fällig am 25.05.2036                   |                |                          |                                   |
| Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                   | 4,714 % fällig am 25.01.2037                          | 45             | 26                       | 0,00                              | Lehman XS Trust                                |                |                          |                                   |
| 5,139 % fällig am 25.11.2035                                                | 517            | 510                      | 0,06                              | 4,714 % fällig am 25.02.2037                          | 548            | 346                      | 0,04                              | 5,210 % fällig am 25.03.2037                   |                |                          |                                   |
| 5,304 % fällig am 25.01.2036                                                | 3.400          | 3.312                    | 0,41                              | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust               |                |                          |                                   | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am 25.09.2034                                                | 344            | 350                      | 0,04                              | 4,929 % fällig am 25.07.2036                          | 494            | 472                      | 0,06                              | 4,754 % fällig am 25.10.2036                   |                |                          |                                   |
| Argent Mortgage Loan Trust                                                  |                |                          |                                   | RAAC Trust                                            |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.08.2035                   |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.05.2035                                                | 61             | 54                       | 0,01                              | 5,194 % fällig am 25.10.2046                          | 74             | 73                       | 0,01                              | 44                                             |                |                          |                                   |
| Argent Securities Trust                                                     |                |                          |                                   | Residential Asset Securities Corp. Trust              |                |                          |                                   | 4,716                                          |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.05.2036                                                | 158            | 38                       | 0,01                              | 4,774 % fällig am 25.11.2036                          | 32             | 30                       | 0,00                              | 0,59                                           |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                | 89             | 80                       | 0,01                              | 5,019 % fällig am 25.03.2036                          | 220            | 219                      | 0,03                              | 119.708                                        |                |                          |                                   |
|                                                                             |                |                          |                                   | SG Mortgage Securities Trust                          |                |                          |                                   | 14,87                                          |                |                          |                                   |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                  |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.10.2036                          | 3.600          | 2.733                    | 0,34                              | STAATSEMISSIONEN                               |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.02.2037                                                | 2.604          | 2.510                    | 0,31                              | Soundview Home Loan Trust                             |                |                          |                                   | Argentina Government International Bond        |                |                          |                                   |
| 5,289 % fällig am 25.07.2034                                                | 1.033          | 1.027                    | 0,13                              | 4,634 % fällig am 25.06.2037                          | 1.975          | 1.343                    | 0,17                              | 0,750 % fällig am 09.07.2030                   |                |                          |                                   |
| 5,454 % fällig am 25.10.2035                                                | 188            | 188                      | 0,02                              | 4,934 % fällig am 25.10.2036                          | 1.075          | 1.030                    | 0,13                              | 1,000 % fällig am 09.07.2029                   |                |                          |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.08.2037                                                | 715            | 639                      | 0,08                              | 4,954 % fällig am 25.02.2037                          | 955            | 257                      | 0,03                              | 4,125 % fällig am 09.07.2035                   |                |                          |                                   |
| CIT Mortgage Loan Trust                                                     |                |                          |                                   | Structured Asset Investment Loan Trust                |                |                          |                                   | Bulgaria Government International Bond         |                |                          |                                   |
| 6,684 % fällig am 25.10.2037                                                | 3.934          | 3.975                    | 0,49                              | 5,409 % fällig am 25.01.2035                          | 1.685          | 1.568                    | 0,20                              | 3,625 % fällig am 05.09.2032                   |                |                          |                                   |
| Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates        |                |                          |                                   | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 05.03.2037                   |                |                          |                                   |
| 5,379 % fällig am 25.10.2034                                                | 25             | 25                       | 0,00                              | 4,589 % fällig am 25.09.2036                          | 4.111          | 2.522                    | 0,31                              | Colombia Government International Bond         |                |                          |                                   |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                         |                |                          |                                   | 5,939 % fällig am 25.04.2035                          | 5              | 5                        | 0,00                              | 1,000 % fällig am 28.04.2028                   |                |                          |                                   |
| 4,494 % fällig am 25.07.2045                                                | 337            | 234                      | 0,03                              | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust             |                |                          |                                   | COP 29.255.700                                 |                |                          |                                   |
| 4,604 % fällig am 25.07.2045                                                | 6.278          | 4.358                    | 0,54                              | 4,659 % fällig am 25.05.2037                          | 385            | 362                      | 0,05                              | 20.316.400                                     |                |                          |                                   |
| 4,694 % fällig am 25.03.2037                                                | 2.465          | 2.222                    | 0,28                              | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                |                          |                                   | Israel Government International Bond           |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.12.2036                                                | 92             | 33                       | 0,00                              | 5,034 % fällig am 25.04.2037                          | 3.701          | 2.687                    | 0,33                              | 5,000 % fällig am 30.10.2026                   |                |                          |                                   |
|                                                                             |                |                          |                                   | 6,159 % fällig am 25.11.2035                          | 47             | 47                       | 0,01                              | 5,625 % fällig am 19.02.2035                   |                |                          |                                   |
|                                                                             |                |                          |                                   |                                                       |                | 74.088                   | 9,20                              | Japan Finance Organization for Municipalities  |                |                          |                                   |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                           |                |                          |                                   | HYPOTHEKEN SEQUENTIELL                                |                |                          |                                   | 0,050 % fällig am 12.02.2027                   |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.06.2047                                                | 2.503          | 2.213                    | 0,28                              | Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC     |                |                          |                                   | € 1.500                                        |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.06.2035                                                | 2.807          | 2.554                    | 0,32                              | 2,985 % fällig am 25.12.2036                          |                |                          |                                   | 1.700                                          |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.11.2047                                                | 117            | 149                      | 0,02                              | ABS SONSTIGE                                          |                |                          |                                   | Japan Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 4,798 % fällig am 25.05.2036                                                | 1.073          | 1.069                    | 0,13                              | Accunia European CLO DAC                              |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 20.12.2054                   |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.05.2047                                                | 61             | 54                       | 0,01                              | 3,229 % fällig am 15.07.2030                          |                |                          |                                   | € 980.000                                      |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.09.2037                                                | 255            | 265                      | 0,03                              | Ares European CLO DAC                                 |                |                          |                                   | 2,200 % fällig am 20.03.2064                   |                |                          |                                   |
| 5,094 % fällig am 25.08.2035                                                | 182            | 179                      | 0,02                              | 3,086 % fällig am 20.04.2032                          |                |                          |                                   | 2,300 % fällig am 20.12.2054                   |                |                          |                                   |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                           |                |                          |                                   | Atlas Senior Loan Fund Ltd.                           |                |                          |                                   | Mexico Government International Bond           |                |                          |                                   |
| 5,349 % fällig am 25.01.2034                                                | 387            | 417                      | 0,05                              | 5,608 % fällig am 15.01.2031                          |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 09.02.2028                   |                |                          |                                   |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                            |                |                          |                                   | Bain Capital Euro CLO DAC                             |                |                          |                                   | \$ 1.700                                       |                |                          |                                   |
| 5,534 % fällig am 25.05.2037                                                | 2.155          | 2.111                    | 0,26                              | 3,336 % fällig am 24.01.2033                          |                |                          |                                   | 5,850 % fällig am 02.07.2032 (b)               |                |                          |                                   |
| Fieldstone Mortgage Investment Trust                                        |                |                          |                                   | Black Diamond CLO DAC                                 |                |                          |                                   | 1.300                                          |                |                          |                                   |
| 5,119 % fällig am 25.04.2047                                                | 1.708          | 1.143                    | 0,14                              | Blackrock European CLO DAC                            |                |                          |                                   | Peru Government International Bond             |                |                          |                                   |
| Fremont Home Loan Trust                                                     |                |                          |                                   | 2,899 % fällig am 15.10.2031                          |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 12.08.2034                   |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.08.2036                                                | 200            | 63                       | 0,01                              | Cairn CLO DAC                                         |                |                          |                                   | PEN 13.000                                     |                |                          |                                   |
| 4,704 % fällig am 25.10.2036                                                | 121            | 110                      | 0,01                              | 2,856 % fällig am 31.01.2030                          |                |                          |                                   | 5,940 % fällig am 12.02.2029                   |                |                          |                                   |
| 5,304 % fällig am 25.05.2034                                                | 1.159          | 1.132                    | 0,14                              | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.             |                |                          |                                   | 2.300                                          |                |                          |                                   |
| GE-WMC Mortgage Securities Trust                                            |                |                          |                                   | 5,618 % fällig am 15.10.2030                          |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 12.08.2032                   |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.08.2036                                                | 4.815          | 2.035                    | 0,25                              | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.        |                |                          |                                   | 16.200                                         |                |                          |                                   |
| GSAA Home Equity Trust                                                      |                |                          |                                   | 3,049 % fällig am 15.10.2030                          |                |                          |                                   | 6,850 % fällig am 12.08.2035                   |                |                          |                                   |
| 5,772 % fällig am 25.11.2036                                                | 446            | 123                      | 0,02                              | Contego CLO BV                                        |                |                          |                                   | 3.800                                          |                |                          |                                   |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036                                                | 1.283          | 287                      | 0,04                              | 3,049 % fällig am 15.10.2030                          |                |                          |                                   | 6,900 % fällig am 12.08.2037                   |                |                          |                                   |
| GSAMP Trust                                                                 |                |                          |                                   | Contego CLO DAC                                       |                |                          |                                   | 3.700                                          |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.11.2036                                                | 1.745          | 810                      | 0,10                              | 2,823 % fällig am 23.01.2030                          |                |                          |                                   | 6,950 % fällig am 12.08.2031                   |                |                          |                                   |
| 4,954 % fällig am 25.02.2046                                                | 429            | 401                      | 0,05                              | CVC Cordatus Loan Fund DAC                            |                |                          |                                   | 7.300 % fällig am 12.08.2033                   |                |                          |                                   |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust                                        |                |                          |                                   | 2,886 % fällig am 21.07.2030                          |                |                          |                                   | Romania Government International Bond          |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.01.2036                                                | 2.200          | 1.902                    | 0,24                              | Dryden Euro CLO DAC                                   |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 13.07.2030                   |                |                          |                                   |
| Long Beach Mortgage Loan Trust                                              |                |                          |                                   | 2,939 % fällig am 15.04.2033                          |                |                          |                                   | € 1.500                                        |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.02.2036                                                | 202            | 200                      | 0,03                              | Greenwood Park CLO Ltd.                               |                |                          |                                   | 1.514                                          |                |                          |                                   |
| 5,349 % fällig am 25.08.2035                                                | 4.270          | 3.871                    | 0,48                              | 5,548 % fällig am 15.04.2031                          |                |                          |                                   | South Africa Government International Bond     |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                      |                |                          |                                   | OZLM Ltd.                                             |                |                          |                                   | 4,850 % fällig am 30.09.2029                   |                |                          |                                   |
| 4,504 % fällig am 25.10.2036                                                | 1.324          | 578                      | 0,07                              | 5,538 % fällig am 15.04.2031                          |                |                          |                                   | \$ 2.000                                       |                |                          |                                   |
| 4,564 % fällig am 25.11.2036                                                | 1.542          | 676                      | 0,08                              | Palmer Square European Loan Funding DAC               |                |                          |                                   | 7.000 % fällig am 28.02.2031                   |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.05.2037                                                | 1.164          | 1.049                    | 0,13                              | 3,203 % fällig am 15.02.2035                          |                |                          |                                   | ZAR 267.500                                    |                |                          |                                   |
| 4,664 % fällig am 25.10.2036                                                | 1.061          | 550                      | 0,07                              | Segovia European CLO DAC                              |                |                          |                                   | 8.000 % fällig am 31.01.2030                   |                |                          |                                   |
| 4,684 % fällig am 25.07.2036                                                | 352            | 320                      | 0,04                              | 3,116 % fällig am 20.07.2032                          |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 31.03.2032                   |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.09.2036                                                | 14.358         | 4.936                    | 0,61                              | Sierra Madre Funding Ltd.                             |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 31.01.2037                   |                |                          |                                   |
| 4,894 % fällig am 25.11.2036                                                | 4.679          | 2.650                    | 0,33                              | 4,806 % fällig am 07.09.2039                          |                |                          |                                   | 9,000 % fällig am 31.01.2040                   |                |                          |                                   |
| 4,934 % fällig am 25.04.2036                                                | 80             | 76                       | 0,01                              |                                                       |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.12.2034                                                | 1.362          | 1.291                    | 0,16                              |                                                       |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                                       |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| 4,944 % fällig am 25.02.2036                                                | 1.746          | 1.654                    | 0,21                              |                                                       |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                          |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| 6,226 % fällig am 25.10.2036                                                | 254            | 69                       | 0,01                              |                                                       |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | AKTIEN       | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|--------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Air Lease Corp.                  |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 01.08.2025          | \$ 3.050       | \$ 3.038                 | 0,38                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                   |              |                          |                                   |
| 4,840 % fällig am 08.07.2025     | \$ 2.200       | \$ 2.198                 | 0,27                              | Harley-Davidson Funding Corp.         |                |                          |                                   | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |              |                          |                                   |
| 4,840 % fällig am 15.07.2025     | 600            | 599                      | 0,08                              | 5,070 % fällig am 04.08.2025          | 100            | 100                      | 0,01                              | <b>PIMCO Funds: Global</b>               |              |                          |                                   |
| Alimentation Couche-Tard, Inc.   |                |                          |                                   | HCA, Inc.                             |                |                          |                                   | Investors Series plc -                   |              |                          |                                   |
| 4,610 % fällig am 10.07.2025     | 350            | 350                      | 0,04                              | 4,950 % fällig am                     |                |                          |                                   | PIMCO Asia High Yield                    | 385.356      | 4.250                    | 0,53                              |
| 4,630 % fällig am 09.07.2025     | 350            | 350                      | 0,04                              | 15.08.2025                            | 250            | 248                      | 0,03                              | Bond Fund (h)                            |              |                          |                                   |
| 4,640 % fällig am 29.07.2025     | 250            | 249                      | 0,03                              | Holcim Finance U.S. LLC               |                |                          |                                   | <b>PIMCO Funds: Global</b>               |              |                          |                                   |
| 4,670 % fällig am 02.07.2025     | 250            | 250                      | 0,03                              | 4,670 % fällig am 15.07.2025          | 250            | 250                      | 0,03                              | Investors Series plc -                   |              |                          |                                   |
| 4,670 % fällig am 08.07.2025     | 800            | 799                      | 0,10                              | 4,670 % fällig am 16.07.2025          | 1.350          | 1.347                    | 0,17                              | Asia Strategic Interest                  | \$ 1.197.507 | \$12.550                 | 1,56                              |
| Broadcom, Inc.                   |                |                          |                                   | Jabil, Inc.                           |                |                          |                                   | Bond Fund (h)                            |              |                          |                                   |
| 4,730 % fällig am 10.07.2025     | 1.950          | 1.947                    | 0,24                              | 4,860 % fällig am 02.07.2025          | 500            | 500                      | 0,06                              | <b>PIMCO Select Funds plc -</b>          |              |                          |                                   |
| Canadian Natural Resources Ltd.  |                |                          |                                   | Jones Lang LaSalle Finance BV         |                |                          |                                   | PIMCO US Dollar Short-                   |              |                          |                                   |
| 4,830 % fällig am 11.07.2025     | 250            | 250                      | 0,03                              | 4,720 % fällig am 16.07.2025          | 250            | 249                      | 0,03                              | Term Floating NAV                        | 804.344      | 8.021                    | 0,99                              |
| 4,900 % fällig am 06.08.2025 (b) | 1.550          | 1.542                    | 0,19                              | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. |                |                          |                                   | Fund (h)                                 |              | 24.821                   | 3,08                              |
| CBRE Services, Inc.              |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 23.07.2025          | 250            | 249                      | 0,03                              |                                          |              |                          |                                   |
| 4,640 % fällig am 24.07.2025     | 500            | 498                      | 0,06                              | Summe kurzfristige Instrumente        |                | 21.150                   | 2,62                              | <b>BÖRSEGEHANDELTE FONDS</b>             |              |                          |                                   |
| 4,690 % fällig am 10.07.2025     | 300            | 300                      | 0,04                              |                                       |                |                          |                                   | <b>PIMCO ETFs plc - PIMCO</b>            |              |                          |                                   |
| Crown Castle, Inc.               |                |                          |                                   | Summe Übertragbare Wertpapiere        | \$ 1.094.925   | 136,00                   |                                   | US Dollar Short Maturity                 |              |                          |                                   |
| 5,030 % fällig am 22.07.2025     | 2.300          | 2.293                    | 0,29                              |                                       |                |                          |                                   | UCITS ETF (h)                            | 543.400      | 54.400                   | 6,76                              |
| CVS Corp.                        |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   | Summe Investmentfonds                    |              | \$ 79.221                | 9,84                              |
| 4,920 % fällig am 14.07.2025     | 1.250          | 1.248                    | 0,16                              |                                       |                |                          |                                   |                                          |              |                          |                                   |
| 4,920 % fällig am 15.07.2025     | 250            | 249                      | 0,03                              |                                       |                |                          |                                   |                                          |              |                          |                                   |
| Dominion Energy, Inc.            |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |                                          |              |                          |                                   |
| 4,600 % fällig am 18.07.2025     | 250            | 249                      | 0,03                              |                                       |                |                          |                                   |                                          |              |                          |                                   |
| 4,600 % fällig am 21.07.2025     | 250            | 249                      | 0,03                              |                                       |                |                          |                                   |                                          |              |                          |                                   |

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                  | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|--------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOS                     | 4,480 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 58.000          | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027 | \$ (59.264)                | \$ 58.000                           | \$ 58.007                                                           | 7,20                         |
| FICC                    | 4,400           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 46.600             | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027 | (47.911)                   | 46.600                              | 46.606                                                              | 5,79                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                                  | \$ (107.175)               | \$ 104.600                          | \$ 104.613                                                          | 12,99                        |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2026          | 96                      | \$ (72)                                         | (0,01)                       |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2025          | 96                      | (155)                                           | (0,02)                       |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2026          | 96                      | 18                                              | 0,00                         |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Long  | 06.2026          | 96                      | (25)                                            | 0,00                         |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2025          | 96                      | (124)                                           | (0,02)                       |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures     | Long  | 09.2025          | 1                       | 0                                               | 0,00                         |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025          | 66                      | 41                                              | 0,01                         |
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025          | 105                     | 121                                             | 0,02                         |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures             | Long  | 09.2025          | 11                      | (29)                                            | 0,00                         |
| Euro-Schatz September Futures                        | Short | 09.2025          | 450                     | 87                                              | 0,01                         |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures      | Short | 09.2025          | 43                      | (126)                                           | (0,02)                       |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 411                     | 333                                             | 0,04                         |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 619                     | 595                                             | 0,07                         |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025          | 114                     | 137                                             | 0,02                         |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025          | 1.517                   | (3.613)                                         | (0,45)                       |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025          | 7                       | (22)                                            | 0,00                         |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2025          | 10                      | (49)                                            | (0,01)                       |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025          | 93                      | 263                                             | 0,03                         |
|                                                      |       |                  |                         | \$ (2.620)                                      | (0,33)                       |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSEGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                               | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | \$ 108,500         | 25.07.2025         | 13                      | \$ (4)  | \$ 0           | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,000            | 25.07.2025         | 24                      | (10)    | (1)            | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,500            | 25.07.2025         | 10                      | (3)     | (1)            | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 110,250            | 25.07.2025         | 5                       | (1)     | (1)            | 0,00                         |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,000            | 25.07.2025         | 13                      | (4)     | (10)           | 0,00                         |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,500            | 25.07.2025         | 34                      | (13)    | (18)           | 0,00                         |

| Beschreibung                                                   | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|----------------------------------------------------------------|----------------|----------------|----------------------|---------|------------|-----------------------|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | \$ 112,750     | 25.07.2025     | 5                    | \$ (2)  | \$ (2)     | 0,00                  |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250      | 25.07.2025     | 3                    | (1)     | (1)        | 0,00                  |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500        | 25.07.2025     | 3                    | (1)     | 0          | 0,00                  |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | 129,000        | 25.07.2025     | 2                    | (1)     | (1)        | 0,00                  |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500        | 25.07.2025     | 2                    | (1)     | 0          | 0,00                  |
|                                                                |                |                |                      | \$ (41) | \$ (35)    | 0,00                  |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |                |                |                      |         | \$ (2.655) | (0,33)                |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit           | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------------|-----------------------|
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 %                     | 20.06.2027        | \$ 500                     | \$ 11                                    | 0,00                  |
| General Electric Co.      | 1,000                       | 20.06.2026        | 1.700                      | 3                                        | 0,00                  |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000                       | 20.06.2026        | 500                        | 0                                        | 0,00                  |
| Morgan Stanley            | 1,000                       | 20.12.2025        | 950                        | 0                                        | 0,00                  |
|                           |                             |                   |                            | \$ 14                                    | 0,00                  |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(2)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|------------------------------------------|-----------------------|
| CDX.HY-41 5-Year Index | (5,000) %                   | 20.12.2028        | \$ 10.068                  | \$ (163)                                 | (0,02)                |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|-----------------|-------------------|-------------|------------------------------------------|-----------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %         | 19.03.2030        | £ 68.100    | \$ 1.104                                 | 0,14                  |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,930           | 06.01.2035        | 200         | (1)                                      | 0,00                  |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,700           | 19.09.2028        | \$ 53.900   | 2.014                                    | 0,25                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,750           | 21.12.2052        | 24.900      | 4.108                                    | 0,51                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,842           | 19.09.2053        | 200         | 10                                       | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,874           | 19.09.2053        | 8.800       | 440                                      | 0,05                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,999           | 03.07.2053        | 10.500      | 3.184                                    | 0,40                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,000           | 12.02.2030        | 9.900       | 877                                      | 0,11                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,000           | 10.03.2030        | 4.900       | 347                                      | 0,04                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,060           | 27.10.2053        | 6.200       | 1.948                                    | 0,24                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 18.06.2055        | 10.100      | (231)                                    | (0,03)                |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,430           | 27.02.2033        | 1.900       | (16)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500           | 18.12.2054        | 3.100       | 301                                      | 0,04                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,545           | 31.10.2030        | 1.900       | 2                                        | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,582           | 31.10.2030        | 18.100      | (17)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,592           | 31.10.2030        | 39.400      | (61)                                     | (0,01)                |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,601           | 31.10.2030        | 3.700       | (7)                                      | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,623           | 31.10.2030        | 3.600       | (12)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,664           | 31.10.2030        | 2.400       | (13)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,677           | 31.10.2030        | 1.900       | (12)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,691           | 31.10.2030        | 2.580       | (18)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,739           | 31.10.2030        | 2.800       | (27)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 18.12.2031        | 7.630       | (55)                                     | (0,01)                |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 15.05.2032        | 37.200      | (561)                                    | (0,07)                |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 18.12.2034        | 6.390       | 120                                      | 0,01                  |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,800           | 14.07.2044        | 850         | 29                                       | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,842           | 04.03.2030        | 300         | (4)                                      | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,870           | 05.03.2035        | 400         | (4)                                      | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,874           | 05.03.2035        | 400         | (5)                                      | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,884           | 25.03.2035        | 800         | (10)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,890           | 03.03.2035        | 500         | (6)                                      | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,899           | 11.03.2035        | 600         | (8)                                      | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,905           | 12.03.2035        | 600         | (9)                                      | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,908           | 04.03.2035        | 700         | (10)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,975           | 21.03.2035        | 600         | (13)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,000           | 26.02.2035        | 550         | (12)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,100           | 10.02.2026        | 66.810      | 10                                       | 0,00                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,496          | 04.01.2027        | 34.600      | (215)                                    | (0,03)                |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 11,566          | 04.01.2027        | 183.600     | (1.095)                                  | (0,14)                |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 11,691          | 04.01.2027        | 104.500     | 582                                      | 0,07                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,175          | 02.01.2029        | 85.000      | 61                                       | 0,01                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,291          | 02.01.2029        | 5.500       | 9                                        | 0,00                  |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,354          | 02.01.2029        | 196.600     | 199                                      | 0,02                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 13,545          | 02.01.2029        | 59.700      | (120)                                    | (0,01)                |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,927          | 04.01.2027        | 53.200      | (28)                                     | 0,00                  |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                 | 14,020          | 04.01.2027        | 88.300      | 16                                       | 0,00                  |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum |     | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,500 %            | 28.04.2028            | COP | 25.111.100      | \$ (15)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 8,750              | 18.09.2030            |     | 15.846.800      | (6)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW           | 4,500              | 18.09.2034            | AUD | 59.280          | 1.092                                           | 0,14                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW           | 4,500              | 18.06.2035            |     | 13.500          | 170                                             | 0,02                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2030            | €   | 12.400          | 156                                             | 0,02                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2035            |     | 31.940          | 321                                             | 0,04                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2055            |     | 13.400          | 612                                             | 0,08                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,280              | 04.03.2030            |     | 300             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,300              | 25.09.2029            |     | 700             | (11)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,350              | 29.04.2030            |     | 800             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,360              | 07.10.2029            |     | 200             | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,400              | 09.04.2030            |     | 500             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,400              | 12.02.2035            |     | 500             | 11                                              | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,415              | 09.07.2035            |     | 15.500          | (45)                                            | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,420              | 07.03.2035            |     | 200             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,450              | 05.05.2035            |     | 200             | 3                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,460              | 13.03.2035            |     | 400             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,460              | 01.04.2035            |     | 200             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,520              | 27.03.2035            |     | 300             | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,520              | 09.04.2035            |     | 300             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,550              | 16.04.2035            |     | 400             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,576              | 09.07.2035            |     | 15.700          | 40                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,610              | 24.03.2035            |     | 300             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,700              | 13.08.2029            |     | 200             | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,750              | 05.03.2034            |     | 740             | 18                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,818              | 26.06.2029            |     | 700             | (19)                                            | 0,00                         |
|                                             |                                |                    |                       |     |                 | \$ 15.097                                       | 1,88                         |
|                                             |                                |                    |                       |     |                 | \$ 14.948                                       | 1,86                         |

Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate

- (1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,470 %            | 04.06.2035         | 2.700                          | \$ 242   | \$ 249         | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 4,470              | 04.06.2035         | 2.700                          | 242      | 237            | 0,03                         |
| DUB        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,750              | 30.10.2025         | 92.300                         | 495      | 319            | 0,04                         |
| FAR        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,750              | 01.08.2025         | 219.500                        | 1.339    | 190            | 0,02                         |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,800              | 12.07.2034         | 8.500                          | 734      | 581            | 0,07                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,800              | 12.07.2034         | 8.500                          | 735      | 871            | 0,11                         |
|            |                                       |                        |                                             |                    |                    |                                | \$ 3.787 | \$ 2.447       | 0,30                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %            | 16.07.2025         | 600                            | \$ (1)  | \$ 0           | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000              | 16.07.2025         | 900                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850              | 16.07.2025         | 1.600                          | (2)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900              | 16.07.2025         | 1.000                          | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                  |                         |                    |                    |                                | \$ (5)  | \$ 0           | 0,00                         |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|------------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,555 %            | 24.07.2025         | 300                            | \$ (1)     | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,637              | 18.07.2025         | 800                            | (3)        | (4)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,700              | 21.07.2025         | 700                            | (2)        | (6)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770              | 09.07.2025         | 800                            | (3)        | (7)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,905              | 24.07.2025         | 300                            | (1)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,037              | 18.07.2025         | 800                            | (3)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050              | 21.07.2025         | 700                            | (2)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120              | 09.07.2025         | 800                            | (3)        | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564              | 24.07.2025         | 600                            | (2)        | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605              | 23.07.2025         | 700                            | (3)        | (3)            | 0,00                         |
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914              | 24.07.2025         | 600                            | (2)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955              | 23.07.2025         | 700                            | (2)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380              | 03.07.2025         | 100                            | 0          | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 400                            | (1)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640              | 03.07.2025         | 100                            | 0          | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 400                            | (1)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 2,830              | 30.10.2025         | 92.300                         | (188)      | (54)           | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,290              | 30.10.2025         | 92.300                         | (308)      | (128)          | (0,02)                       |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 2,750              | 01.08.2025         | 219.500                        | (505)      | (4)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,250              | 01.08.2025         | 219.500                        | (834)      | (23)           | (0,01)                       |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,750              | 03.07.2025         | 1.100                          | (4)        | (8)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,790              | 09.07.2025         | 900                            | (3)        | (9)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,100              | 03.07.2025         | 1.100                          | (4)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,140              | 09.07.2025         | 900                            | (3)        | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525              | 28.07.2025         | 1.600                          | (5)        | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583              | 23.07.2025         | 300                            | (1)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653              | 14.07.2025         | 700                            | (2)        | (3)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695              | 17.07.2025         | 1.000                          | (3)        | (7)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775              | 07.07.2025         | 600                            | (2)        | (5)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875              | 28.07.2025         | 1.600                          | (5)        | (4)            | 0,00                         |
| GLM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933              | 23.07.2025         | 300                            | (1)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053              | 14.07.2025         | 700                            | (2)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095              | 17.07.2025         | 1.000                          | (3)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125              | 07.07.2025         | 600                            | (2)        | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772              | 10.07.2025         | 500                            | (2)        | (5)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122              | 10.07.2025         | 500                            | (2)        | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664              | 14.07.2025         | 500                            | (2)        | (3)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669              | 07.07.2025         | 1.000                          | (4)        | (3)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697              | 16.07.2025         | 700                            | (2)        | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715              | 02.07.2025         | 400                            | (1)        | (2)            | 0,00                         |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725              | 03.07.2025         | 600                            | (2)        | (3)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019              | 07.07.2025         | 1.000                          | (4)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064              | 14.07.2025         | 500                            | (1)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065              | 02.07.2025         | 400                            | (1)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075              | 03.07.2025         | 600                            | (2)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097              | 16.07.2025         | 700                            | (2)        | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ (1.929) | \$ (301)       | (0,04)                       |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
| MYC        |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit      | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| GST        | SoftBank Group Corp. | 1,000 %                        | 20.06.2026            | \$ 200                         | \$ (2)                                   | \$ 1                                            | \$ (1)         | 0,00                         |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| GST        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 %                        | 17.11.2059            | \$ 2.200                       | \$ (9)                                   | \$ 19                                           | \$ 10          | 0,00                         |
| MYC        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                          | 17.11.2059            | 100                            | (4)                                      | 4                                               | 0              | 0,00                         |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                          | 17.11.2059            | 1.500                          | (3)                                      | 10                                              | 7              | 0,00                         |
| UAG        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                          | 17.11.2059            | 300                            | (9)                                      | 10                                              | 1              | 0,00                         |
|            |                      |                                |                       |                                | \$ (25)                                  | \$ 43                                           | \$ 18          | 0,00                         |

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD                    | 3.068                    | \$ 1.993                         | \$ (18)                            | \$ (18)                                              | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CNH                    | 14.677                   | 2.037                            | (14)                               | (14)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.034                    | 1.718                            | 0                                  | 9                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 23.049                   | \$ 3.208                         | (22)                               | (22)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | NZD                    | 1.718                    | 1.035                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                      |
| BOA        | 08.2025               | \$                     | 1.994                    | AUD 3.068                        | 18                                 | 18                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | €                      | 104.190                  | \$ 118.470                       | 0                                  | (3.833)                                              | (0,48)                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 10.262.468               | 629                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | 21                       | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.579                    | KRW 2.152.811                    | 13                                 | 13                                                   | 0,00                      |
| BPS        | 07.2025               | ZAR                    | 253.068                  | \$ 14.119                        | 0                                  | (99)                                                 | (0,01)                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 373                      | 11                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.175                    | CNH 8.401                        | 2                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 2.370                  | MXN 44.956               | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 16                     | SGD 21                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | BRL                    | 20.230                   | \$ 3.530                         | 0                                  | (177)                                                | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 52.798.634               | 3.237                            | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | INR                    | 401.221                  | 4.690                            | 13                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | KRW                    | 14.663                   | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PEN                    | 1.008                    | 276                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                      |
| BSH        | 07.2025               | THB                    | 915                      | 28                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 69.959                   | 2.153                            | 0                                  | (255)                                                | (0,03)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 44                       | BRL 251                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 2.784                  | IDR 45.387.769           | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 2.280                  | KRW 3.132.131            | 36                               | 0                                  | 36                                                   | 0,01                      |
| CBK        | 07.2025               | 270                    | THB 8.911                | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 4.390                  | TWD 130.562              | 91                               | 0                                  | 91                                                   | 0,01                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 7.411                    | \$ 1.038                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | INR                    | 2.535                    | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD                    | 91.717                   | 2.818                            | 0                                  | (370)                                                | (0,04)                    |
| DUB        | 08.2025               | \$                     | 8.344                    | CNH 59.640                       | 14                                 | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 1.607                  | MXN 30.605               | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 99                     | TWD 3.237                | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                      |
|            | 09.2025               | 1.567                  | PEN 5.676                | 29                               | 0                                  | 29                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | €                      | 1.377                    | \$ 1.577                         | 0                                  | (40)                                                 | 0,00                      |
| BSH        | 07.2025               | £                      | 794                      | 1.074                            | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR                    | 12.899.565               | 790                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ILS                    | 786                      | 233                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 857                      | 229                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.270                    | AUD 3.512                        | 32                                 | 0                                                    | 0,00                      |
| BSH        | 07.2025               | 26.163                 | £ 19.250                 | 217                              | 0                                  | 217                                                  | 0,03                      |
|            | 07.2025               | 469                    | ILS 1.634                | 16                               | 0                                  | 16                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 899                    | KRW 1.227.694            | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 760                    | THB 24.743               | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 4.490                  | TRY 184.236              | 74                               | 0                                  | 74                                                   | 0,01                      |
| BSH        | 07.2025               | ZAR                    | 62.639                   | \$ 3.462                         | 0                                  | (57)                                                 | (0,01)                    |
|            | 08.2025               | £                      | 17.643                   | 24.009                           | 0                                  | (172)                                                | (0,02)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 7.365                    | TRY 306.883                      | 89                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 09.2025               | PEN                    | 5.969                    | \$ 1.636                         | 0                                  | (42)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | 2.070                  | 552                      | 0                                | (31)                               | (31)                                                 | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025               | \$                     | 398                      | PEN 1.435                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               | 1.198                  | 4.372                    | 32                               | 0                                  | 32                                                   | 0,00                      |
|            | 11.2025               | PEN                    | 17.742                   | \$ 4.835                         | 0                                  | (145)                                                | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 6.480.922                | 4.724                            | 0                                  | (68)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 428                      | 117                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | SEK                    | 2.440                    | 257                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB                    | 47.865                   | 1.439                            | 0                                  | (34)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 122.063                  | 3.752                            | 0                                  | (450)                                                | (0,05)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 30.716                   | BRL 177.901                      | 1.879                              | 0                                                    | 0,23                      |
|            | 07.2025               | 3.118                  | CAD 4.273                | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | 2.435                  | CNY 17.456               | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 1.750                  | £ 1.291                  | 19                               | 0                                  | 19                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 789                    | IDR 12.848.943           | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 107                    | KRW 144.967              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 816                    | PEN 2.931                | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | 2.431                  | SGD 3.125                | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 80                     | THB 2.671                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 8.244                  | TWD 245.047              | 192                              | 0                                  | 192                                                  | 0,02                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 4.673                    | \$ 650                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | INR                    | 7.172                    | 83                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
| DUB        | 08.2025               | PEN                    | 36.987                   | 10.007                           | 0                                  | (406)                                                | (0,05)                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 135.293                  | 4.152                            | 0                                  | (551)                                                | (0,07)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.831                    | INR 243.532                      | 5                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 09.2025               | PEN                    | 7.139                    | \$ 1.950                         | 0                                  | (58)                                                 | (0,01)                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 554                      | PEN 1.997                        | 7                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| DUB        | 11.2025               | PEN                    | 17.794                   | \$ 4.863                         | 0                                  | (132)                                                | (0,02)                    |
|            | 12.2025               | 1.881                  | 508                      | 0                                | (20)                               | (20)                                                 | 0,00                      |
|            | 02.2026               | 4.524                  | 1.231                    | 0                                | (36)                               | (36)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | 11                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 105.078                  | € 90.577                         | 1.245                              | 0                                                    | 0,16                      |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| FAR        | 07.2025               | \$                     | 229                      | ILS 793                          | \$ 7                               | \$ 0                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 277                      | TWD 8.230                        | 6                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | €                      | 90.378                   | \$ 105.078                       | 0                                  | (1.244)                                              | (0,15)                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 2.858                    | 33                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.352                    | INR 116.171                      | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 09.2025               | PEN                    | 9.922                    | \$ 2.719                         | 0                                  | (71)                                                 | (0,01)                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 0                        | MXN 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | AUD                    | 444                      | \$ 287                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | BRL                    | 172.524                  | 30.508                           | 0                                  | (1.102)                                              | (0,14)                    |
|            | 07.2025               | CHF                    | 824                      | 1.010                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CNH                    | 7.466                    | 1.039                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 687.588                  | 4.793                            | 33                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | 34                       | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 3.318                    | ¥ 483.004                        | 26                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.408                    | PLN 5.192                        | 28                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 7.822                    | \$ 1.093                         | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | INR                    | 4.183                    | 48                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | ¥                      | 481.228                  | 3.318                            | 0                                  | (26)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 344                      | CHF 274                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 2.151                    | CNH 15.549                       | 28                                 | 0                                                    | 0,00                      |
| GLM        | 08.2025               |                        | 13                       | SGD 17                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               |                        | 10.104                   | BRL 56.722                       | 132                                | 0                                                    | 0,02                      |
|            | 09.2025               |                        | 2.472                    | MXN 48.137                       | 55                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 09.2025               |                        | 0                        | PEN 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR                    | 753.465                  | \$ 46                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | MYR                    | 27                       | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | 6                        | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 12.738                   | 392                              | 0                                  | (47)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 187                      | IDR 3.047.817                    | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 32                       | TWD 1.049                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| IND        | 08.2025               |                        | 5                        | SGD 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 12.2025               | PEN                    | 5.108                    | \$ 1.389                         | 0                                  | (44)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 258                      | SEK 2.443                        | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SEK                    | 2.438                    | \$ 258                           | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CNH                    | 14.146                   | 1.960                            | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                      |
| JPM        | 07.2025               | CNY                    | 17.379                   | 2.420                            | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | KRW                    | 3.401.216                | 2.494                            | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | NZD                    | 1.718                    | 1.025                            | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 9.205                    | 2.451                            | 0                                  | (96)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 779                      | 606                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 70.814                   | 2.178                            | 0                                  | (260)                                                | (0,03)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.557                    | BRL 14.402                       | 82                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               |                        | 3.397                    | KRW 4.626.800                    | 24                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 2.534                    | PLN 9.365                        | 57                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               |                        | 717                      | TWD 21.289                       | 16                                 | 0                                                    | 0,00                      |
| MBC        | 07.2025               | ZAR                    | 26.920                   | \$ 1.506                         | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | BRL                    | 19.566                   | 3.427                            | 0                                  | (131)                                                | (0,02)                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 21.321                   | 2.965                            | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | INR                    | 2.827                    | 33                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD                    | 225.996                  | 6.906                            | 0                                  | (950)                                                | (0,12)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.168                    | CNH 8.348                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 11                       | SGD 14                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 2.390                    | TWD 78.260                       | 330                                | 0                                                    | 0,04                      |
|            | 07.2025               | CAD                    | 4.788                    | \$ 3.486                         | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CNH                    | 6.782                    | 941                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 31.406                   | 219                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 6.581                    | 1.757                            | 0                                  | (63)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 2.200                    | 1.712                            | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB                    | 24.027                   | 726                              | 0                                  | (14)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 33.937                   | 1.041                            | 0                                  | (127)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 375                      | CAD 515                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.010                    | CHF 824                          | 25                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 17.227                   | € 14.990                         | 369                                | 0                                                    | 0,05                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.253                    | £ 926                            | 16                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 158                      | IDR 2.559.201                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MYI        | 07.2025               |                        | 880                      | THB 28.641                       | 3                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.166                    | TWD 36.945                       | 106                                | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 08.2025               | CAD                    | 514                      | \$ 375                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 6.800                    | 941                              | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD                    | 57.543                   | 1.778                            | 0                                  | (222)                                                | (0,03)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 4.761                    | CNH 34.054                       | 11                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 280                      | SGD 361                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | €                      | 12                       | \$ 14                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 15.532                   | 108                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 6.010                    | £ 4.381                          | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
| RYL        | 07.2025               |                        | 1.114                    | ¥ 162.424                        | 10                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 7                        | PLN 27                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 7.973                    | \$ 1.114                         | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | ¥                      | 161.827                  | 1.114                            | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.029                    | CNH 14.695                       | 31                                 | 0                                                    | 0,00                      |
| SCX        | 07.2025               | CNY                    | 77                       | \$ 11                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR                    | 13.023.873               | 798                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|--------|
|            | 07.2025               | ¥                      | 171.300                  | \$ 1.203                         | \$ 17                              | \$ 17                                                | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               | PEN                    | 1.426                    | 393                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               | SGD                    | 72                       | 56                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 870                      | IDR 14.174.455                   | 3                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               |                        | 3                        | ILS 12                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               |                        | 4.680                    | INR 401.316                      | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               |                        | 13                       | ¥ 1.809                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               |                        | 10.308                   | TWD 302.129                      | 93                                 | 0                                                    | 0,01                      |        |
|            | 08.2025               | CNH                    | 64.428                   | \$ 8.993                         | 0                                  | (35)                                                 | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               | INR                    | 402.139                  | 4.680                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               | ¥                      | 1.803                    | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               | TWD                    | 18.936                   | 580                              | 0                                  | (78)                                                 | (0,01)                    |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 4.832                    | CNH 34.980                       | 70                                 | 0                                                    | 0,01                      |        |
|            | 08.2025               |                        | 11                       | CNY 77                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               |                        | 675                      | INR 57.945                       | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               |                        | 56                       | SGD 72                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
| SOG        | 07.2025               |                        | 1.857                    | ¥ 268.076                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               | INR                    | 17                       | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               | ¥                      | 267.093                  | 1.857                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
| SSB        | 07.2025               | £                      | 20.673                   | 27.992                           | 0                                  | (338)                                                | (0,04)                    |        |
|            | 11.2025               | PEN                    | 2.393                    | 649                              | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                      |        |
| UAG        | 07.2025               | IDR                    | 12.965.905               | 799                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               | ¥                      | 10.135                   | 70                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               | KRW                    | 1.225.754                | 904                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               | THB                    | 3.824                    | 115                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 799                      | IDR 12.962.526                   | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               |                        | 33                       | ILS 120                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 07.2025               |                        | 904                      | KRW 1.225.161                    | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 08.2025               |                        | 1.768                    | CNH 12.832                       | 30                                 | 0                                                    | 0,00                      |        |
|            | 09.2025               | MXN                    | 12.478                   | \$ 644                           | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                      |        |
|            |                       |                        |                          |                                  | \$ 5.773                           | \$ (12.233)                                          | \$ (6.460)                | (0,80) |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |    |       |       |       |        |      |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|----|-------|-------|-------|--------|------|
| AZD        | 07.2025               | €                      | 8.500                    | \$                               | 9.953                              | \$                                                   | 0                         | \$ | (25)  | \$    | (25)  | 0,00   |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 8.934                    | €                                | 7.863                              |                                                      | 296                       |    | 0     |       | 296   | 0,04   |      |
|            | 08.2025               |                        | 9.975                    |                                  | 8.500                              |                                                      | 25                        |    | 0     |       | 25    | 0,00   |      |
| BOA        | 07.2025               |                        | 9.501                    |                                  | 8.356                              |                                                      | 307                       |    | 0     |       | 307   | 0,04   |      |
| BPS        | 07.2025               |                        | 105                      |                                  | 91                                 |                                                      | 2                         |    | 0     |       | 2     | 0,00   |      |
| BRC        | 07.2025               | €                      | 22                       | \$                               | 25                                 |                                                      | 0                         |    | (1)   |       | (1)   | 0,00   |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 9.642                    | €                                | 8.491                              |                                                      | 325                       |    | 0     |       | 325   | 0,04   |      |
| CBK        | 07.2025               | €                      | 13                       | \$                               | 15                                 |                                                      | 0                         |    | 0     |       | 0     | 0,00   |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 39                       | €                                | 34                                 |                                                      | 0                         |    | 0     |       | 0     | 0,00   |      |
| DUB        | 07.2025               | €                      | 8.501                    | \$                               | 9.862                              |                                                      | 0                         |    | (117) |       | (117) | (0,01) |      |
|            | 08.2025               | \$                     | 9.862                    | €                                | 8.482                              |                                                      | 117                       |    | 0     |       | 117   | 0,01   |      |
| MBC        | 07.2025               | €                      | 58                       | \$                               | 66                                 |                                                      | 0                         |    | (2)   |       | (2)   | 0,00   |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 202                      | €                                | 175                                |                                                      | 3                         |    | 0     |       | 3     | 0,00   |      |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$                                                   | 1.075                     |    | \$    | (145) | \$    | 930    | 0,12 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD                              | 07.2025               | £ 173.647              | \$ 238.278               | \$ 321                           | \$ 0                               | \$ 321                                               | 0,04                      |
|                                  | 08.2025               | \$ 238.311             | £ 173.647                | 0                                | (320)                              | (320)                                                | (0,04)                    |
| BRC                              | 07.2025               | £ 191.871              | \$ 260.957               | 0                                | (1.974)                            | (1.974)                                              | (0,24)                    |
|                                  | 07.2025               | \$ 236.364             | £ 175.059                | 3.528                            | 0                                  | 3.528                                                | 0,44                      |
|                                  | 08.2025               | 250.112                | 183.799                  | 1.793                            | 0                                  | 1.793                                                | 0,22                      |
| CBK                              | 07.2025               | 63                     | 47                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
| JPM                              | 07.2025               | 248.394                | 184.381                  | 4.272                            | 0                                  | 4.272                                                | 0,53                      |
| MBC                              | 07.2025               | 5.811                  | 4.279                    | 53                               | 0                                  | 53                                                   | 0,01                      |
| SSB                              | 07.2025               | £ 182.113              | \$ 249.713               | 154                              | 0                                  | 154                                                  | 0,02                      |
|                                  | 07.2025               | \$ 248.956             | £ 183.865                | 3.003                            | 0                                  | 3.003                                                | 0,37                      |
|                                  | 08.2025               | 249.745                | 182.113                  | 0                                | (150)                              | (150)                                                | (0,02)                    |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 13.125                        | \$ (2.444)                         | \$ 10.681                                            | 1,33                      |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 7.314                                             | 0,91                      |

| BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b>                            |                |                          |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                                            | \$ 7.900       | \$ 948                   | 0,12                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte                             |                | \$ 948                   | 0,12                         |
| <b>LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                              |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                          |                |                          |                              |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>2,000 % fällig am 01.07.2055 | 46.900         | (37.138)                 | (4,61)                       |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere                                       |                | \$ (37.138)              | (4,61)                       |
| Summe Anlagen                                                         |                | \$ 1.262.163             | 156,78                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                           |                | \$ (457.100)             | (56,78)                      |
| Nettovermögen                                                         |                | \$ 805.063               | 100,00                       |

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 1.082 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.511 USD (31. Dezember 2024: 20.508 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 4.480 USD (31. Dezember 2024: 5.450 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 0                                                                        | \$ 1.090.548                                                    | \$ 4.377                                                     | \$ 1.094.925        |
| Investmentfonds                     | 79.221                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 79.221              |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 104.600                                                         | 0                                                            | 104.600             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 355                                                                         | 19.252                                                          | 0                                                            | 19.607              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 948                                                             | 0                                                            | 948                 |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (37.138)                                                        | 0                                                            | (37.138)            |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 79.576</b>                                                            | <b>\$ 1.178.210</b>                                             | <b>\$ 4.377</b>                                              | <b>\$ 1.262.163</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven<br>Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 43.898                                                                   | \$ 1.153.154                                                    | \$ 1.345                                                     | \$ 1.198.397        |
| Investmentfonds                     | 29.768                                                                      | 54.416                                                          | 0                                                            | 84.184              |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 137.100                                                         | 0                                                            | 137.100             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 245                                                                         | 14.650                                                          | 0                                                            | 14.895              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 987                                                             | 0                                                            | 987                 |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (36.516)                                                        | 0                                                            | (36.516)            |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 73.911</b>                                                            | <b>\$ 1.323.791</b>                                             | <b>\$ 1.345</b>                                              | <b>\$ 1.399.047</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities Fund (Forts.)

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOS                                | 3,750 %         | 23.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (808)          | \$ (808)                                                        | (0,10)                       |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (808)                                                        | (0,10)                       |

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum<br>30. Jun. 2025                |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 261                              | \$ 0                                  | \$ 261                              | \$ (52)                             | \$ 0                                  | \$ (52)                             |
| BOA        | (3.150)                             | 3.380                                 | 230                                 | (26)                                | 0                                     | (26)                                |
| BPS        | (606)                               | 470                                   | (136)                               | (171)                               | 40                                    | (131)                               |
| BRC        | 3.771                               | (3.860)                               | (89)                                | (578)                               | 450                                   | (128)                               |
| BSH        | (138)                               | 0                                     | (138)                               | 27                                  | 0                                     | 27                                  |
| BSS        | 0                                   | 280                                   | 280                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| CBK        | 380                                 | (270)                                 | 110                                 | 355                                 | (270)                                 | 85                                  |
| DUB        | 79                                  | 0                                     | 79                                  | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 |
| FAR        | (715)                               | 340                                   | (375)                               | 446                                 | (360)                                 | 86                                  |
| GLM        | (112)                               | 0                                     | (112)                               | 1.406                               | (1.300)                               | 106                                 |
| GST        | 9                                   | 0                                     | 9                                   | 214                                 | (600)                                 | (386)                               |
| IND        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (33)                                | 0                                     | (33)                                |
| JPM        | 3.245                               | (3.240)                               | 5                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MBBC       | 105                                 | 0                                     | 105                                 | (107)                               | 820                                   | 713                                 |
| MYC        | 1.436                               | 10                                    | 1.446                               | 1.561                               | 10                                    | 1.571                               |
| MYI        | (9)                                 | (50)                                  | (59)                                | (643)                               | 630                                   | (13)                                |
| RBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 45                                  | 0                                     | 45                                  |
| RYL        | 31                                  | 0                                     | 31                                  | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 |
| SAL        | 7                                   | 0                                     | 7                                   | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| SCX        | 56                                  | 0                                     | 56                                  | (3.425)                             | 3.500                                 | 75                                  |
| SOG        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (84)                                | 0                                     | (84)                                |
| SSB        | 2.646                               | (2.770)                               | (124)                               | (12)                                | 0                                     | (12)                                |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (32)                                | 0                                     | (32)                                |
| UAG        | 18                                  | 0                                     | 18                                  | (101)                               | 0                                     | (101)                               |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 29,60             | 18,39             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 29,94             | 36,39             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,39              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 4,34              | 3,86              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 5,73              | 6,28              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,09              | 0,15              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,97              | 0,84              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,23              | 0,36              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,05              | 0,04              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 27,66             | 33,69             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert              | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,75              | 0,74              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel   | 16,86             | 21,67             |
| Kommunalanleihen und Wechsel       | 1,01              | 0,94              |
| US-Regierungsbehörden              | 64,68             | 67,87             |
| US-Schatzobligationen              | 18,38             | 17,56             |
| Non-Agency-MBS                     | 4,91              | 5,02              |
| Forderungsbefristete Wertpapiere   | 14,87             | 15,96             |
| Staatsemissionen                   | 11,91             | 6,99              |
| Stammaktien                        | 0,00              | 5,20              |
| Vorzugswertpapiere                 | 0,01              | 0,01              |
| Kurzfristige Instrumente           | 2,62              | 0,06              |
| Investmentfonds                    | 9,84              | 9,98              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 12,99             | 16,25             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | (0,33)            | 0,29              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | (0,02)            | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | k. A.             | (0,02)            |
| Zinsswaps                                                                              | 1,88              | 1,64              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,30              | 0,27              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,04)            | (0,08)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,00              | 0,00              |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere                                                     | k. A.             | 0,03              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,80)            | 0,59              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,45              | (0,95)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,12              | 0,09              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (4,61)            | (4,33)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (56,78)           | (65,78)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities ESG Fund

| BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                         |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   |                                                                                  |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                               |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   |                                                                                  |                |                          |                                   |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>6,069 % fällig am 08.11.2030     | \$             | 20                       | 0,35                              | Toronto-Dominion Bank<br>5,264 % fällig am 11.12.2026                 | \$             | 20                       | 0,35                              | Public Service Enterprise Group, Inc.<br>4,900 % fällig am 15.03.2030            | \$             | 10                       | 0,17                              |
|                                                                         |                |                          |                                   | Volkswagen Leasing GmbH<br>3,625 % fällig am 11.10.2026               | €              | 30                       | 0,63                              | Verizon Communications, Inc.<br>1,500 % fällig am 18.09.2030                     |                | 25                       | 0,39                              |
|                                                                         |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 11.04.2031                                          |                | 30                       | 0,63                              | Vodafone Group PLC<br>5,125 % fällig am 04.06.2081                               |                | 18                       | 0,24                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                 |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.<br>4,540 % fällig am 15.08.2026                     | \$             | 50                       | 0,88                              |                                                                                  |                | 452                      | 7,92                              |
| <b>BANKEN UND FINANZEN</b>                                              |                |                          |                                   | Weyerhaeuser Co.<br>4,750 % fällig am 15.05.2026                      |                | 36                       | 0,63                              | Summe Unternehmensanleihen und<br>Wechsel                                        |                | 2.716                    | 47,61                             |
| Aflac, Inc.<br>1,125 % fällig am 15.03.2026                             |                | 19                       | 0,33                              |                                                                       |                | 1.671                    | 29,29                             | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                                     |                |                          |                                   |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc.<br>2,950 % fällig am 15.03.2034   |                | 14                       | 0,21                              | <b>INDUSTRIEWERTE</b>                                                 |                |                          |                                   | Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,000 % fällig am 01.07.2053                 |                | 88                       | 1,44                              |
| American Tower Corp.<br>1,450 % fällig am 15.09.2026                    |                | 36                       | 0,61                              | Ball Corp.<br>2,875 % fällig am 15.08.2030                            |                | 16                       | 0,26                              | 5,000 % fällig am 01.05.2053 -<br>01.10.2053                                     |                | 463                      | 7,99                              |
| Bank of America Corp.<br>4,623 % fällig am 09.05.2029                   |                | 30                       | 0,53                              | Elevance Health, Inc.<br>2,550 % fällig am 15.03.2031                 |                | 28                       | 0,44                              | 5,000 % fällig am 01.10.2053 (b)                                                 |                | 914                      | 15,79                             |
| Commerzbank AG<br>3,625 % fällig am 14.01.2032                          | €              | 100                      | 2,07                              | FactSet Research Systems, Inc.<br>3,450 % fällig am 01.03.2032        |                | 18                       | 0,28                              | 5,500 % fällig am 01.08.2053                                                     |                | 89                       | 1,56                              |
| Cooperative Rabobank UA<br>4,875 % fällig am 01.11.2030                 | £              | 100                      | 2,42                              | Ford Motor Co.<br>6,100 % fällig am 19.08.2032                        |                | 10                       | 0,17                              | 6,000 % fällig am 01.10.2054                                                     |                | 463                      | 8,26                              |
| Corebridge Financial, Inc.<br>3,850 % fällig am 05.04.2029              | \$             | 18                       | 0,32                              | HCA, Inc.<br>3,625 % fällig am 15.03.2032                             |                | 28                       | 0,46                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>3,500 % fällig am 01.07.2055            |                | 220                      | 3,47                              |
| Equinix, Inc.<br>1,000 % fällig am 15.09.2025                           |                | 28                       | 0,49                              | Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>3,750 % fällig am 01.05.2029   |                | 18                       | 0,30                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055                                                     |                | 750                      | 12,89                             |
| 1,550 % fällig am 15.03.2028                                            |                | 30                       | 0,49                              | MSCI, Inc.<br>3,625 % fällig am 01.09.2030                            |                | 22                       | 0,37                              | 5,500 % fällig am 01.08.2055                                                     |                | 50                       | 0,88                              |
| Equitable Financial Life Global Funding<br>1,300 % fällig am 12.07.2026 |                | 28                       | 0,47                              | Norsk Hydro ASA<br>3,625 % fällig am 23.01.2032                       | €              | 100                      | 2,07                              |                                                                                  |                | 2.981                    | 52,28                             |
| Europäische Investitionsbank<br>2,375 % fällig am 24.05.2027            |                | 67                       | 1,14                              | NTT Finance Corp.<br>0,082 % fällig am 13.12.2025                     |                | 100                      | 2,03                              | <b>US-SCHATZOBIGATIONEN</b>                                                      |                |                          |                                   |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,387 % fällig am 15.06.2027               |                | 49                       | 0,86                              | Nucor Corp.<br>4,300 % fällig am 23.05.2027                           | \$             | 10                       | 0,17                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)<br>1,125 % fällig am 15.01.2033 |                | 54                       | 0,90                              |
| HAT Holdings LLC<br>3,375 % fällig am 15.06.2026                        |                | 16                       | 0,28                              | NXP BV<br>2,500 % fällig am 11.05.2031                                |                | 50                       | 0,77                              | 1,375 % fällig am<br>15.07.2033 (c)                                              |                | 344                      | 5,87                              |
| HSBC Holdings PLC<br>5,750 % fällig am 20.12.2027                       | £              | 16                       | 0,40                              | S&P Global, Inc.<br>4,750 % fällig am 01.08.2028                      |                | 48                       | 0,86                              | U.S. Treasury Notes<br>4,250 % fällig am<br>15.11.2034 (c)                       |                | 248                      | 4,36                              |
| Hudson Pacific Properties LP<br>5,950 % fällig am 15.02.2028            | \$             | 10                       | 0,17                              | VMware LLC<br>3,900 % fällig am 21.08.2027                            |                | 18                       | 0,32                              |                                                                                  |                | 635                      | 11,13                             |
| JPMorgan Chase & Co.<br>2,947 % fällig am 24.02.2028                    |                | 52                       | 0,89                              | Walt Disney Co.<br>2,200 % fällig am 13.01.2028                       |                | 52                       | 0,88                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                          |                |                          |                                   |
| 6,070 % fällig am 22.10.2027                                            |                | 50                       | 0,89                              | Warnermedia Holdings, Inc.<br>4,054 % fällig am 15.03.2029            |                | 28                       | 0,46                              | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                                                   |                |                          |                                   |
| Kilroy Realty LP<br>2,650 % fällig am 15.11.2033                        |                | 20                       | 0,28                              | Western Digital Corp.<br>4,750 % fällig am 15.02.2026                 |                | 4                        | 0,07                              | Bumper NL BV<br>2,539 % fällig am 21.03.2036                                     | €              | 100                      | 2,06                              |
| Manulife Financial Corp.<br>3,703 % fällig am 16.03.2032                |                | 26                       | 0,44                              | Xylem, Inc.<br>1,950 % fällig am 30.01.2028                           |                | 30                       | 0,49                              | <b>ABS SONSTIGE</b>                                                              |                |                          |                                   |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.<br>3,741 % fällig am 07.03.2029    |                | 50                       | 0,86                              |                                                                       |                | 593                      | 10,40                             | Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.<br>5,699 % fällig am 11.04.2045         | \$             | 200                      | 3,51                              |
| Mizuho Financial Group, Inc.<br>3,490 % fällig am 05.09.2027            | €              | 100                      | 2,10                              | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                                         |                |                          |                                   | St. Paul's CLO DAC<br>3,029 % fällig am 15.01.2032                               | €              | 46                       | 0,93                              |
| Morgan Stanley<br>6,407 % fällig am 01.11.2029                          | \$             | 25                       | 0,46                              | AES Corp.<br>5,450 % fällig am 01.06.2028                             |                | 20                       | 0,35                              |                                                                                  |                | 253                      | 4,44                              |
| NatWest Group PLC<br>4,067 % fällig am 06.09.2028                       | €              | 100                      | 2,12                              | Clearway Energy Operating LLC<br>3,750 % fällig am 15.02.2031         |                | 14                       | 0,23                              |                                                                                  |                | 371                      | 6,50                              |
| Pacific Life Global Funding<br>1,375 % fällig am 14.04.2026             | \$             | 19                       | 0,33                              | Duke Energy Florida LLC<br>2,500 % fällig am 01.12.2029               |                | 54                       | 0,88                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                          |                |                          |                                   |
| Prologis International Funding S.A.<br>0,875 % fällig am 09.07.2029     | €              | 125                      | 2,37                              | Electricite de France S.A.<br>4,125 % fällig am 17.06.2031            | €              | 100                      | 2,14                              | Japan Government International Bond<br>2,200 % fällig am 20.03.2064              | ¥              | 7.000                    | 0,68                              |
| Santander Holdings USA, Inc.<br>5,807 % fällig am 09.09.2026            | \$             | 30                       | 0,53                              | Eurogrid GmbH<br>3,075 % fällig am 18.10.2027                         |                | 100                      | 2,09                              | Peru Government International Bond<br>5,400 % fällig am 12.08.2034               | PEN            | 400                      | 1,88                              |
| SBA Communications Corp.<br>3,875 % fällig am 15.02.2027                |                | 18                       | 0,32                              | New York State Electric & Gas Corp.<br>5,650 % fällig am 15.08.2028   | \$             | 30                       | 0,54                              | 6,900 % fällig am 12.08.2037                                                     |                | 100                      | 0,51                              |
| Starwood Property Trust, Inc.<br>6,500 % fällig am 15.10.2030           |                | 10                       | 0,18                              | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>1,900 % fällig am 15.06.2028 |                | 54                       | 0,89                              | 6,950 % fällig am 12.08.2031                                                     |                | 81                       | 0,44                              |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.<br>5,500 % fällig am 09.03.2028         |                | 200                      | 3,61                              |                                                                       |                |                          |                                   | Romania Government International Bond<br>5,375 % fällig am 22.03.2031            | €              | 30                       | 0,61                              |
|                                                                         |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031       | ZAR            | 2.200                    | 2,00                              |
|                                                                         |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 31.01.2030                                                     |                | 900                      | 0,88                              |
|                                                                         |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | 8,250 % fällig am 31.03.2032                                                     |                | 100                      | 0,09                              |
|                                                                         |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | 9,000 % fällig am 31.01.2040                                                     |                | 300                      | 0,24                              |
|                                                                         |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   |                                                                                  |                | 418                      | 7,33                              |
|                                                                         |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | Summe Übertragbare Wertpapiere                                                   | \$             | 7.141                    | 125,20                            |

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**FUTURES**

| Beschreibung                                         | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2026          | 1                       | \$ (1)                                          | (0,02)                       |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2025          | 1                       | (2)                                             | (0,04)                       |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2026          | 1                       | 0                                               | 0,00                         |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Long  | 06.2026          | 1                       | 0                                               | 0,00                         |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2025          | 1                       | (1)                                             | (0,02)                       |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025          | 5                       | 3                                               | 0,05                         |
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025          | 1                       | 1                                               | 0,02                         |
| Euro-Schatz September Futures                        | Short | 09.2025          | 3                       | 1                                               | 0,02                         |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 2                       | 2                                               | 0,04                         |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 7                       | 7                                               | 0,12                         |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025          | 1                       | 2                                               | 0,04                         |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025          | 5                       | (13)                                            | (0,23)                       |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2025          | 2                       | (10)                                            | (0,17)                       |
|                                                      |       |                  |                         | <b>\$ (11)</b>                                  | <b>(0,19)</b>                |

**VERKAUFSOPTIONEN****FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung                                                   | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld       | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|---------------|----------------|------------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 109,500         | 25.07.2025         | 1                       | \$ (1)        | \$ 0           | 0,00                         |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500            | 25.07.2025         | 1                       | 0             | (1)            | (0,02)                       |
|                                                                |                    |                    |                         | <b>\$ (1)</b> | <b>\$ (1)</b>  | <b>(0,02)</b>                |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |                    |                    |                         |               | <b>\$ (12)</b> | <b>(0,21)</b>                |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 550           | \$ 9                                            | 0,16                         |
| Erhalt                                         | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,000              | 18.06.2030            | ¥ 25.000        | (2)                                             | (0,04)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,250              | 18.06.2035            | 10.000          | (1)                                             | (0,02)                       |
| Zahlung                                        | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,500              | 19.03.2055            | 2.500           | (1)                                             | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,250              | 18.06.2055            | \$ 70           | (2)                                             | (0,04)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,582              | 31.10.2030            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,592              | 31.10.2030            | 300             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,602              | 31.10.2030            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,606              | 31.10.2030            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,687              | 31.10.2030            | 100             | (1)                                             | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,722              | 31.10.2030            | 100             | (1)                                             | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 18.12.2029            | 200             | (3)                                             | (0,05)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 18.12.2031            | 85              | (1)                                             | (0,02)                       |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 15.05.2032            | 200             | (3)                                             | (0,05)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,750              | 18.12.2034            | 285             | 5                                               | 0,09                         |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,800              | 14.07.2044            | 10              | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 4,100              | 10.02.2026            | 600             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                    | 10,768             | 04.01.2027            | BRL 1.400       | (12)                                            | (0,20)                       |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                    | 11,496             | 04.01.2027            | 200             | (1)                                             | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                    | 11,691             | 04.01.2027            | 800             | 4                                               | 0,07                         |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                    | 13,175             | 02.01.2029            | 500             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                    | 13,354             | 02.01.2029            | 1.500           | 2                                               | 0,04                         |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                    | 13,545             | 02.01.2029            | 400             | (1)                                             | (0,02)                       |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                    | 13,927             | 04.01.2027            | 300             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Year BRL-CDI                    | 14,020             | 04.01.2027            | 600             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW              | 4,500              | 18.09.2034            | AUD 450         | 7                                               | 0,12                         |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW              | 4,500              | 18.06.2035            | 75              | 1                                               | 0,02                         |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250              | 17.09.2030            | € 200           | 3                                               | 0,05                         |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250              | 17.09.2035            | 240             | 1                                               | 0,02                         |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,250              | 17.09.2055            | 100             | 4                                               | 0,07                         |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,415              | 09.07.2035            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR               | 2,576              | 09.07.2035            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
|                                                |                                   |                    |                       |                 | <b>\$ 7</b>                                     | <b>0,12</b>                  |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                   |                    |                       |                 | <b>\$ 7</b>                                     | <b>0,12</b>                  |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities ESG Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| CBK        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,750 %            | 30.10.2025         | 500                            | \$ 3   | \$ 2           | 0,03                         |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,800              | 12.07.2034         | 100                            | 8      | 7              | 0,12                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,800              | 12.07.2034         | 100                            | 9      | 10             | 0,17                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ 20  | \$ 19          | 0,32                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| CBK        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 2,830 %            | 30.10.2025         | 500                            | \$ (1)  | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,290              | 30.10.2025         | 500                            | (2)     | (1)            | (0,02)                       |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,664              | 14.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,064              | 14.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                            |                                             |                    |                    |                                | \$ (3)  | \$ (1)         | (0,02)                       |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOA        | 07.2025               | € 1.111                | \$ 1.263                 | \$ 0                             | \$ (42)                            | \$ (42)                                              | (0,74)                       |
|            | 07.2025               | IDR 334.731            | \$ 21                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 24                  | KRW 32.539               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | 16                     | MXN 305                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025               | BRL 115                | \$ 20                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | (0,02)                       |
|            | 07.2025               | IDR 714.201            | 44                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | INR 2.566              | 30                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB 7                  | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 25                  | IDR 404.026              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 20                     | KRW 27.474               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 10                     | THB 331                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 30                     | TWD 892                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                         |
|            | 08.2025               | 11                     | MXN 208                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               | £ 5                    | \$ 7                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | IDR 78.663             | 5                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 14                  | AUD 22                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 169                    | £ 124                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                         |
|            | 07.2025               | 0                      | ¥ 64                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 8                      | KRW 11.485               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 10                     | THB 326                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ZAR 412                | \$ 23                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | £ 124                  | 169                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | (0,02)                       |
| CBK        | 07.2025               | KRW 80.341             | 58                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | (0,02)                       |
|            | 07.2025               | THB 338                | 10                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 20                  | CAD 27                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 29                     | € 25                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                         |
|            | 07.2025               | 19                     | IDR 301.573              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 1                      | KRW 1.357                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 57                     | SGD 73                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 60                     | TWD 1.789                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                         |
|            | 08.2025               | 19                     | INR 1.634                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 07.2025               | 1.218                  | € 1.050                  | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,26                         |
|            | 07.2025               | 2                      | TWD 51                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | € 1.048                | \$ 1.218                 | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | (0,26)                       |
|            | 08.2025               | \$ 9                   | INR 767                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | MXN 0                  | \$ 0                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| FAR        | 07.2025               | AUD 34                 | 22                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | BRL 404                | 73                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | (0,02)                       |
|            | 07.2025               | CHF 6                  | 7                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥ 548                  | 4                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD 1                  | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 8                   | AUD 12                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 75                     | BRL 429                  | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,09                         |
|            | 07.2025               | 8                      | CHF 6                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 16                     | ¥ 2.253                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 4                      | SEK 40                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CHF 6                  | \$ 8                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$ 22                  | AUD 34                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | 4                      | ¥ 546                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | 73                     | BRL 410                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                         |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| GLM        | 09.2025               | \$ 15                  | MXN 297                  | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR 4.600              | \$ 0                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD 4.924              | \$ 151                   | 0                                | (19)                               | (19)                                                 | (0,33)                    |
| IND        | 07.2025               | \$ 4                   | IDR 71.535               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ZAR 1.982              | \$ 111                   | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | SEK 40                 | \$ 4                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| JPM        | 08.2025               | \$ 4                   | SEK 40                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | KRW 28.676             | \$ 21                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD 23                 | \$ 18                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MBC        | 07.2025               | \$ 16                  | BRL 89                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 31                     | KRW 41.836               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 0                      | PLN 2                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 5                      | TWD 159                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ZAR 201                | \$ 11                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | BRL 116                | \$ 20                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | (0,02)                    |
|            | 08.2025               | TWD 970                | \$ 30                    | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | (0,07)                    |
|            | 07.2025               | CAD 35                 | \$ 25                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | € 9                    | \$ 10                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD 55                 | \$ 43                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB 170                | \$ 5                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 6                   | CAD 8                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 52                     | € 45                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                      |
|            | 07.2025               | 4                      | IDR 60.063               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 1                      | ¥ 72                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MYI        | 07.2025               | 3                      | SGD 3                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 10                     | THB 324                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 8                      | TWD 262                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                      |
|            | 08.2025               | CAD 8                  | \$ 6                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD 3                  | \$ 3                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               | PEN 582                | \$ 160                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | (0,05)                    |
|            | 07.2025               | ¥ 174                  | \$ 1                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 0                   | ¥ 51                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 1                      | \$ 173                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR 79.399             | \$ 5                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SCX        | 07.2025               | ¥ 1.400                | \$ 10                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 20                  | IDR 332.669              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 30                     | INR 2.567                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 1                      | SGD 1                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 75                     | TWD 2.206                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                      |
|            | 08.2025               | INR 2.572              | \$ 30                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD 1                  | \$ 1                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 4                   | INR 383                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SOG        | 07.2025               | ¥ 25                   | \$ 0                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 0                   | ¥ 25                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SSB        | 07.2025               | £ 119                  | \$ 161                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | (0,04)                    |
|            | 07.2025               | \$ 7                   | KRW 9.653                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| UAG        | 08.2025               | 16                     | TWD 523                  | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,05                      |
|            | 07.2025               | IDR 79.046             | \$ 5                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | KRW 11.467             | \$ 8                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB 27                 | \$ 1                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| WST        | 07.2025               | \$ 5                   | IDR 79.025               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 8                      | KRW 11.461               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥ 291                  | \$ 2                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 2                   | ¥ 290                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 31                            | \$ (91)                            | \$ (60)                                              | (1,05)                    |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BOA        | 07.2025               | \$ 95                  | € 83                     | \$ 2                             | \$ 0                               | \$ 2                                                 | 0,04                      |
| BRC        | 07.2025               | 94                     | 83                       | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,05                      |
| CBK        | 07.2025               | 2                      | 2                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MBC        | 07.2025               | 88                     | 77                       | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,05                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 8                             | \$ 0                               | \$ 8                                                 | 0,14                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BRC        | 07.2025               | £ 75                   | \$ 102                   | \$ 0                             | \$ (1)                             | \$ (1)                                               | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | \$ 94                  | £ 69                     | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,04                      |
|            | 08.2025               | 102                    | 75                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                      |
| JPM        | 07.2025               | 100                    | 74                       | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,04                      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Opportunities ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| MBC                              | 07.2025               | \$ 4                   | £ 3                      | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
| SSB                              | 07.2025               | £ 75                   | \$ 102                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|                                  | 07.2025               | \$ 100                 | £ 74                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,02                         |
|                                  | 08.2025               | 102                    | 75                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 6                             | \$ (1)                             | \$ 5                                                 | 0,10                         |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (29)                                              | (0,51)                       |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 7.107                                             | 124,60                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (1.403)                                           | (24,60)                      |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 5.704                                             | 100,00                       |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 792 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheit verpfändet.

(c) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 582 USD (31. Dezember 2024: 101 USD) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 115 USD (31. Dezember 2024: 115 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 6.941                                                        | \$ 200                                                       | \$ 7.141  |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 4                                                                           | (38)                                                            | 0                                                            | (34)      |
| Summen                        | \$ 4                                                                        | \$ 6.903                                                        | \$ 200                                                       | \$ 7.107  |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 6.746                                                        | \$ 0                                                         | \$ 6.746  |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 5                                                                           | 46                                                              | 0                                                            | 51        |
| Summen                        | \$ 5                                                                        | \$ 6.792                                                        | \$ 0                                                         | \$ 6.797  |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOS                                | 4,490 %         | 30.06.2025            | 14.07.2025            | \$ (770)          | \$ (770)                                                        | (13,50)                      |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (770)                                                        | (13,50)                      |

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                            | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Zahlbar für<br>Rückkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|------------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| TDL                                   | 4,450 %         | 04.06.2025            | 25.07.2025            | \$ (203)          | \$ (204)                                                               | (3,57)                       |
|                                       | 4,450           | 12.06.2025            | 03.07.2025            | (373)             | (373)                                                                  | (6,55)                       |
| Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (577)                                                               | (10,12)                      |

<sup>(1)</sup> In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 1 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| BOA        | \$ (40)                             | \$ 0                                  | \$ (40)                             | \$ 0                                | \$ 0                                  | \$ 0                                |
| BRC        | 5                                   | 0                                     | 5                                   | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 |
| CBK        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | 0                                   | 0                                     | 0                                   |
| FAR        | 5                                   | 0                                     | 5                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| GLM        | (20)                                | 0                                     | (20)                                | (5)                                 | 0                                     | (5)                                 |
| JPM        | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MBC        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | 15                                  | 0                                     | 15                                  |
| MYC        | 17                                  | 0                                     | 17                                  | 18                                  | 0                                     | 18                                  |
| MYI        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 0                                   | 0                                     | 0                                   |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 0                                   | 0                                     | 0                                   |
| SCX        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | (2)                                 | 0                                     | (2)                                 |
| SSB        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | 0                                   | 0                                     | 0                                   |
| UAG        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 0                                   | 0                                     | 0                                   |
| WST        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 0                                   | 0                                     | 0                                   |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 42,18             | 41,19             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 43,97             | 43,01             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,19              | 0,23              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,44              | 0,59              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,77              | 0,49              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 12,45             | 14,49             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                      | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                         | 0,35              | 0,37              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                           | 47,61             | 41,87             |
| US-Regierungsbehörden                                      | 52,28             | 55,50             |
| US-Schatzobligationen                                      | 11,13             | 18,60             |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                           | 6,50              | 3,10              |
| Staatsemissionen                                           | 7,33              | 4,64              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                   |                   |
| Futures                                                    | (0,19)            | 0,20              |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,02)            | k. A.             |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                        |                   |                   |
| Zinsswaps                                                  | 0,12              | 0,27              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                 |                   |                   |
| Optionskauf                                                |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | 0,32              | 0,35              |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                           | (0,02)            | (0,05)            |
| Devisenterminkontrakte                                     | (1,05)            | 0,30              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                        | 0,24              | (0,14)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                | (24,60)           | (25,01)           |
| Nettovermögen                                              | 100,00            | 100,00            |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

| BESCHREIBUNG             | AKTIEN  | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                        | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------|---------|---------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE |         |                           |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL          |                 |                           |                                   |                                     |                 |                           |                                   |
| KANADA                   |         |                           |                                   | Tidewater, Inc.                           |                 |                           |                                   |                                     |                 |                           |                                   |
| STAMMAKTIE               |         |                           |                                   | 4,320 % fällig am 21.10.2025 (b)(c)       |                 |                           |                                   | \$ 5.500                            | \$ 5.428        | 3,10                      |                                   |
| Enbridge, Inc.           | 142.500 | \$ 6.449                  | 3,69                              | 9,125 % fällig am 15.07.2030 (a)          | \$ 40           | \$ 41                     | 0,02                              | 4,322 % fällig am 22.07.2025 (b)(c) | 2.900           | 2.893                     | 1,65                              |
| TC Energy Corp.          | 135.200 | 6.587                     | 3,76                              | Venture Global LNG, Inc.                  |                 |                           |                                   | 4,324 % fällig am 21.10.2025 (b)(c) | 3.000           | 2.961                     | 1,69                              |
| Summe Kanada             |         | 13.036                    | 7,45                              | 9,875 % fällig am 01.02.2032              | 2.350           | 2.539                     | 1,45                              | 4,334 % fällig am 07.10.2025 (b)(c) | 1.800           | 1.779                     | 1,02                              |
|                          |         |                           |                                   |                                           |                 | 2.580                     | 1,47                              | 4,337 % fällig am 07.10.2025 (b)(c) | 39.300          | 38.851                    | 22,20                             |
| USA                      |         |                           |                                   | KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG        |                 |                           |                                   |                                     |                 |                           |                                   |
| STAMMAKTIE               |         |                           |                                   | Rockpoint Gas Storage Partners LP         |                 |                           |                                   |                                     |                 |                           |                                   |
| ENERGIE                  |         |                           |                                   | 7,296 % fällig am 18.09.2031              | 1.493           | 1.500                     | 0,86                              | Summe kurzfristige Instrumente      |                 | 89.686                    | 51,25                             |
| Cheniere Energy, Inc.    | 23.733  | 5.779                     | 3,30                              | Summe USA                                 |                 | 53.248                    | 30,42                             | Summe Übertragbare Wertpapiere      |                 | \$ 155.970                | 89,12                             |
| DTE Midstream LLC        | 32.400  | 3.561                     | 2,03                              | KURZFRISTIGE INSTRUMENTE                  |                 |                           |                                   |                                     |                 |                           |                                   |
| EQT Corp.                | 103.500 | 6.036                     | 3,45                              | U.S. TREASURY BILLS                       |                 |                           |                                   |                                     |                 |                           |                                   |
| Expand Energy Corp.      | 51.600  | 6.034                     | 3,45                              | 4,291 % fällig am 25.09.2025 (b)(c)       | 4.100           | 4.059                     | 2,32                              | AKTIEN                              |                 |                           |                                   |
| Hess Midstream LP 'A'    | 196.870 | 7.582                     | 4,33                              | 4,297 % fällig am 25.09.2025 (b)(c)       | 1.800           | 1.782                     | 1,02                              | INVESTMENTFONDS                     |                 |                           |                                   |
| Kinder Morgan, Inc.      | 207.000 | 6.086                     | 3,48                              | 4,303 % fällig am 15.07.2025 (b)(c)       | 1.700           | 1.697                     | 0,97                              | ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN   |                 |                           |                                   |
| ONEOK, Inc.              | 31.630  | 2.582                     | 1,48                              | 4,306 % fällig am 22.07.2025 (b)(c)       | 2.600           | 2.594                     | 1,48                              | PIMCO Select Funds plc -            |                 |                           |                                   |
| Targa Resources Corp.    | 27.500  | 4.787                     | 2,73                              | 4,307 % fällig am 15.07.2025 (b)(c)       | 13.900          | 13.878                    | 7,93                              | PIMCO US Dollar Short-              |                 |                           |                                   |
| Williams Cos., Inc.      | 107.000 | 6.721                     | 3,84                              | 4,310 % fällig am 29.07.2025 (a)(b)(c)    | 3.200           | 3.190                     | 1,82                              | Term Floating NAV Fund (d)          |                 |                           |                                   |
|                          |         | 49.168                    | 28,09                             | 4,317 % fällig am 07.10.2025 (b)(c)       | 4.550           | 4.498                     | 2,57                              | 1.693.384                           | 16.886          | 9,65                      |                                   |
|                          |         |                           |                                   | 4,319 % fällig am 21.10.2025 (b)(c)       | 4.550           | 4.491                     | 2,57                              | Summe Investmentfonds               |                 | \$ 16.886                 | 9,65                              |
|                          |         |                           |                                   | 4,320 % fällig am 16.09.2025 (a)(b)(c)(e) | 1.600           | 1.585                     | 0,91                              |                                     |                 |                           |                                   |

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Einheiten | Variable Zinssatz                                 | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------|------------|--------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|-----------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| JPM        | Erhalt         | AMZX Index | 11.039                                     | FEDL01 Zinssatz zzgl.<br>eines bestimmten Spreads | \$ 27.109       | 15.10.2025            | \$ 0                                         | \$ 534                                             | \$ 534         | 0,30                         |

### TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier                      | Anzahl der<br>Anteile<br>oder<br>Einheiten | Variable Zinssatz                                 | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------|---------------------------------|--------------------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------|-----------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Erhalt         | Energy Transfer LP              | 542.920                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | \$ 9.490        | 15.10.2025            | \$ 0                                         | \$ 317                                          | \$ 317         | 0,18                         |
|            | Erhalt         | MPLX LP                         | 309.500                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 15.785          | 05.11.2025            | 0                                            | 97                                              | 97             | 0,06                         |
|            | Erhalt         | Energy Transfer LP              | 323.369                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 5.652           | 07.01.2026            | 0                                            | 188                                             | 188            | 0,11                         |
|            | Erhalt         | Enterprise Products Partners LP | 237.570                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 7.322           | 07.01.2026            | 0                                            | 16                                              | 16             | 0,01                         |
|            | Erhalt         | Western Gas Partners LP         | 78.261                                     | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 2.927           | 07.01.2026            | 0                                            | 90                                              | 90             | 0,05                         |
| CBK        | Erhalt         | Energy Transfer LP              | 66.484                                     | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 1.162           | 15.10.2025            | 0                                            | 39                                              | 39             | 0,02                         |
| GST        | Erhalt         | Sunoco LP                       | 145.300                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 7.837           | 20.08.2025            | 0                                            | (81)                                            | (81)           | (0,05)                       |
| MYI        | Erhalt         | Enterprise Products Partners LP | 125.200                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 3.891           | 15.10.2025            | 0                                            | (21)                                            | (21)           | (0,01)                       |
|            | Erhalt         | Western Gas Partners LP         | 220.121                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 8.283           | 15.10.2025            | 0                                            | 207                                             | 207            | 0,12                         |
|            | Erhalt         | Plains All American Pipeline LP | 707.656                                    | FEDL01 Zinssatz zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 11.920          | 07.01.2026            | 0                                            | 1.002                                           | 1.002          | 0,57                         |
|            |                |                                 |                                            |                                                   |                 |                       | \$ 0                                         | \$ 1.854                                        | \$ 1.854       | 1,06                         |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOA        | 07.2025               | CAD                    | 275                      | \$ 199                           | \$ (2)                             | \$ (2)                                               | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | 122                      | 138                              | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               | £                      | 75                       | 102                              | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 102                      | £ 75                             | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 07.2025               |                        | 141                      | € 122                            | 0                                  | 2                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | €                      | 121                      | \$ 141                           | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |
| MBC        | 07.2025               | CAD                    | 18.141                   | 13.208                           | (87)                               | (87)                                                 | (0,05)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 13.402                   | CAD 18.423                       | 99                                 | 99                                                   | 0,06                         |
|            | 08.2025               | CAD                    | 18.392                   | \$ 13.402                        | (100)                              | (100)                                                | (0,06)                       |
| MYI        | 07.2025               | €                      | 189                      | 222                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SSB        | 07.2025               | \$                     | 102                      | £ 75                             | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 103                           | \$ (196)                           | \$ (93)                                              | (0,05)                       |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE**

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 23.392               | \$ 27.389                | \$ 0                             | \$ (70)                            | \$ (70)                                              | (0,04)                       |
|            | 07.2025               | \$ 23.340              | € 20.542                 | 773                              | 0                                  | 773                                                  | 0,44                         |
|            | 08.2025               | 27.449                 | 23.392                   | 69                               | 0                                  | 69                                                   | 0,04                         |
| BOA        | 07.2025               | 26.176                 | 23.021                   | 847                              | 0                                  | 847                                                  | 0,48                         |
| BPS        | 07.2025               | € 488                  | \$ 554                   | 0                                | (19)                               | (19)                                                 | (0,01)                       |
| BRC        | 07.2025               | \$ 27.543              | € 24.245                 | 917                              | 0                                  | 917                                                  | 0,52                         |
| CBK        | 07.2025               | € 1.778                | \$ 2.049                 | 0                                | (38)                               | (38)                                                 | (0,02)                       |
|            | 07.2025               | \$ 989                 | € 844                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 07.2025               | € 23.276               | \$ 27.003                | 0                                | (320)                              | (320)                                                | (0,18)                       |
|            | 08.2025               | \$ 27.003              | € 23.225                 | 320                              | 0                                  | 320                                                  | 0,18                         |
| MBC        | 07.2025               | € 78                   | \$ 89                    | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 1.493               | € 1.299                  | 32                               | 0                                  | 32                                                   | 0,02                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 2.960                         | \$ (450)                           | \$ 2.510                                             | 1,43                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £ 1.081                | \$ 1.483                 | \$ 2                             | \$ 0                               | \$ 2                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$ 1.483               | £ 1.081                  | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025               | £ 18                   | \$ 25                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 1.176                  | 1.600                    | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | (0,01)                       |
| BRC        | 07.2025               | \$ 1.426               | £ 1.056                  | 21                               | 0                                  | 21                                                   | 0,01                         |
|            | 08.2025               | 1.596                  | 1.173                    | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,01                         |
| CBK        | 07.2025               | 46                     | 34                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 1.575                  | 1.169                    | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,02                         |
| MBC        | 07.2025               | £ 121                  | \$ 164                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 121                 | £ 89                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
| SSB        | 07.2025               | £ 1.151                | \$ 1.578                 | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 1.548               | £ 1.144                  | 19                               | 0                                  | 19                                                   | 0,01                         |
| UAG        | 08.2025               | 1.578                  | 1.151                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 74                     | 55                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 84                            | \$ (17)                            | \$ 67                                                | 0,04                         |

|                                  |            |        |
|----------------------------------|------------|--------|
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | \$ 4.872   | 2,78   |
| Summe Anlagen                    | \$ 177.728 | 101,55 |
| Sonstige Aktiva und Passiva      | \$ (2.711) | (1,55) |
| Nettovermögen                    | \$ 175.017 | 100,00 |

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Mit dem Fonds verbunden.
- (e) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 1 USD (31. Dezember 2024: 4.433 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 3.830 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 62.204                                                                   | \$ 93.766                                                       | \$ 0                                                         | \$ 155.970 |
| Investmentfonds               | 16.886                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 16.886     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | 4.872                                                           | 0                                                            | 4.872      |
| Summen                        | \$ 79.090                                                                   | \$ 98.638                                                       | \$ 0                                                         | \$ 177.728 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 53.590                                                                   | \$ 90.994                                                       | \$ 0                                                         | \$ 144.584        |
| Investmentfonds               | 15.373                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 15.373            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | (1.848)                                                         | 0                                                            | (1.848)           |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 68.963</b>                                                            | <b>\$ 89.146</b>                                                | <b>\$ 0</b>                                                  | <b>\$ 158.109</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 772                              | \$ (670)                              | \$ 102                              | \$ 1                                | \$ 0                                  | \$ 1                                |
| BOA        | 1.549                               | (1.489)                               | 60                                  | (178)                               | 2.940                                 | 2.762                               |
| BPS        | (19)                                | 0                                     | (19)                                | (41)                                | 0                                     | (41)                                |
| BRC        | 937                                 | (650)                                 | 287                                 | 91                                  | 0                                     | 91                                  |
| CBK        | 4                                   | 0                                     | 4                                   | (28)                                | 58                                    | 30                                  |
| DUB        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (555)                               | 260                                   | (295)                               |
| GST        | (81)                                | 1                                     | (80)                                | (33)                                | 653                                   | 620                                 |
| JPM        | 561                                 | (600)                                 | (39)                                | (81)                                | 1.900                                 | 1.819                               |
| MBC        | (60)                                | 0                                     | (60)                                | (467)                               | 341                                   | (126)                               |
| MYI        | 1.188                               | (1.100)                               | 88                                  | (69)                                | 1.670                                 | 1.601                               |
| RBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 13                                  | 0                                     | 13                                  |
| SCX        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (506)                               | 441                                   | (65)                                |
| SSB        | 20                                  | 0                                     | 20                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| UAG        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 5                                   | 0                                     | 5                                   |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 84,08             | 74,63             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 2,26              | 12,47             |
| Investmentfonds                                                        | 9,35              | 9,26              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 3,12              | 0,18              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 1,19              | 3,46              |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>     | <b>100,00</b>     |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert               | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kanada                              | 7,45              | 6,76              |
| USA                                 | 30,42             | 29,96             |
| Kurzfristige Instrumente            | 51,25             | 55,33             |
| Investmentfonds                     | 9,65              | 9,79              |
| Freiverkehrsfinanzderivate          |                   |                   |
| Total Return Swaps auf Indizes      | 0,30              | (0,06)            |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere  | 1,06              | (0,17)            |
| Devisenterminkontrakte              | (0,05)            | 0,11              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,47              | (1,06)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva         | (1,55)            | (0,66)            |
| <b>Nettovermögen</b>                | <b>100,00</b>     | <b>100,00</b>     |

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                         |                |                          |                                   | 2,636 % fällig am 25.12.2026     | \$ 1.091       | \$ 1.064                 | 0,05                              | 5,410 % fällig am 01.04.2029 (f) | 2.220          | 2.301                    | 0,10                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |                |                          |                                   | 2,680 % fällig am 25.10.2034 (a) | 377            | 17                       | 0,00                              | 5,420 % fällig am 01.02.2030 -   |                |                          |                                   |
| <b>BANKEN UND FINANZEN</b>                              |                |                          |                                   | 2,780 % fällig am 25.10.2042 (a) | 321            | 50                       | 0,00                              | 01.06.2031                       | \$ 2.772       | \$ 2.883                 | 0,13                              |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.                      |                |                          |                                   | 2,939 % fällig am 25.01.2026     | 3.474          | 3.444                    | 0,15                              | 5,440 % fällig am 01.10.2031     | 1.213          | 1.272                    | 0,06                              |
| 3,000 % fällig am 09.07.2032                            | € 2.100        | \$ 2.482                 | 0,11                              | 3,000 % fällig am 25.11.2027 -   | 236.29         |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.06.2035 -   |                |                          |                                   |
| SLM Student Loan Trust                                  |                |                          |                                   | 25.10.2052 (a)                   | 2              | 38.947                   | 1,71                              | 25.05.2036 (a)                   | 1.338          | 239                      | 0,01                              |
| 2,525 % fällig am 15.12.2033                            | 431            | 479                      | 0,02                              | 3,000 % fällig am 01.02.2057 -   |                |                          |                                   | 5,505 % fällig am 25.12.2053     | 44.193         | 44.306                   | 1,95                              |
|                                                         |                | 2.961                    | 0,13                              | 01.07.2060 (f)                   | 12.534         | 10.841                   | 0,48                              | 5,510 % fällig am 01.05.2035     | 1.715          | 1.819                    | 0,08                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 01.05.2058 -   |                |                          |                                   | 5,555 % fällig am 25.11.2052     | 12.625         | 12.522                   | 0,55                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 01.04.2059                       | 7.892          | 6.806                    | 0,30                              | 5,570 % fällig am 01.01.2030 (f) | 3.602          | 3.796                    | 0,17                              |
| <b>INDUSTRIEWERTE</b>                                   |                |                          |                                   | 3,140 % fällig am 01.07.2029     | 1.024          | 986                      | 0,04                              | 5,620 % fällig am 01.06.2041     | 441            | 457                      | 0,02                              |
| Times Square Hotel Trust                                |                |                          |                                   | 3,153 % fällig am 25.01.2041     | 206            | 202                      | 0,01                              | 5,650 % fällig am 01.05.2038     | 690            | 724                      | 0,03                              |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026                            | \$ 37          | 37                       | 0,00                              | 3,180 % fällig am 25.11.2033 (a) | 28             | 2                        | 0,00                              | 5,655 % fällig am 25.01.2055     | 12.032         | 12.080                   | 0,53                              |
| Summe Unternehmensanleihen und                          |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 25.02.2028 -   |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.07.2035     | 408            | 426                      | 0,02                              |
| Wechsel                                                 |                | 2.998                    | 0,13                              | 25.04.2053 (a)                   | 32.190         | 5.381                    | 0,24                              | 5,755 % fällig am 25.06.2054 -   |                |                          |                                   |
|                                                         |                |                          |                                   | 3,510 % fällig am 01.03.2029     | 1.063          | 1.042                    | 0,05                              | 25.08.2054                       | 28.732         | 28.896                   | 1,27                              |
| <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |                |                          |                                   | 3,870 % fällig am 01.07.2027     | 1.600          | 1.574                    | 0,07                              | 5,810 % fällig am 01.06.2031 (f) | 4.300          | 4.462                    | 0,20                              |
| Detroit, Michigan General Obligation Bonds, Series 2014 |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 25.04.2032 -   |                |                          |                                   | 5,855 % fällig am 25.06.2055     | 19.720         | 19.948                   | 0,88                              |
| 4,000 % fällig am 01.04.2044                            | 1.989          | 1.556                    | 0,07                              | 25.06.2050 (a)                   | 16.455         | 2.583                    | 0,11                              | 5,890 % fällig am 01.09.2046     | 652            | 704                      | 0,03                              |
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                            |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 25.05.2050     | 2.165          | 1.764                    | 0,08                              | 6,000 % fällig am 25.04.2032 -   |                |                          |                                   |
| Fannie Mae                                              |                |                          |                                   | 4,028 % fällig am 25.05.2051 (a) | 2.272          | 347                      | 0,02                              | 25.03.2033 (a)                   | 195            | 23                       | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am 25.05.2033 -                          |                |                          |                                   | 4,140 % fällig am 01.04.2028     | 676            | 678                      | 0,03                              | 6,000 % fällig am 25.05.2035 -   |                |                          |                                   |
| 25.05.2048 (b)(c)                                       | 3.428          | 2.607                    | 0,11                              | 4,297 % fällig am 25.04.2042     | 86             | 87                       | 0,00                              | 25.11.2043                       | 6.246          | 6.419                    | 0,28                              |
| 0,000 % fällig am 25.10.2042 -                          |                |                          |                                   | 4,300 % fällig am 01.05.2028     | 730            | 735                      | 0,03                              | 6,150 % fällig am 01.08.2049     | 286            | 297                      | 0,01                              |
| 25.06.2043                                              | 1.728          | 1.269                    | 0,06                              | 4,374 % fällig am 01.02.2028 (f) | 1.998          | 2.005                    | 0,09                              | 6,500 % fällig am 25.12.2034 (a) | 840            | 100                      | 0,00                              |
| 0,000 % fällig am 25.06.2043 -                          | 125.02         |                          |                                   | 4,385 % fällig am 01.04.2033     | 718            | 713                      | 0,03                              | 6,813 % fällig am 01.12.2048     | 213            | 221                      | 0,01                              |
| 25.02.2052 (a)                                          | 4              | 1.906                    | 0,08                              | 4,400 % fällig am 01.12.2029 (f) | 3.678          | 3.715                    | 0,16                              | <b>Freddie Mac</b>               |                |                          |                                   |
| 0,042 % fällig am 25.09.2042                            | 952            | 531                      | 0,02                              | 4,420 % fällig am 01.03.2029 (f) | 9.375          | 9.479                    | 0,42                              | 0,000 % fällig am 15.10.2032 -   |                |                          |                                   |
| 0,128 % fällig am 25.10.2043                            | 118            | 71                       | 0,00                              | 4,440 % fällig am 01.06.2033     | 1.573          | 1.565                    | 0,07                              | 15.12.2043                       | 2.133          | 1.649                    | 0,07                              |
| 0,148 % fällig am 25.03.2033                            | 114            | 98                       | 0,00                              | 4,450 % fällig am 01.01.2030 (f) | 3.058          | 3.086                    | 0,14                              | 0,000 % fällig am 01.02.2035 -   |                |                          |                                   |
| 0,200 % fällig am 25.02.2043 (a)                        | 1.897          | 12                       | 0,00                              | 4,480 % fällig am 01.05.2030     | 1.324          | 1.337                    | 0,06                              | 15.08.2057 (b)(c)                | 2.992          | 2.083                    | 0,09                              |
| 0,573 % fällig am 25.03.2047                            | 53             | 36                       | 0,00                              | 4,490 % fällig am 01.11.2029 (f) | 6.390          | 6.471                    | 0,28                              | 0,042 % fällig am 15.09.2042     | 915            | 544                      | 0,02                              |
| 0,580 % fällig am 25.06.2050 (a)                        | 2.623          | 230                      | 0,01                              | 4,490 % fällig am 01.04.2033     | 300            | 300                      | 0,01                              | 0,082 % fällig am 15.08.2040 (a) | 1.151          | 51                       | 0,00                              |
| 0,695 % fällig am 25.07.2054 (a)                        | 50.944         | 1.757                    | 0,08                              | 4,500 % fällig am 25.06.2029 -   |                |                          |                                   | 0,098 % fällig am 15.03.2043     | 4.670          | 2.921                    | 0,13                              |
| 1,410 % fällig am 01.01.2031 (f)                        | 7.198          | 6.177                    | 0,27                              | 25.09.2053 (a)                   | 23.463         | 5.134                    | 0,23                              | 0,131 % fällig am 15.10.2042     | 483            | 380                      | 0,02                              |
| 1,500 % fällig am 25.04.2037 -                          |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.11.2032 (f) | 2.000          | 2.005                    | 0,09                              | 0,263 % fällig am 15.05.2041     | 361            | 291                      | 0,01                              |
| 25.01.2052 (a)                                          | 39.154         | 2.137                    | 0,09                              | 4,500 % fällig am 01.04.2059     | 3.538          | 3.390                    | 0,15                              | 0,486 % fällig am 15.08.2043     | 250            | 205                      | 0,01                              |
| 1,512 % fällig am 25.12.2050 (a)                        | 6.219          | 316                      | 0,01                              | 4,580 % fällig am 01.08.2033     | 1.000          | 1.006                    | 0,04                              | 0,582 % fällig am 15.04.2042 (a) | 1.256          | 92                       | 0,00                              |
| 1,530 % fällig am 25.04.2044 (a)                        | 1.218          | 141                      | 0,01                              | 4,610 % fällig am 01.09.2029     | 994            | 1.011                    | 0,04                              | 0,995 % fällig am 25.09.2054 (a) | 7.222          | 492                      | 0,02                              |
| 1,564 % fällig am 25.08.2033                            | 181            | 170                      | 0,01                              | 4,620 % fällig am 01.01.2032     | 1.500          | 1.516                    | 0,07                              | 1,095 % fällig am 25.11.2054 (a) | 11.798         | 834                      | 0,04                              |
| 1,567 % fällig am 25.03.2052 (a)                        | 42.302         | 1.675                    | 0,07                              | 4,680 % fällig am 01.07.2030     | 6.796          | 6.845                    | 0,30                              | 1,432 % fällig am 15.02.2041 (a) | 204            | 17                       | 0,00                              |
| 1,580 % fällig am 25.05.2046 -                          |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 01.04.2033 -   |                |                          |                                   | 1,472 % fällig am 15.09.2043 (a) | 609            | 64                       | 0,00                              |
| 25.01.2050 (a)                                          | 16.159         | 1.926                    | 0,08                              | 01.05.2035                       | 2.140          | 2.143                    | 0,09                              | 1,500 % fällig am 15.03.2028     | 5.614          | 5.447                    | 0,24                              |
| 1,610 % fällig am 01.11.2030                            | 2.000          | 1.748                    | 0,08                              | 4,740 % fällig am 01.04.2030 (f) | 5.500          | 5.548                    | 0,24                              | 1,532 % fällig am 15.07.2041 -   |                |                          |                                   |
| 1,627 % fällig am 25.01.2051 (a)                        | 11.530         | 514                      | 0,02                              | 4,770 % fällig am 01.05.2032 (f) | 2.140          | 2.162                    | 0,10                              | 15.12.2041 (a)                   | 1.941          | 184                      | 0,01                              |
| 1,630 % fällig am 25.10.2042 -                          |                |                          |                                   | 4,815 % fällig am 01.03.2031 (f) | 2.710          | 2.765                    | 0,12                              | 1,582 % fällig am 15.10.2041 -   |                |                          |                                   |
| 25.07.2059 (a)                                          | 9.560          | 1.128                    | 0,05                              | 4,860 % fällig am 01.05.2035     | 900            | 913                      | 0,04                              | 15.05.2046 (a)                   | 23.317         | 2.660                    | 0,12                              |
| 1,631 % fällig am 25.08.2033                            | 54             | 52                       | 0,00                              | 4,870 % fällig am 01.05.2035     | 500            | 507                      | 0,02                              | 1,630 % fällig am 25.11.2049 -   |                |                          |                                   |
| 1,680 % fällig am 25.06.2037 -                          |                |                          |                                   | 4,890 % fällig am 01.05.2032 (f) | 5.925          | 6.019                    | 0,26                              | 25.06.2050 (a)                   | 21.708         | 2.726                    | 0,12                              |
| 25.07.2050 (a)                                          | 15.634         | 1.865                    | 0,08                              | 4,890 % fällig am 01.11.2034     | 1.191          | 1.214                    | 0,05                              | 1,632 % fällig am 15.08.2041 -   |                |                          |                                   |
| 1,730 % fällig am 25.02.2046 -                          |                |                          |                                   | 4,914 % fällig am 25.07.2046     | 85             | 84                       | 0,00                              | 15.09.2044 (a)                   | 5.914          | 682                      | 0,03                              |
| 25.09.2048 (a)                                          | 7.004          | 877                      | 0,04                              | 4,935 % fällig am 01.11.2029 (f) | 7.195          | 7.383                    | 0,32                              | 1,639 % fällig am 15.03.2050 (a) | 3.259          | 142                      | 0,01                              |
| 1,740 % fällig am 01.12.2030 (f)                        | 2.990          | 2.631                    | 0,12                              | 4,950 % fällig am 01.03.2032     | 1.151          | 1.180                    | 0,05                              | 1,680 % fällig am 25.06.2050 -   |                |                          |                                   |
| 1,780 % fällig am 25.11.2047 -                          |                |                          |                                   | 4,980 % fällig am 01.12.2034     | 1.561          | 1.602                    | 0,07                              | 25.08.2050 (a)                   | 13.760         | 1.715                    | 0,08                              |
| 25.06.2048 (a)                                          | 24.025         | 3.153                    | 0,14                              | 4,990 % fällig am 01.03.2031     | 492            | 504                      | 0,02                              | 1,682 % fällig am 15.02.2044 (a) | 99             | 7                        | 0,00                              |
| 1,795 % fällig am 25.10.2054 (a)                        | 5.880          | 604                      | 0,03                              | 5,000 % fällig am 25.04.2034 -   |                |                          |                                   | 1,695 % fällig am 25.10.2054 (a) | 5.645          | 551                      | 0,02                              |
| 1,830 % fällig am 25.04.2043 (a)                        | 1.450          | 105                      | 0,00                              | 25.08.2053 (a)                   | 13.450         | 3.240                    | 0,14                              | 1,714 % fällig am 15.03.2050 (a) | 80.514         | 3.689                    | 0,16                              |
| 1,865 % fällig am 25.05.2050 (a)                        | 7.071          | 462                      | 0,02                              | 5,040 % fällig am 01.05.2035 (f) | 2.448          | 2.514                    | 0,11                              | 1,730 % fällig am 25.05.2050 (a) | 2.356          | 313                      | 0,01                              |
| 1,880 % fällig am 25.05.2030 (a)                        | 740            | 26                       | 0,00                              | 5,070 % fällig am 01.03.2032 (f) | 2.688          | 2.774                    | 0,12                              | 1,732 % fällig am 15.08.2025 -   |                |                          |                                   |
| 1,886 % fällig am 25.09.2046 (a)                        | 6.793          | 445                      | 0,02                              | 5,090 % fällig am 01.01.2032     | 1.275          | 1.322                    | 0,06                              | 15.10.2048 (a)                   | 10.223         | 1.276                    | 0,06                              |
| 1,902 % fällig am 25.03.2060 (a)                        | 3.986          | 254                      | 0,01                              | 5,105 % fällig am 25.06.2055     | 7.594          | 7.415                    | 0,33                              | 1,782 % fällig am 15.03.2048 -   |                |                          |                                   |
| 1,917 % fällig am 25.04.2047 (a)                        | 3.407          | 213                      | 0,01                              | 5,120 % fällig am 01.05.2035 (f) | 2.900          | 2.998                    | 0,13                              | 15.06.2048 (a)                   | 2.617          | 362                      | 0,02                              |
| 1,980 % fällig am 01.04.2031                            | 1.959          | 1.739                    | 0,08                              | 5,130 % fällig am 25.12.2047     | 381            | 381                      | 0,02                              | 1,832 % fällig am 15.09.2042 (a) | 609            | 60                       | 0,00                              |
| 1,992 % fällig am 25.11.2047 (a)                        | 9.853          | 549                      | 0,02                              | 5,140 % fällig am 01.02.2035 (f) | 1.902          | 1.962                    | 0,09                              | 1,882 % fällig am 15.10.2036 (a) | 740            | 62                       | 0,00                              |
| 2,000 % fällig am 25.07.2037 -                          |                |                          |                                   | 5,150 % fällig am 01.05.2035 (f) | 3.250          | 3.352                    | 0,15                              | 2,000 % fällig am 25.11.2050 -   |                |                          |                                   |
| 25.08.2052 (a)                                          | 2              | 20.396                   | 0,90                              | 5,150 % fällig am 25.01.2051     | 764            | 764                      | 0,03                              | 25.06.2052 (a)                   | 42.641         | 5.268                    | 0,23                              |
| 2,020 % fällig am 25.03.2060 (a)                        | 12.118         | 915                      | 0,04                              | 5,200 % fällig am 01.10.2030 (f) | 1.988          | 2.066                    | 0,09                              | 2,052 % fällig am 15.11.2037 (a) | 158            | 14                       | 0,00                              |
| 2,053 % fällig am 25.07.2045 (a)                        | 2.880          | 172                      | 0,01                              | 5,225 % fällig am 01.03.2032 (f) | 1.920          | 1.997                    | 0,09                              | 2,053 % fällig am 15.01.2038 (a) | 131            | 7                        | 0,00                              |
| 2,081 % fällig am 25.03.2045 (a)                        | 1.698          | 95                       | 0,00                              | 5,240 % fällig am 01.01.2034 (f) | 2.407          | 2.493                    | 0,11                              | 2,072 % fällig am 15.01.2042 (a) | 4.512          | 575                      | 0,03                              |
| 2,104 % fällig am 25.06.2052 (a)                        | 3.325          | 236                      | 0,01                              | 5,270 % fällig am 01.08.2032 (f) | 3.837          | 3.991                    | 0,18                              | 2,182 % fällig am 15.11.2041 (a) | 64             | 4                        | 0,00                              |
| 2,110 % fällig am 25.01.2041 (a)                        | 408            | 51                       | 0,00                              | 5,270 % fällig am 01.09.2039     | 1.511          | 1.523                    | 0,07                              | 2,240 % fällig am 15.02.2038 (a) | 2.262          | 122                      | 0,01                              |
| 2,180 % fällig am 25.09.2040 -                          |                |                          |                                   | 5,275 % fällig am 25.08.2054     | 416            | 417                      | 0,02                              | 2,271 % fällig am 15.10.2040 (a) | 10.583         | 795                      | 0,03                              |
| 25.09.2042 (a)                                          | 1.880          | 217                      | 0,01                              | 5,305 % fällig am 25.01.2054     | 9.947          | 9.962                    | 0,44                              | 2,282 % fällig am 15.10.2036 -   |                |                          |                                   |
| 2,201 % fällig am 25.02.2062 (a)                        | 6.126          | 460                      | 0,02                              | 5,340 % fällig am 01.01.2031     | 1.250          | 1.311                    | 0,06                              | 15.12.2042 (a)                   | 1.356          | 176                      | 0,01                              |
| 2,257 % fällig am 25.01.2061 (a)                        | 9.788          | 780                      | 0,03                              | 5,350 % fällig am 01.12.2029     | 1.180          | 1.230                    | 0,05                              | 2,307 % fällig am 15.07.2042 (a) | 4.876          | 447                      | 0,02                              |
| 2,261 % fällig am 25.12.2061 (a)                        | 14.176         | 930                      | 0,04                              | 5,360 % fällig am 01.08.2031 (f) | 3.500          | 3.668                    | 0,16                              | 2,312 % fällig am 15.09.2039 (a) | 1.910          | 211                      | 0,01                              |
| 2,380 % fällig am 25.12.2032 (a)                        | 297            | 33                       | 0,00                              | 5,370 % fällig am 01.06.2035     | 1.000          | 1.047                    | 0,05                              | 2,320 % fällig am 15.04.2047 (a) | 1.990          | 156                      | 0,01                              |
| 2,452 % fällig am 25.05.2051 (a)                        | 7.247          | 552                      | 0,02                              | 5,380 % fällig am 01.10.2031 (f) | 2.003          | 2.102                    | 0,09                              | 2,347 % fällig am 15.08.2047 (a) | 2.384          | 233                      | 0,01                              |
| 2,500 % fällig am 25.12.2027 -                          |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 01.08.2030 -   |                |                          |                                   | 2,349 % fällig am 15.02.2038 (a) | 17.366         | 1.291                    | 0,06                              |
| 25.10.2052 (a)                                          | 144.732        | 21.337                   | 0,94                              | 01.05.2032                       | 2.170          | 2.272                    | 0,10                              | 2,429 % fällig am 15.12.2046 (a) | 4.148          | 326                      | 0,01                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 01.11.2032 (f) | 1.858          | 1.949                    | 0,09                              | 2,432 % fällig am 15.03.2038 (a) | 230            | 19                       | 0,00                              |
|                                                         |                |                          |                                   | 5,405 % fällig am 25.11.2054     | 23.058         | 22.939                   | 1,01                              | 2,500 % fällig am 15.11.2027 -   |                |                          |                                   |
|                                                         |                |                          |                                   |                                  |                |                          |                                   | 15.10.2052 (a)                   | 125.643        | 17.356                   | 0,                                |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 2,920 % fällig am 01.09.2036                        | \$ 1.272       | \$ 1.058                 | 0,05                              | 3,500 % fällig am 20.10.2047 -<br>20.10.2054 (f) | \$ 91.579      | \$ 83.593                | 3,68                              | 4,500 % fällig am 01.07.2040 -<br>01.08.2055          | \$ 145.250     | \$ 139.620               | 6,14                              |
| 3,000 % fällig am 15.03.2027 -<br>15.10.2052 (a)    | 163.564        | 26.307                   | 1,15                              | 4,000 % fällig am 15.04.2047 -<br>15.08.2048     | 2.038          | 1.946                    | 0,09                              | 5,000 % fällig am 01.07.2040 -<br>01.08.2055          | 164.300        | 161.184                  | 7,09                              |
| 3,062 % fällig am 25.12.2036                        | 6.068          | 5.027                    | 0,22                              | 4,500 % fällig am 20.07.2040 -<br>20.02.2049     | 2.131          | 2.074                    | 0,09                              | 5,500 % fällig am 01.07.2040                          | 5.000          | 5.091                    | 0,22                              |
| 3,112 % fällig am 15.12.2027 (a)                    | 132            | 3                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 20.05.2043 -<br>20.09.2047 (a) | 2.313          | 428                      | 0,02                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                          | 16.825         | 17.082                   | 0,75                              |
| 3,482 % fällig am 15.12.2031 (a)                    | 33             | 3                        | 0,00                              | 4,602 % fällig am 20.01.2068 -<br>20.09.2073     | 1.159          | 1.154                    | 0,05                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055                          | 521.350        | 537.568                  | 23,63                             |
| 3,500 % fällig am 15.03.2029 -<br>15.10.2052 (a)    | 101.158        | 18.256                   | 0,80                              | 4,896 % fällig am 20.06.2069                     | 298            | 299                      | 0,01                              | 7,000 % fällig am 01.08.2055 -<br>01.09.2055          | 92.600         | 97.085                   | 4,27                              |
| 3,500 % fällig am 01.01.2038 -<br>01.12.2046        | 761            | 716                      | 0,03                              | 4,926 % fällig am 20.04.2065                     | 440            | 441                      | 0,02                              |                                                       | 3.314.206      | 145,71                   |                                   |
| 3,927 % fällig am 15.09.2032                        | 171            | 174                      | 0,01                              | 4,933 % fällig am 20.07.2064                     | 160            | 160                      | 0,01                              | NON-AGENCY-MBS                                        |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.10.2041 -<br>25.08.2050 (a)    | 21.166         | 4.847                    | 0,21                              | 4,946 % fällig am 20.06.2069 -<br>20.11.2069     | 519            | 520                      | 0,02                              | 1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 01.03.2046 -<br>01.04.2048        | 8.473          | 8.034                    | 0,35                              | 4,995 % fällig am 20.03.2058                     | 19             | 19                       | 0,00                              | 5,690 % fällig am 13.10.2037                          | 2.000          | 1.734                    | 0,08                              |
| 4,190 % fällig am 01.05.2030 (f)                    | 2.500          | 2.465                    | 0,11                              | 5,000 % fällig am 20.06.2040 -<br>20.11.2048     | 2.360          | 2.377                    | 0,10                              | 225 Liberty Street Trust                              |                |                          |                                   |
| 4,228 % fällig am 25.10.2034                        | 8.699          | 8.561                    | 0,38                              | 5,000 % fällig am 20.09.2040 (a)                 | 281            | 2                        | 0,00                              | 4,803 % fällig am 10.02.2036                          | 5.000          | 4.430                    | 0,19                              |
| 4,500 % fällig am 15.11.2040 -<br>01.02.2048        | 1.020          | 1.006                    | 0,04                              | 5,046 % fällig am 20.05.2069                     | 698            | 698                      | 0,03                              | American Home Mortgage Assets Trust                   |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.01.2041 -<br>25.10.2051 (a)    | 14.569         | 3.519                    | 0,15                              | 5,096 % fällig am 20.02.2070                     | 342            | 344                      | 0,02                              | 4,559 % fällig am 25.03.2047                          | 1.687          | 1.506                    | 0,07                              |
| 4,660 % fällig am 25.01.2031                        | 2.200          | 2.228                    | 0,10                              | 5,152 % fällig am 20.07.2074                     | 2.300          | 2.301                    | 0,10                              | American Home Mortgage Investment Trust               |                |                          |                                   |
| 4,818 % fällig am 15.08.2057                        | 4.451          | 4.202                    | 0,18                              | 5,202 % fällig am 20.07.2073 -<br>20.07.2074     | 102.642        | 103.163                  | 4,54                              | 5,014 % fällig am 25.11.2045                          | 1.566          | 1.411                    | 0,06                              |
| 5,000 % fällig am 15.08.2035 -<br>25.05.2054 (a)    | 93.226         | 21.346                   | 0,94                              | 5,232 % fällig am 20.01.2074 -<br>20.08.2074     | 7.879          | 7.919                    | 0,35                              | 5,883 % fällig am 25.09.2035                          | 509            | 279                      | 0,01                              |
| 5,000 % fällig am 01.03.2049 (f)                    | 2.097          | 2.100                    | 0,09                              | 5,252 % fällig am 20.09.2073                     | 4.327          | 4.359                    | 0,19                              | 6,500 % fällig am 25.03.2047                          | 1.019          | 662                      | 0,03                              |
| 5,105 % fällig am 25.10.2052                        | 11.420         | 11.155                   | 0,49                              | 5,262 % fällig am 20.08.2073                     | 8.537          | 8.611                    | 0,38                              | Angel Oak Mortgage Trust                              |                |                          |                                   |
| 5,205 % fällig am 25.11.2054                        | 5.229          | 5.208                    | 0,23                              | 5,302 % fällig am 20.12.2073                     | 480            | 482                      | 0,02                              | 2,336 % fällig am 25.04.2066                          | 3.638          | 2.606                    | 0,11                              |
| 5,250 % fällig am 15.04.2049 -<br>15.12.2050        | 1.141          | 1.142                    | 0,05                              | 5,304 % fällig am 20.06.2055                     | 15.000         | 15.020                   | 0,66                              | Atlas Funding PLC                                     | £ 2.711        | 3.726                    | 0,16                              |
| 5,275 % fällig am 25.08.2054                        | 3.176          | 3.184                    | 0,14                              | 5,352 % fällig am 20.08.2053                     | 23.002         | 23.033                   | 1,01                              | Avon Finance PLC                                      | 1.407          | 1.931                    | 0,09                              |
| 5,285 % fällig am 25.02.2055                        | 27.906         | 27.992                   | 1,23                              | 5,402 % fällig am 20.06.2073                     | 594            | 603                      | 0,03                              | Banc of America Funding Trust                         |                |                          |                                   |
| 5,305 % fällig am 25.02.2055                        | 26.237         | 26.271                   | 1,16                              | 5,422 % fällig am 20.08.2073                     | 4.401          | 4.439                    | 0,20                              | 6,263 % fällig am 25.10.2036                          | \$ 1.404       | 1.245                    | 0,05                              |
| 5,350 % fällig am 15.08.2048                        | 1.287          | 1.296                    | 0,06                              | 5,500 % fällig am 16.11.2039                     | 3.643          | 3.749                    | 0,16                              | Barley Hill PLC                                       |                |                          |                                   |
| 5,405 % fällig am 25.10.2054 -<br>25.11.2054        | 18.371         | 18.257                   | 0,80                              | 5,581 % fällig am 20.09.2067                     | 1.511          | 1.524                    | 0,07                              | 5,924 % fällig am 27.08.2058                          | £ 2.953        | 4.050                    | 0,18                              |
| 5,455 % fällig am 25.12.2054 -<br>25.01.2055        | 74.112         | 74.137                   | 3,26                              | 6,000 % fällig am 20.02.2047                     | 11             | 12                       | 0,00                              | BCAP LLC Trust                                        |                |                          |                                   |
| 5,555 % fällig am 25.11.2052                        | 7.806          | 7.795                    | 0,34                              | Ginnie Mae, TBA                                  | 10.850         | 8.839                    | 0,39                              | 4,714 % fällig am 25.04.2037                          | \$ 1.220       | 1.143                    | 0,05                              |
| 5,505 % fällig am 25.11.2054                        | 22.678         | 22.586                   | 0,99                              | 2,000 % fällig am 01.07.2055                     | 27.800         | 23.623                   | 1,04                              | Bear Stearns ALT-A Trust                              |                |                          |                                   |
| 5,705 % fällig am 25.02.2055                        | 6.748          | 6.780                    | 0,30                              | 2,500 % fällig am 01.07.2055                     | 254.200        | 224.840                  | 9,89                              | 5,559 % fällig am 25.01.2035                          | 1.018          | 968                      | 0,04                              |
| 6,500 % fällig am 01.07.2054 (f)                    | 2.817          | 2.905                    | 0,13                              | 3,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055     | 57.200         | 53.192                   | 2,34                              | Bletchley Park Funding PLC                            | £ 1.247        | 1.717                    | 0,08                              |
| Ginnie Mae                                          |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 01.07.2055                     | 186.120        | 178.160                  | 7,83                              | 5,094 % fällig am 27.07.2070                          |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 20.08.2033 -<br>16.06.2043 (b)(c) | 959            | 844                      | 0,04                              | 4,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055     | 62.500         | 61.404                   | 2,70                              | Braccan Mortgage Funding PLC                          |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 20.11.2045                        | 534            | 493                      | 0,02                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055                     | 7.000          | 7.011                    | 0,31                              | 5,077 % fällig am 15.02.2067                          | 9.287          | 12.762                   | 0,56                              |
| 0,054 % fällig am 20.11.2046 (a)                    | 3.400          | 183                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am 01.07.2055                     | 7.000          | 7.095                    | 0,31                              | Chase Mortgage Finance Trust                          | \$ 39          | 36                       | 0,00                              |
| 0,078 % fällig am 20.08.2047 (a)                    | 2.882          | 121                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                     | 68.000         | 69.682                   | 3,06                              | 4,669 % fällig am 25.03.2037                          |                |                          |                                   |
| 0,083 % fällig am 20.06.2046 (a)                    | 3.580          | 136                      | 0,01                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055                     |                |                          |                                   | ChaseFlex Trust                                       |                |                          |                                   |
| 0,086 % fällig am 20.06.2042 (a)                    | 1.078          | 58                       | 0,00                              | Uniform Mortgage-Backed Security                 |                |                          |                                   | 5,114 % fällig am 25.05.2037                          | 1.152          | 1.105                    | 0,05                              |
| 0,115 % fällig am 20.05.2047 (a)                    | 5.204          | 344                      | 0,02                              | 2,500 % fällig am 01.01.2033 -<br>01.09.2051     | 7.385          | 6.299                    | 0,28                              | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                   |                |                          |                                   |
| 0,136 % fällig am 20.06.2042 (a)                    | 992            | 48                       | 0,00                              | 2,500 % fällig am 01.09.2051 (f)                 | 7.888          | 6.627                    | 0,29                              | 6,000 % fällig am 25.12.2035                          | 793            | 789                      | 0,03                              |
| 0,141 % fällig am 20.07.2041 (a)                    | 990            | 50                       | 0,00                              | 3,000 % fällig am 01.01.2038 -<br>01.04.2052     | 39.153         | 34.386                   | 1,51                              | 6,686 % fällig am 25.08.2035                          | 6              | 6                        | 0,00                              |
| 0,179 % fällig am 20.07.2046 (a)                    | 3.399          | 180                      | 0,01                              | 3,000 % fällig am 01.02.2040 (f)                 | 10.415         | 9.708                    | 0,43                              | CitiMortgage Alternative Loan Trust                   |                |                          |                                   |
| 0,191 % fällig am 20.01.2047 (a)                    | 3.472          | 175                      | 0,01                              | 3,500 % fällig am 01.02.2030 -<br>01.06.2051     | 30.454         | 28.371                   | 1,25                              | 4,984 % fällig am 25.01.2037                          | 1.233          | 1.018                    | 0,04                              |
| 0,198 % fällig am 20.10.2046 (a)                    | 3.009          | 137                      | 0,01                              | 3,500 % fällig am 01.11.2049 (f)                 | 3.439          | 3.158                    | 0,14                              | 6,000 % fällig am 25.11.2036                          | 712            | 654                      | 0,03                              |
| 0,208 % fällig am 20.06.2043 (a)                    | 1.033          | 50                       | 0,00                              | 4,000 % fällig am 01.02.2037 -<br>01.08.2049     | 23.709         | 22.718                   | 1,00                              | Countrywide Alternative Loan Trust                    |                |                          |                                   |
| 0,242 % fällig am 20.05.2040 (a)                    | 3.126          | 124                      | 0,01                              | 4,000 % fällig am 01.05.2048 (f)                 | 5.832          | 5.530                    | 0,24                              | 4,714 % fällig am 25.04.2047                          | 5.048          | 4.642                    | 0,20                              |
| 0,328 % fällig am 20.11.2046 (a)                    | 5.250          | 380                      | 0,02                              | 4,500 % fällig am 01.12.2038 -<br>01.07.2053     | 16.087         | 15.520                   | 0,68                              | 4,754 % fällig am 25.02.2047                          | 237            | 231                      | 0,01                              |
| 0,491 % fällig am 20.04.2043 (a)                    | 4.977          | 279                      | 0,01                              | 4,500 % fällig am 01.12.2054 (f)                 | 8.925          | 8.556                    | 0,38                              | 4,754 % fällig am 25.09.2047                          | 6              | 6                        | 0,00                              |
| 1,118 % fällig am 20.09.2043 (a)                    | 772            | 16                       | 0,00                              | 5,000 % fällig am 01.06.2048 -<br>01.09.2053     | 1.129          | 1.122                    | 0,05                              | 4,852 % fällig am 20.03.2046                          | 422            | 389                      | 0,02                              |
| 1,288 % fällig am 20.09.2045 (a)                    | 1.601          | 156                      | 0,01                              | 5,000 % fällig am 01.02.2054 (f)                 | 5.160          | 5.096                    | 0,22                              | 4,852 % fällig am 20.05.2046                          | 1.559          | 1.384                    | 0,06                              |
| 1,624 % fällig am 16.04.2040 -<br>16.08.2042 (a)    | 1.922          | 167                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am 01.05.2053 -<br>01.01.2055     | 21.169         | 21.347                   | 0,94                              | 5,074 % fällig am 25.11.2035                          | 3.621          | 3.271                    | 0,14                              |
| 1,668 % fällig am 20.01.2035 -<br>20.08.2049 (a)    | 7.456          | 662                      | 0,03                              | 5,500 % fällig am 01.07.2053 -<br>01.01.2055 (f) | 66.743         | 66.817                   | 2,94                              | 5,134 % fällig am 25.09.2035                          | 2.501          | 2.284                    | 0,10                              |
| 1,768 % fällig am 20.03.2035 -<br>20.09.2048 (a)    | 1.629          | 214                      | 0,01                              | 6,000 % fällig am 01.01.2053 -<br>01.04.2055 (f) | 93.442         | 96.266                   | 4,23                              | 5,339 % fällig am 25.06.2046                          | 1.814          | 1.667                    | 0,07                              |
| 1,818 % fällig am 20.07.2044 (a)                    | 2.278          | 385                      | 0,02                              | 6,000 % fällig am 01.08.2040 -<br>01.07.2055     | 15.200         | 12.404                   | 0,55                              | 5,399 % fällig am 25.12.2035                          | 1.075          | 966                      | 0,04                              |
| 2,000 % fällig am 20.02.2051 (a)                    | 3.186          | 356                      | 0,02                              | 6,500 % fällig am 01.11.2053 -<br>01.11.2054     | 13.026         | 13.522                   | 0,59                              | 5,500 % fällig am 25.06.2035                          | 115            | 93                       | 0,00                              |
| 2,024 % fällig am 16.02.2040 (a)                    | 1.258          | 95                       | 0,00                              | 7,000 % fällig am 01.06.2054 -<br>01.08.2054     | 681            | 722                      | 0,03                              | 5,500 % fällig am 25.07.2035                          | 1.728          | 1.166                    | 0,05                              |
| 2,268 % fällig am 20.05.2041 (a)                    | 725            | 58                       | 0,00                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA            |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.10.2035                          | 983            | 679                      | 0,03                              |
| 2,500 % fällig am 20.09.2027 (a)                    | 1.017          | 17                       | 0,00                              |                                                  |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.11.2035                          | 1.583          | 832                      | 0,04                              |
| 2,500 % fällig am 20.09.2051                        | 216            | 183                      | 0,01                              |                                                  |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 25.12.2035                          | 205            | 141                      | 0,01                              |
| 3,000 % fällig am 20.12.2047 (f)                    | 2.162          | 1.936                    | 0,09                              |                                                  |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.05.2036                          | 3.188          | 1.765                    | 0,08                              |
| 3,000 % fällig am 20.02.2048 -<br>20.10.2051        | 3.934          | 3.510                    | 0,15                              |                                                  |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.02.2037                          | 1.382          | 519                      | 0,02                              |
| 3,000 % fällig am 20.12.2049 (a)                    | 6.009          | 940                      | 0,04                              |                                                  |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.05.2036                          | 245            | 124                      | 0,01                              |
| 3,250 % fällig am 20.01.2047                        | 414            | 366                      | 0,02                              |                                                  |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.09.2037                          | 468            | 293                      | 0,01                              |
| 3,500 % fällig am 20.09.2029 -<br>20.09.2046 (a)    | 1.063          | 142                      | 0,01                              |                                                  |                |                          |                                   | Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.     |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 20.03.2042 -<br>20.01.2069        | 46.453         | 42.081                   | 1,85                              |                                                  |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.03.2036                          | 102            | 107                      | 0,00                              |
|                                                     |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust     |                |                          |                                   |
|                                                     |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   | 3,655 % fällig am 25.04.2035                          | 185            | 146                      | 0,01                              |
|                                                     |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   | 4,623 % fällig am 20.04.2036                          | 33             | 30                       | 0,00                              |
|                                                     |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   | 4,627 % fällig am 20.11.2035                          | 2.454          | 2.290                    | 0,10                              |
|                                                     |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   | 5,348 % fällig am 20.04.2036                          | 431            | 374                      | 0,02                              |



| BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,750 % fällig am 25.07.2037                          | \$ 695         | \$ 327                   | 0,01                              | MA Money Pinnacle Residential Securitisation Trust    | AUD 2.129      | \$ 1.396                 | 0,06                              | Towd Point Mortgage Trust                               | \$ 9.373       | \$ 9.203                 | 0,40                              |
| 6,500 % fällig am 25.11.2037                          | 2.236          | 713                      | 0,03                              | 4,535 % fällig am 15.04.2066                          |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 25.05.2058                            | 3.200          | 2.863                    | 0,13                              |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037                          | 5.119          | 2.032                    | 0,09                              | MASTR Asset Securitization Trust                      | \$ 560         | 455                      | 0,02                              | 3,882 % fällig am 25.07.2057                            | 3.096          | 2.902                    | 0,13                              |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates           |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.10.2036                          |                |                          |                                   | 4,097 % fällig am 25.04.2056                            |                |                          |                                   |
| 2,974 % fällig am 25.07.2057                          | 1.000          | 855                      | 0,04                              | MASTR Reperforming Loan Trust                         |                |                          |                                   | Tower Bridge Funding PLC                                |                |                          |                                   |
| 3,962 % fällig am 25.09.2057                          | 6.500          | 6.145                    | 0,27                              | 7,000 % fällig am 25.07.2035                          | 1.084          | 698                      | 0,03                              | 5,029 % fällig am 20.12.2066                            | £ 991          | 1.360                    | 0,06                              |
| Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust  |                |                          |                                   | Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                |                |                          |                                   | 5,117 % fällig am 20.05.2066                            | 924            | 1.269                    | 0,06                              |
| 5,500 % fällig am 25.10.2021                          | 15             | 14                       | 0,00                              | 6,250 % fällig am 25.08.2036                          | 3.985          | 1.527                    | 0,07                              | 5,398 % fällig am 20.01.2066                            | 3.549          | 4.875                    | 0,21                              |
| Curzon Mortgages PLC                                  |                |                          |                                   | Merrion Square Residential DAC                        |                |                          |                                   | Trinity Square PLC                                      |                |                          |                                   |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                          | £ 9.312        | 12.800                   | 0,56                              | 2,999 % fällig am 24.03.2081                          | € 9.860        | 11.588                   | 0,51                              | 5,217 % fällig am 15.07.2059                            | 5.157          | 7.083                    | 0,31                              |
| Dilosk RMBS DAC                                       |                |                          |                                   | Mill City Mortgage Loan Trust                         |                |                          |                                   | Twin Bridges PLC                                        |                |                          |                                   |
| 2,786 % fällig am 24.09.2060                          | € 2.817        | 3.306                    | 0,15                              | 3,250 % fällig am 25.01.2061                          | \$ 1.743       | 1.465                    | 0,06                              | 5,939 % fällig am 12.12.2055                            | 3.007          | 4.104                    | 0,18                              |
| 2,838 % fällig am 25.01.2063                          | 896            | 1.051                    | 0,05                              | 3,953 % fällig am 25.11.2058                          | 1.900          | 1.604                    | 0,07                              | Uropa Securities PLC                                    |                |                          |                                   |
| Domi BV                                               |                |                          |                                   | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                    |                |                          |                                   | 4,699 % fällig am 10.10.2040                            | 62             | 83                       | 0,00                              |
| 2,655 % fällig am 15.06.2056                          | 8.982          | 10.527                   | 0,46                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                          | 896            | 541                      | 0,02                              | 4,799 % fällig am 10.10.2040                            | 31             | 39                       | 0,00                              |
| 3,008 % fällig am 16.04.2057                          | 6.000          | 7.050                    | 0,31                              | 6,000 % fällig am 25.10.2037                          | 6.080          | 2.805                    | 0,12                              | Verus Securitization Trust                              |                |                          |                                   |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust |                |                          |                                   | Mortgage Equity Conversion Asset Trust                |                |                          |                                   | 2,338 % fällig am 25.10.2063                            | \$ 1.250       | 1.153                    | 0,05                              |
| 4,622 % fällig am 19.10.2036                          | \$ 3.939       | 3.551                    | 0,16                              | 4,460 % fällig am 25.02.2042                          | 201            | 198                      | 0,01                              | 4,199 % fällig am 25.10.2063                            | 1.000          | 876                      | 0,04                              |
| Dutch Property Finance BV                             |                |                          |                                   | Mortimer Mix PLC                                      |                |                          |                                   | WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust           |                |                          |                                   |
| 3,061 % fällig am 28.04.2062                          | € 11.541       | 13.604                   | 0,60                              | 5,069 % fällig am 22.09.2067                          | £ 4.187        | 5.756                    | 0,25                              | 4,036 % fällig am 25.06.2037                            | 2.639          | 2.321                    | 0,10                              |
| Edenbrook Mortgage Funding PLC                        |                |                          |                                   | Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust  |                |                          |                                   | 4,351 % fällig am 25.12.2036                            | 1.908          | 1.752                    | 0,08                              |
| 5,109 % fällig am 22.03.2057                          | £ 974          | 1.338                    | 0,06                              | 4,413 % fällig am 25.10.2035                          | \$ 608         | 542                      | 0,02                              | 5,169 % fällig am 25.04.2047                            | 50             | 43                       | 0,00                              |
| Elstree Funding                                       |                |                          |                                   | 6,017 % fällig am 25.06.2037                          | 1.024          | 906                      | 0,04                              | 5,359 % fällig am 25.09.2046                            | 779            | 655                      | 0,03                              |
| 4,943 % fällig am 21.01.2065                          | 3.524          | 4.832                    | 0,21                              | Nomura Resecuritization Trust                         |                |                          |                                   | 5,649 % fällig am 25.01.2047                            | 574            | 528                      | 0,02                              |
| EMF-UK PLC                                            |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 26.11.2036                          | 1.767          | 1.527                    | 0,07                              | 5,899 % fällig am 25.11.2046                            | 277            | 245                      | 0,01                              |
| 5,658 % fällig am 13.03.2046                          | 1.075          | 1.475                    | 0,06                              | Olympus Trust                                         |                |                          |                                   | Washington Mutual Mortgage Pass-Through                 |                |                          |                                   |
| Eurosail PLC                                          |                |                          |                                   | 4,508 % fällig am 10.10.2056                          | AUD 4.288      | 2.810                    | 0,12                              | Certificates Trust                                      |                |                          |                                   |
| 2,193 % fällig am 13.03.2045                          | € 302          | 351                      | 0,02                              | Pierpoint BTL PLC                                     |                |                          |                                   | 5,389 % fällig am 25.06.2046                            | 1.825          | 1.492                    | 0,07                              |
| 2,409 % fällig am 10.09.2044                          | 755            | 875                      | 0,04                              | 5,079 % fällig am 21.09.2061                          | £ 984          | 1.354                    | 0,06                              | Worldwide Plaza Trust                                   |                |                          |                                   |
| 4,908 % fällig am 13.06.2045                          | £ 1.673        | 2.055                    | 0,09                              | Polaris PLC                                           |                |                          |                                   | 3,715 % fällig am 10.11.2036                            | 3.950          | 618                      | 0,03                              |
| 5,358 % fällig am 13.06.2045                          | 309            | 401                      | 0,02                              | 5,044 % fällig am 26.02.2068                          | 19.864         | 27.261                   | 1,20                              |                                                         | 382.286        | 16,81                    |                                   |
| First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust   |                |                          |                                   | Residential Accredited Loans, Inc. Trust              |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                 |                |                          |                                   |
| 5,400 % fällig am 25.07.2035                          | \$ 123         | 116                      | 0,01                              | 4,734 % fällig am 25.08.2036                          | \$ 661         | 509                      | 0,02                              | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                          |                |                          |                                   |
| Grifonas Finance PLC                                  |                |                          |                                   | 5,813 % fällig am 25.12.2035                          | 1.105          | 428                      | 0,02                              | <b>Asset-Backed European Securitisation Transaction</b> |                |                          |                                   |
| 2,669 % fällig am 28.08.2039                          | € 555          | 633                      | 0,03                              | 6,000 % fällig am 25.01.2037                          | 139            | 111                      | 0,00                              | <b>Twenty-Three SARL</b>                                |                |                          |                                   |
| GS Mortgage Securities Corp. Trust                    |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 25.01.2037                          | 766            | 640                      | 0,03                              | 3,176 % fällig am 21.03.2034                            | € 2.700        | 3.192                    | 0,14                              |
| 3,055 % fällig am 26.04.2037                          | \$ 7.355       | 1.683                    | 0,07                              | Residential Asset Securitization Trust                |                |                          |                                   | 3,476 % fällig am 21.03.2034                            | 1.000          | 1.183                    | 0,05                              |
| 3,932 % fällig am 10.10.2035                          | 3.700          | 3.681                    | 0,16                              | 6,000 % fällig am 25.12.2036                          | 2.995          | 844                      | 0,04                              | Auto ABS Italian Stella Loans SRL                       |                |                          |                                   |
| 5,809 % fällig am 15.07.2031                          | 600            | 189                      | 0,01                              | RMAC Securities PLC                                   |                |                          |                                   | 2,659 % fällig am 29.12.2036                            | 1.736          | 2.043                    | 0,09                              |
| 6,059 % fällig am 15.07.2031                          | 2.000          | 421                      | 0,02                              | 4,528 % fällig am 12.06.2044                          | £ 268          | 358                      | 0,02                              | Auto ABS Spanish Loans                                  |                |                          |                                   |
| GS Mortgage-Backed Securities Trust                   |                |                          |                                   | Sapphire Trust Central Finance                        |                |                          |                                   | 2,779 % fällig am 28.09.2038                            | 9.562          | 11.259                   | 0,50                              |
| 3,750 % fällig am 25.10.2057                          | 1.086          | 1.061                    | 0,05                              | 4,485 % fällig am 14.06.2066                          | AUD 1.812      | 1.188                    | 0,05                              | Auto1 Car Funding SARL                                  |                |                          |                                   |
| GSMPS Mortgage Loan Trust                             |                |                          |                                   | 4,585 % fällig am 14.01.2066                          | 16             | 11                       | 0,00                              | 2,592 % fällig am 15.12.2033                            | 322            | 378                      | 0,02                              |
| 4,834 % fällig am 25.04.2036                          | 273            | 236                      | 0,01                              | 5,005 % fällig am 14.01.2066                          | 900            | 591                      | 0,03                              | BBVA Consumer Auto                                      |                |                          |                                   |
| 7,056 % fällig am 20.10.2032                          | 925            | 866                      | 0,04                              | Seasoned Loans Structured Transaction Trust           |                |                          |                                   | 2,723 % fällig am 19.03.2038                            | 1.635          | 1.926                    | 0,08                              |
| HarborView Mortgage Loan Trust                        |                |                          |                                   | 5,275 % fällig am 25.05.2034                          | \$ 4.953       | 4.967                    | 0,22                              | Bumper NL BV                                            |                |                          |                                   |
| 4,812 % fällig am 19.01.2038                          | 3.122          | 2.741                    | 0,12                              | Sestante Finance SRL                                  |                |                          |                                   | 2,539 % fällig am 21.03.2036                            | 9.400          | 11.046                   | 0,49                              |
| Harbour PLC                                           |                |                          |                                   | 2,403 % fällig am 23.07.2046                          | € 562          | 638                      | 0,03                              | Driver Australia Ten Trust                              |                |                          |                                   |
| 5,332 % fällig am 28.10.2054                          | £ 9.597        | 13.157                   | 0,58                              | Stratton BTL Mortgage Funding PLC                     |                |                          |                                   | 4,843 % fällig am 21.02.2033                            | AUD 10.556     | 6.928                    | 0,30                              |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust                  |                |                          |                                   | 5,948 % fällig am 20.01.2054                          | £ 3.000        | 4.053                    | 0,18                              | Flexicommercial ABS Trust                               |                |                          |                                   |
| 5,394 % fällig am 25.07.2035                          | \$ 781         | 753                      | 0,03                              | Stratton Mortgage Funding PLC                         |                |                          |                                   | 4,876 % fällig am 14.06.2031                            | 13.500         | 8.848                    | 0,39                              |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                           |                |                          |                                   | 5,139 % fällig am 28.06.2050                          | 1.024          | 1.405                    | 0,06                              | Golden Bar Securitisation SRL                           |                |                          |                                   |
| 3,910 % fällig am 25.12.2035                          | 2.887          | 1.583                    | 0,07                              | 5,214 % fällig am 25.06.2049                          | 8.713          | 11.954                   | 0,53                              | 3,086 % fällig am 22.09.2043                            | € 8.367        | 9.886                    | 0,43                              |
| 4,365 % fällig am 25.12.2035                          | 295            | 211                      | 0,01                              | Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust        |                |                          |                                   | Hill FL BV                                              |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.10.2036                          | 2.762          | 2.489                    | 0,11                              | 4,734 % fällig am 25.02.2037                          | \$ 409         | 403                      | 0,02                              | 2,631 % fällig am 18.10.2032                            | 3.100          | 3.644                    | 0,16                              |
| JPMorgan Alternative Loan Trust                       |                |                          |                                   | 4,749 % fällig am 25.05.2035                          | 874            | 724                      | 0,03                              | Koromo Italy Compartment                                |                |                          |                                   |
| 4,754 % fällig am 25.11.2036                          | 3.233          | 2.760                    | 0,12                              | 4,874 % fällig am 25.06.2037                          | 243            | 223                      | 0,01                              | 2,614 % fällig am 26.02.2032                            | 2.661          | 3.131                    | 0,14                              |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust   |                |                          |                                   | 5,066 % fällig am 25.12.2034                          | 1.333          | 1.239                    | 0,05                              | Plenti Auto ABS                                         |                |                          |                                   |
| 5,350 % fällig am 05.07.2033                          | 1.950          | 1.267                    | 0,06                              | 5,437 % fällig am 25.07.2035                          | 1.477          | 630                      | 0,03                              | 4,853 % fällig am 12.08.2033                            | AUD 1.335      | 875                      | 0,04                              |
| JPMorgan Resecuritization Trust                       |                |                          |                                   | 6,525 % fällig am 25.02.2034                          | 5              | 4                        | 0,00                              | Red & Black Auto Italy SRL                              |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 26.04.2037                          | 935            | 408                      | 0,02                              | Structured Asset Mortgage Investments Trust           |                |                          |                                   | 2,739 % fällig am 28.07.2036                            | € 3.195        | 3.764                    | 0,17                              |
| 6,010 % fällig am 26.09.2037                          | 1.125          | 844                      | 0,04                              | 4,874 % fällig am 25.09.2047                          | 2.722          | 2.413                    | 0,11                              |                                                         | 68.103         | 3,00                     |                                   |
| Jubilee Place BV                                      |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.08.2035                          | 393            | 375                      | 0,02                              | <b>AUTOMOBILE SEQUENTIELL</b>                           |                |                          |                                   |
| 2,724 % fällig am 18.09.2062                          | € 4.991        | 5.862                    | 0,26                              | 5,557 % fällig am 19.12.2033                          | 213            | 205                      | 0,01                              | <b>Harley Marine Financing LLC</b>                      |                |                          |                                   |
| Kinbane DAC                                           |                |                          |                                   | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 15.12.2027                            | \$ 564         | 568                      | 0,02                              |
| 3,188 % fällig am 24.01.2063                          | 2.370          | 2.788                    | 0,12                              | 4,684 % fällig am 25.07.2035                          | 1.087          | 1.017                    | 0,04                              | 9,750 % fällig am 15.12.2027                            | 568            | 572                      | 0,03                              |
| Lehman Mortgage Trust                                 |                |                          |                                   | 4,684 % fällig am 25.05.2036                          | 1.663          | 1.357                    | 0,06                              |                                                         | 1.140          | 0,05                     |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036                          | \$ 1.306       | 1.058                    | 0,05                              | Towd Point Mortgage Funding PLC                       |                |                          |                                   | <b>CMBS SONSTIGE</b>                                    |                |                          |                                   |
| Lehman XS Trust                                       |                |                          |                                   | 4,114 % fällig am 25.04.2055                          | 10.000         | 9.752                    | 0,43                              | <b>ACREC LLC</b>                                        |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.06.2047                          | 4.334          | 4.031                    | 0,18                              | 5,074 % fällig am 20.04.2051                          | £ 9.343        | 12.811                   | 0,56                              | 5,625 % fällig am 18.08.2042                            | 17.200         | 17.144                   | 0,75                              |
| London Wall Mortgage Capital PLC                      |                |                          |                                   | 5,223 % fällig am 20.07.2053                          | 8.189          | 11.247                   | 0,49                              | BDS LLC                                                 |                |                          |                                   |
| 5,227 % fällig am 15.05.2057                          | £ 1.314        | 1.807                    | 0,08                              | 5,474 % fällig am 20.04.2051                          | 2.106          | 2.890                    | 0,13                              | 5,599 % fällig am 21.10.2042                            | 10.100         | 10.066                   | 0,44                              |
| Lugo Funding DAC                                      |                |                          |                                   | 5,774 % fällig am 20.04.2051                          | 1.264          | 1.735                    | 0,08                              |                                                         |                |                          |                                   |
| 3,049 % fällig am 26.05.2066                          | € 6.137        | 7.219                    | 0,32                              | 6,474 % fällig am 20.04.2051                          | 1.053          | 1.446                    | 0,06                              |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | 7,474 % fällig am 20.04.2051                          | 843            | 1.156                    | 0,05                              |                                                         |                |                          |                                   |
|                                                       |                |                          |                                   | 8,474 % fällig am 20.04.2051                          | 526            | 722                      | 0,03                              |                                                         |                |                          |                                   |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>MF1 LLC</b>                                                                |                |                          |                                   | <b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | <b>BBAM European CLO DAC</b>                         |                |                          |                                   |
| 5,635 % fällig am 18.02.2040                                                  | \$ 20.500      | \$ 20.474                | 0,90                              | 6,009 % fällig am 25.02.2035                                              | \$ 192         | \$ 189                   | 0,01                              | 3,106 % fällig am 22.07.2034                         | € 750          | \$ 878                   | 0,04                              |
| 6,107 % fällig am 18.02.2040                                                  | 12.930         | 12.833                   | 0,57                              | 6,534 % fällig am 25.09.2034                                              | 1.175          | 1.012                    | 0,04                              | <b>Blackrock European CLO DAC</b>                    |                |                          |                                   |
|                                                                               |                | 60.517                   | 2,66                              | <b>Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust</b>                            |                |                          |                                   | 2,899 % fällig am 15.10.2031                         | 6.454          | 7.556                    | 0,33                              |
| <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>                                                    |                |                          |                                   | 4,929 % fällig am 25.07.2036                                              | 1.866          | 1.783                    | 0,08                              | <b>Canyon Capital CLO Ltd.</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>                                         |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.05.2036                                              | 268            | 254                      | 0,01                              | 5,266 % fällig am 15.10.2034                         | \$ 9.500       | 9.511                    | 0,42                              |
| 5,454 % fällig am 25.07.2035                                                  | 2.150          | 2.069                    | 0,09                              | <b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Carlyle Euro CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>                            |                |                          |                                   | 5,285 % fällig am 25.01.2037                                              | 5.079          | 1.548                    | 0,07                              | 3,329 % fällig am 15.01.2034                         | € 2.103        | 2.464                    | 0,11                              |
| 5,409 % fällig am 25.11.2033                                                  | 532            | 535                      | 0,02                              | 5,608 % fällig am 25.05.2036                                              | 5.981          | 2.596                    | 0,11                              | <b>Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC</b> |                |                          |                                   |
| <b>Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   | 5,746 % fällig am 25.05.2036                                              | 1.361          | 605                      | 0,03                              | 3,109 % fällig am 15.04.2034                         | 3.798          | 4.443                    | 0,20                              |
| 5,134 % fällig am 25.03.2035                                                  | 598            | 588                      | 0,03                              | <b>Residential Asset Mortgage Products Trust</b>                          |                |                          |                                   | 3,952 % fällig am 16.01.2033                         | 1.400          | 1.647                    | 0,07                              |
| 5,434 % fällig am 25.03.2035                                                  | 33             | 31                       | 0,00                              | 4,974 % fällig am 25.02.2036                                              | 159            | 155                      | 0,01                              | <b>Castlelake Aircraft Securitization Trust</b>      |                |                          |                                   |
| 6,264 % fällig am 25.12.2034                                                  | 842            | 762                      | 0,03                              | <b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>                           |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 15.06.2043                         | \$ 674         | 655                      | 0,03                              |
| <b>Amerquest Mortgage Securities Trust</b>                                    |                |                          |                                   | 4,869 % fällig am 25.06.2036                                              | 952            | 941                      | 0,04                              | <b>Castlelake Aircraft Structured Trust</b>          |                |                          |                                   |
| 5,004 % fällig am 25.04.2036                                                  | 3.650          | 3.355                    | 0,15                              | 5,214 % fällig am 25.06.2034                                              | 491            | 487                      | 0,02                              | 5,783 % fällig am 15.02.2050                         | 8.177          | 8.303                    | 0,37                              |
| <b>Argent Mortgage Loan Trust</b>                                             |                |                          |                                   | 5,439 % fällig am 25.05.2035                                              | 581            | 580                      | 0,03                              | <b>Cumulus Static CLO DAC</b>                        |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.05.2035                                                  | 2.200          | 1.971                    | 0,09                              | 5,469 % fällig am 25.08.2035                                              | 2.131          | 2.083                    | 0,09                              | 3,343 % fällig am 15.11.2033                         | € 1.842        | 2.168                    | 0,10                              |
| <b>Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   | <b>Soundview Home Loan Trust</b>                                          |                |                          |                                   | <b>Dillon's Park CLO DAC</b>                         |                |                          |                                   |
| 3,467 % fällig am 25.03.2036                                                  | 1.587          | 1.467                    | 0,06                              | 4,604 % fällig am 25.07.2037                                              | 4.693          | 4.146                    | 0,18                              | 3,299 % fällig am 15.10.2034                         | 5.000          | 5.862                    | 0,26                              |
| 5,664 % fällig am 25.02.2035                                                  | 946            | 882                      | 0,04                              | 5,334 % fällig am 25.10.2037                                              | 5.972          | 4.583                    | 0,20                              | <b>Dryden Euro CLO DAC</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>                             |                |                          |                                   | 5,424 % fällig am 25.06.2035                                              | 535            | 514                      | 0,02                              | 3,236 % fällig am 18.04.2033                         | 1.711          | 2.007                    | 0,09                              |
| 5,484 % fällig am 25.08.2037                                                  | 7.169          | 6.410                    | 0,28                              | 5,734 % fällig am 25.10.2037                                              | 4.619          | 3.563                    | 0,16                              | 3,236 % fällig am 18.10.2034                         | 14.000         | 16.388                   | 0,72                              |
| 5,514 % fällig am 25.12.2035                                                  | 1.678          | 1.608                    | 0,07                              | <b>Structured Asset Investment Loan Trust</b>                             |                |                          |                                   | 4,029 % fällig am 15.10.2032                         | 2.500          | 2.941                    | 0,13                              |
| 6,309 % fällig am 25.07.2034                                                  | 125            | 114                      | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.04.2036                                              | 9.607          | 4.593                    | 0,20                              | <b>FTA Consumo Santander</b>                         |                |                          |                                   |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>              |                |                          |                                   | 3,563 % fällig am 20.07.2038                         | 863            | 1.018                    | 0,05                              |
| 4,754 % fällig am 25.12.2036                                                  | 3.037          | 1.665                    | 0,07                              | 4,694 % fällig am 25.05.2036                                              | 203            | 200                      | 0,01                              | 3,913 % fällig am 20.07.2038                         | 863            | 1.018                    | 0,05                              |
| <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>                      |                |                          |                                   | 5,559 % fällig am 25.04.2035                                              | 29             | 30                       | 0,00                              | <b>GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos</b>  |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.07.2034                                                  | 1.884          | 1.853                    | 0,08                              | <b>Terwin Mortgage Trust</b>                                              |                |                          |                                   | 2,949 % fällig am 25.02.2034                         | 2.801          | 3.299                    | 0,15                              |
| 4,874 % fällig am 25.09.2037                                                  | 1.466          | 1.524                    | 0,07                              | 5,379 % fällig am 25.06.2036                                              | 176            | 176                      | 0,01                              | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>                 |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.09.2047                                                  | 656            | 657                      | 0,03                              |                                                                           |                | 109.699                  | 4,82                              | 2,866 % fällig am 22.09.2043                         | 1.261          | 1.487                    | 0,07                              |
| 5,134 % fällig am 25.03.2036                                                  | 1.508          | 1.320                    | 0,06                              | <b>HYPOTHEKEN SEQUENTIELL</b>                                             |                |                          |                                   | <b>GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC</b>        |                |                          |                                   |
| 5,334 % fällig am 25.10.2034                                                  | 157            | 156                      | 0,01                              | <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>                                |                |                          |                                   | 3,056 % fällig am 20.04.2034                         | 2.800          | 3.278                    | 0,14                              |
| 5,409 % fällig am 25.10.2034                                                  | 11             | 11                       | 0,00                              | 4,262 % fällig am 25.11.2036                                              | 168            | 153                      | 0,01                              | <b>Goldentree Loan Management U.S. CLO Ltd.</b>      |                |                          |                                   |
| 5,409 % fällig am 25.01.2036                                                  | 351            | 346                      | 0,02                              | <b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>              |                |                          |                                   | 5,419 % fällig am 20.10.2034                         | \$ 4.000       | 4.003                    | 0,18                              |
| 5,633 % fällig am 25.06.2035                                                  | 92             | 82                       | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.03.2037                                              | 578            | 576                      | 0,02                              | <b>Goodgreen Trust</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization LLC</b>                  |                |                          |                                   |                                                                           |                | 729                      | 0,03                              | 3,930 % fällig am 15.10.2053                         | 1.541          | 1.428                    | 0,06                              |
| 3,084 % fällig am 25.05.2036                                                  | 1.748          | 1.181                    | 0,05                              | <b>FERTIGHAUS SEQUENTIELL</b>                                             |                |                          |                                   | <b>Grosvenor Place CLO DAC</b>                       |                |                          |                                   |
| 3,290 % fällig am 25.03.2034                                                  | 189            | 208                      | 0,01                              | <b>Conseco Finance Corp.</b>                                              |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 15.01.2039                         | € 2.700        | 3.167                    | 0,14                              |
| 3,518 % fällig am 25.02.2037                                                  | 3.121          | 1.834                    | 0,08                              | 6,920 % fällig am 01.12.2030                                              | 565            | 570                      | 0,03                              | <b>Harvest CLO DAC</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>Fremont Home Loan Trust</b>                                                |                |                          |                                   | <b>ABS SONSTIGE</b>                                                       |                |                          |                                   | 1,040 % fällig am 15.07.2031                         | 595            | 678                      | 0,03                              |
| 4,714 % fällig am 25.02.2037                                                  | 4.995          | 3.669                    | 0,16                              | <b>Accunia European CLO DAC</b>                                           |                |                          |                                   | <b>Hayfin Emerald CLO DAC</b>                        |                |                          |                                   |
| 4,914 % fällig am 25.08.2036                                                  | 3.876          | 1.210                    | 0,05                              | 4,163 % fällig am 20.04.2033                                              | € 1.200        | 1.413                    | 0,06                              | 3,337 % fällig am 17.11.2037                         | 3.000          | 3.518                    | 0,15                              |
| 5,364 % fällig am 25.07.2035                                                  | 4.000          | 3.359                    | 0,15                              | <b>Adagio CLO DAC</b>                                                     |                |                          |                                   | 3,586 % fällig am 18.07.2038                         | 1.000          | 1.176                    | 0,05                              |
| <b>GSAA Home Equity Trust</b>                                                 |                |                          |                                   | 3,929 % fällig am 15.04.2032                                              | 2.400          | 2.824                    | 0,12                              | 3,914 % fällig am 22.01.2039                         | 2.900          | 3.408                    | 0,15                              |
| 4,894 % fällig am 25.04.2047                                                  | 3.349          | 1.458                    | 0,06                              | <b>AGL CLO Ltd.</b>                                                       |                |                          |                                   | <b>Henley CLO DAC</b>                                |                |                          |                                   |
| 5,154 % fällig am 25.10.2035                                                  | 1.705          | 1.584                    | 0,07                              | 5,658 % fällig am 20.07.2034                                              | \$ 11.700      | 11.730                   | 0,52                              | 3,148 % fällig am 25.04.2034                         | 2.200          | 2.580                    | 0,11                              |
| <b>GSAMP Trust</b>                                                            |                |                          |                                   | <b>AlbaCore Euro CLO DAC</b>                                              |                |                          |                                   | <b>Holland Park CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |
| 4,704 % fällig am 25.03.2047                                                  | 657            | 502                      | 0,02                              | 3,269 % fällig am 15.07.2035                                              | € 3.500        | 4.114                    | 0,18                              | 3,789 % fällig am 14.11.2032                         | 1.000          | 1.177                    | 0,05                              |
| <b>Home Equity Asset Trust</b>                                                |                |                          |                                   | <b>Anchorage Capital Europe CLO DAC</b>                                   |                |                          |                                   | <b>Indigo Credit Management DAC</b>                  |                |                          |                                   |
| 5,109 % fällig am 25.02.2036                                                  | 993            | 974                      | 0,04                              | 3,499 % fällig am 15.10.2038                                              | 10.600         | 12.425                   | 0,55                              | 3,479 % fällig am 15.07.2038                         | 3.200          | 3.763                    | 0,17                              |
| 5,724 % fällig am 25.08.2033                                                  | 161            | 159                      | 0,01                              | <b>Arbour CLO DAC</b>                                                     |                |                          |                                   | <b>Invesco Euro CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>                           |                |                          |                                   | 3,155 % fällig am 15.12.2038                                              | 2.000          | 2.349                    | 0,10                              | 3,296 % fällig am 30.10.2038                         | 2.400          | 2.812                    | 0,12                              |
| 4,674 % fällig am 25.04.2037                                                  | 5.932          | 4.017                    | 0,18                              | 3,473 % fällig am 15.05.2038                                              | 1.500          | 1.762                    | 0,08                              | <b>Jubilee CLO DAC</b>                               |                |                          |                                   |
| <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Ares European CLO DAC</b>                                              |                |                          |                                   | 2,929 % fällig am 15.04.2031                         | 389            | 454                      | 0,02                              |
| 4,674 % fällig am 25.12.2036                                                  | 5.462          | 2.845                    | 0,12                              | 3,266 % fällig am 21.10.2034                                              | 1.165          | 1.367                    | 0,06                              | <b>Lyra Music Assets Delaware LP</b>                 |                |                          |                                   |
| <b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>                                         |                |                          |                                   | 4,036 % fällig am 21.10.2034                                              | 1.000          | 1.178                    | 0,05                              | 5,760 % fällig am 22.12.2064                         | \$ 16.776      | 16.871                   | 0,74                              |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Attentus CDO Ltd.</b>                                                  |                |                          |                                   | <b>Man GLG Euro CLO DAC</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,514 % fällig am 25.10.2035                                                  | 243            | 243                      | 0,01                              | 4,941 % fällig am 11.10.2042                                              | \$ 7.713       | 6.248                    | 0,27                              | 1,680 % fällig am 15.12.2031                         | € 4.700        | 5.244                    | 0,23                              |
| <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Avoca Static CLO DAC</b>                                               |                |                          |                                   | 1,700 % fällig am 15.10.2030                         | 2.807          | 3.293                    | 0,15                              |
| 3,829 % fällig am 25.01.2035                                                  | 658            | 602                      | 0,03                              | 3,249 % fällig am 15.01.2035                                              | € 925          | 1.086                    | 0,05                              | <b>MAPS Ltd.</b>                                     |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.10.2036                                                  | 1.897          | 828                      | 0,04                              | 3,979 % fällig am 15.01.2035                                              | 1.000          | 1.175                    | 0,05                              | 4,212 % fällig am 15.05.2043                         | \$ 466         | 465                      | 0,02                              |
| 4,684 % fällig am 25.07.2036                                                  | 8.197          | 7.451                    | 0,33                              | <b>Bain Capital Credit CLO Ltd.</b>                                       |                |                          |                                   | <b>Marzio Finance SRL</b>                            |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                  | 3.234          | 1.177                    | 0,05                              | 5,299 % fällig am 21.10.2034                                              | \$ 12.800      | 12.739                   | 0,56                              | 2,759 % fällig am 28.09.2049                         | € 2.123        | 2.502                    | 0,11                              |
| 4,934 % fällig am 25.07.2036                                                  | 3.234          | 1.182                    | 0,05                              | 5,359 % fällig am 21.10.2034                                              | 12.200         | 12.213                   | 0,54                              | <b>National Collegiate Student Loan Trust</b>        |                |                          |                                   |
| 5,014 % fällig am 25.01.2036                                                  | 1.348          | 1.309                    | 0,06                              | 5,469 % fällig am 20.10.2034                                              | 8.500          | 8.521                    | 0,37                              | 4,744 % fällig am 25.05.2032                         | \$ 719         | 717                      | 0,03                              |
| <b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>                                  |                |                          |                                   | 5,489 % fällig am 23.10.2034                                              | 8.800          | 8.806                    | 0,39                              | <b>Ocean Trails CLO</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,534 % fällig am 25.04.2037                                                  | 126            | 65                       | 0,00                              | 5,879 % fällig am 23.10.2034                                              | 2.300          | 2.303                    | 0,10                              | 5,299 % fällig am 20.07.2034                         | 21.000         | 21.003                   | 0,92                              |
| <b>Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust</b>                          |                |                          |                                   | <b>Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.</b>                           |                |                          |                                   | 5,556 % fällig am 15.10.2034                         | 1.000          | 1.001                    | 0,04                              |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                  | 3.371          | 1.324                    | 0,06                              | 5,699 % fällig am 11.04.2045                                              | 5.000          | 4.997                    | 0,22                              | <b>Palmer Square European Loan Funding DAC</b>       |                |                          |                                   |
| <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                                        |                |                          |                                   | 5,709 % fällig am 11.04.2045                                              | 5.000          | 4.999                    | 0,22                              | 3,113 % fällig am 15.08.2033                         | € 2.590        | 3.040                    | 0,13                              |
| 4,694 % fällig am 25.03.2037                                                  | 17.354         | 11.289                   | 0,50                              | 5,781 % fällig am 11.04.2043                                              | 2.759          | 2.756                    | 0,12                              | 3,133 % fällig am 15.05.2034                         | 3.802          | 4.460                    | 0,20                              |
| <b>Option One Mortgage Loan Trust</b>                                         |                |                          |                                   | 5,806 % fällig am 11.04.2043                                              | 6.438          | 6.436                    | 0,28                              | 3,143 % fällig am 15.05.2034                         | 2.164          | 2.538                    | 0,11                              |
| 4,574 % fällig am 25.03.2037                                                  | 4.013          | 3.672                    | 0,16                              | 7,906 % fällig am 11.04.2043                                              | 2.500          | 2.543                    | 0,11                              | 3,793 % fällig am 15.05.2033                         | 1.000          | 1.176                    | 0,05                              |
|                                                                               |                |                          |                                   |                                                                           |                |                          |                                   | 3,843 % fällig am 15.08.2033                         | 2.500          | 2.942                    | 0,13                              |
|                                                                               |                |                          |                                   |                                                                           |                |                          |                                   | 3,870 % fällig am 15.10.2034                         | 1.000          | 1.177                    | 0,05                              |
|                                                                               |                |                          |                                   |                                                                           |                |                          |                                   | 3,993 % fällig am 15.05.2034                         | 1.000          | 1.177                    | 0,05                              |

| BESCHREIBUNG                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,033 % fällig am 15.05.2034       | € 1.000        | \$ 1.176                 | 0,05                              | 4,179 % fällig am 15.01.2033                   | 1.000          | 1.176                    | 0,05                              | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>          |                |                          |                                   |
| Pikes Peak CLO                     |                |                          |                                   | Trinitas CLO Ltd.                              |                |                          |                                   | <b>U.S. TREASURY BILLS</b>               |                |                          |                                   |
| 5,466 % fällig am 15.07.2034       | \$ 10.000      | 10.007                   | 0,44                              | 5,309 % fällig am 20.07.2035                   | \$ 12.900      | 12.836                   | 0,56                              | 4,304 % fällig am                        |                |                          |                                   |
| 5,489 % fällig am 11.10.2034       | 10.000         | 10.010                   | 0,44                              | 5,379 % fällig am 20.10.2033                   | 17.700         | 17.709                   | 0,78                              | 18.09.2025 (c)(d)                        | \$ 3.600       | \$ 3.567                 | 0,16                              |
| Plenti PL & Green ABS Trust        |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   | 4,324 % fällig am                        |                |                          |                                   |
| 4,935 % fällig am 11.04.2036       | AUD 4.584      | 3.009                    | 0,13                              |                                                |                | 361.731                  | 15,90                             | 18.09.2025 (c)(d)                        | 5.400          | 5.350                    | 0,23                              |
| Regatta Funding Ltd.               |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   | Summe kurzfristige Instrumente           |                | 8.917                    | 0,39                              |
| 5,456 % fällig am 15.01.2033       | \$ 9.736       | 9.738                    | 0,43                              | <b>SICHERHEITEN WHOLE LOANS</b>                |                |                          |                                   | Summe Übertragbare Wertpapiere           |                | \$ 4.317.745             | 189,83                            |
| Rockford Tower Europe CLO DAC      | € 2.400        | 2.819                    | 0,12                              | First Franklin Mortgage Loan Trust             | 59             | 59                       | 0,00                              |                                          |                |                          |                                   |
| 3,561 % fällig am 24.04.2037       |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 25.01.2036                   |                |                          |                                   | <b>AKTIEN</b>                            |                |                          |                                   |
| Sapphire Aviation Finance Ltd.     |                |                          |                                   | Household Capital RMBS                         | AUD 1.600      | 1.049                    | 0,05                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040       | \$ 160         | 159                      | 0,01                              | 0,000 % fällig am 21.07.2087                   |                |                          |                                   | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                |                          |                                   |
| SLM Student Loan Trust             |                |                          |                                   | Lehman XS Trust                                | \$ 2.421       | 2.281                    | 0,10                              | PIMCO Select Funds plc -                 |                |                          |                                   |
| 2,558 % fällig am 25.10.2039       | € 1.133        | 1.240                    | 0,05                              | 4,854 % fällig am 25.06.2046                   |                |                          |                                   | PIMCO US Dollar Short-                   |                |                          |                                   |
| SoFi Professional Loan Program LLC |                |                          |                                   | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust | 2.702          | 1.904                    | 0,08                              | Term Floating NAV                        | 456            | 5                        | 0,00                              |
| 2,650 % fällig am 25.09.2040       | \$ 14          | 14                       | 0,00                              | 4,554 % fällig am 25.09.2036                   |                |                          |                                   | Fund (e)                                 |                |                          |                                   |
| Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.    |                |                          |                                   |                                                |                | 5.293                    | 0,23                              | Summe Investmentfonds                    |                | \$ 5                     | 0,00                              |
| 4,147 % fällig am 15.09.2038       | 3.211          | 3.196                    | 0,14                              |                                                |                | 607.782                  | 26,72                             |                                          |                |                          |                                   |
| TIAA CLO Ltd.                      |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
| 5,672 % fällig am 16.01.2031       | 442            | 443                      | 0,02                              |                                                |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                  | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|--------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOS                     | 4,480 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 25.000          | U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 30.04.2028 | \$ (25.564)                | \$ 25.000                           | \$ 25.003                                                           | 1,10                         |
| FICC                    | 4,400           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 4.200              | U.S. Treasury Notes 3,750 % fällig am 30.06.2027 | (4.284)                    | 4.200                               | 4.201                                                               | 0,18                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                                  | \$ (29.848)                | \$ 29.200                           | \$ 29.204                                                           | 1,28                         |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                                  | Long  | 03.2026          | 407                     | \$ (440)                                        | (0,02)                       |
| 3-Month SOFR December Futures                                  | Long  | 03.2027          | 1.969                   | 1.161                                           | 0,05                         |
| 3-Month SOFR June Futures                                      | Long  | 09.2026          | 438                     | 73                                              | 0,00                         |
| 3-Month SOFR March Futures                                     | Short | 06.2026          | 2.161                   | 792                                             | 0,04                         |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025          | 815                     | (636)                                           | (0,03)                       |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025          | 300                     | 393                                             | 0,02                         |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Short | 09.2025          | 4.625                   | (9.428)                                         | (0,41)                       |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025          | 479                     | (964)                                           | (0,04)                       |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025          | 27                      | (133)                                           | (0,01)                       |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | \$ (9.182)                                      | (0,40)                       |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 2.100         | \$ 31                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750              | 19.03.2055            | 400             | 17                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,827              | 03.07.2028            | \$ 39.385       | (2.494)                                         | (0,11)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,790              | 07.05.2029            | 14.800          | 32                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 21.06.2033            | 3.100           | (103)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,043              | 07.08.2028            | 14.800          | (187)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,480              | 07.02.2032            | 22.600          | (145)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.12.2030            | 400             | 24                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 21.08.2031            | 5.100           | (149)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.06.2054            | 9.100           | 618                                             | 0,03                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex       | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500 %            | 18.12.2054            | \$ 7.100        | \$ 628                                          | 0,03                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,510              | 08.03.2033            | 100             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,525              | 13.11.2031            | 12.400          | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,545              | 31.10.2030            | 400             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,547              | 31.10.2030            | 1.000           | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,550              | 31.10.2030            | 900             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,561              | 09.04.2030            | 26.900          | 59                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,572              | 31.10.2030            | 900             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,582              | 31.10.2030            | 1.500           | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,595              | 31.10.2030            | 1.100           | (2)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,601              | 31.10.2030            | 2.000           | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,602              | 31.10.2030            | 2.000           | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,606              | 31.10.2030            | 900             | (2)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,623              | 31.10.2030            | 900             | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,632              | 13.11.2031            | 12.400          | 52                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,638              | 31.05.2028            | 800             | (5)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,655              | 31.05.2028            | 1.500           | (10)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,664              | 31.10.2030            | 500             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,677              | 31.10.2030            | 400             | (2)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,687              | 31.10.2030            | 800             | (5)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,689              | 31.10.2030            | 1.200           | (8)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,691              | 31.10.2030            | 900             | (6)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,705              | 10.01.2031            | 1.200           | 6                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,721              | 31.10.2030            | 500             | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,722              | 31.10.2030            | 500             | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,727              | 31.10.2030            | 500             | (5)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,732              | 31.10.2030            | 400             | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735              | 31.10.2030            | 500             | (5)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,739              | 31.10.2030            | 500             | (5)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,740              | 10.07.2030            | 1.500           | 12                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,749              | 31.10.2030            | 500             | (5)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2026            | 42.500          | (371)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2028            | 100             | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2028            | 52.800          | 1.151                                           | 0,05                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2029            | 27.300          | 235                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2029            | 28.400          | (97)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2031            | 3.800           | (94)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2034            | 31.000          | 210                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,760              | 13.11.2031            | 12.400          | 152                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,807              | 31.05.2028            | 500             | (5)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,916              | 10.06.2031            | 40.900          | 1.280                                           | 0,06                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,940              | 10.04.2029            | 23.600          | 519                                             | 0,02                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 20.12.2025            | 2.400           | (18)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,320              | 10.10.2030            | 800             | 35                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR           | 0,250              | 18.03.2050            | € 2.400         | 1.173                                           | 0,05                         |
| Zahlung <sup>(1)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250              | 17.09.2030            | 22.530          | 249                                             | 0,01                         |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR           | 2,250              | 17.09.2035            | 14.300          | (160)                                           | (0,01)                       |
|                                                |                               |                    |                       |                 | \$ 2.574                                        | 0,11                         |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                               |                    |                       |                 | \$ 2.574                                        | 0,11                         |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### OPTIONSKAUF ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 2,950 %            | 11.07.2025         | 36.000                         | \$ 346 | \$ 1           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,290              | 11.12.2025         | 5.600                          | 81     | 57             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,368              | 04.09.2025         | 108.400                        | 515    | 680            | 0,03                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 5,000              | 29.08.2025         | 496.600                        | 194    | 5              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 5,000              | 08.10.2025         | 194.400                        | 288    | 16             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 5,000              | 20.03.2026         | 20.800                         | 76     | 29             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,098              | 06.02.2035         | 6.600                          | 586    | 523            | 0,02                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,098              | 06.02.2035         | 6.600                          | 586    | 632            | 0,03                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,245              | 20.02.2035         | 10.900                         | 940    | 905            | 0,04                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,245              | 20.02.2035         | 10.900                         | 940    | 995            | 0,04                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,260              | 13.02.2035         | 10.900                         | 952    | 913            | 0,04                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,260              | 13.02.2035         | 10.900                         | 952    | 994            | 0,04                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,265              | 01.05.2035         | 6.000                          | 531    | 509            | 0,02                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,265              | 01.05.2035         | 6.000                          | 531    | 551            | 0,02                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,470              | 04.06.2035         | 6.100                          | 547    | 562            | 0,02                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 4,470              | 04.06.2035         | 6.100                          | 547    | 534            | 0,02                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 5,000              | 11.09.2025         | 31.800                         | 86     | 2              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 5,500              | 30.01.2026         | 14.700                         | 62     | 9              | 0,00                         |

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|-----------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,500 %            | 17.10.2025         | 21.500                         | \$ 43     | \$ 0           | 0,00                         |
| BRC        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 12.09.2025         | 93.000                         | 27        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 24.10.2025         | 34.000                         | 27        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 06.04.2026         | 30.500                         | 92        | 49             | 0,00                         |
| CBK        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,400              | 19.05.2027         | 13.900                         | 79        | 77             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,750              | 31.10.2025         | 19.900                         | 27        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 25.09.2025         | 80.700                         | 133       | 0              | 0,00                         |
| DUB        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 02.09.2025         | 25.000                         | 47        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,500              | 03.11.2025         | 21.100                         | 36        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 6,000              | 02.09.2025         | 25.000                         | 19        | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,308              | 02.05.2035         | 6.600                          | 587       | 570            | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,308              | 02.05.2035         | 6.600                          | 587       | 601            | 0,03                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,440              | 18.06.2035         | 9.500                          | 850       | 866            | 0,04                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,440              | 18.06.2035         | 9.500                          | 850       | 839            | 0,04                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,520              | 29.05.2035         | 6.700                          | 603       | 629            | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,520              | 29.05.2035         | 6.700                          | 603       | 580            | 0,03                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,630              | 22.05.2035         | 6.700                          | 613       | 657            | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,630              | 22.05.2035         | 6.700                          | 613       | 566            | 0,03                         |
| FAR        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 16.12.2025         | 27.800                         | 28        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,250              | 03.03.2026         | 44.000                         | 18        | 1              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,262              | 11.09.2025         | 8.700                          | 75        | 2              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,500              | 29.05.2026         | 36.000                         | 142       | 162            | 0,01                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,750              | 09.02.2026         | 22.500                         | 83        | 100            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,755              | 12.09.2025         | 50.500                         | 905       | 47             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 11.07.2025         | 133.000                        | 168       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 18.09.2025         | 215.600                        | 43        | 7              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 30.03.2026         | 15.700                         | 61        | 24             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 31.03.2026         | 17.400                         | 65        | 27             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 03.04.2026         | 23.500                         | 77        | 38             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,740              | 30.10.2025         | 14.800                         | 111       | 19             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,073              | 07.03.2035         | 9.500                          | 826       | 742            | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,073              | 07.03.2035         | 9.500                          | 826       | 913            | 0,04                         |
| GLM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,740              | 30.10.2025         | 10.900                         | 111       | 10             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,400              | 19.05.2027         | 20.000                         | 107       | 111            | 0,01                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,700              | 25.09.2025         | 34.800                         | 16        | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,750              | 10.11.2025         | 11.500                         | 90        | 27             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,310              | 24.04.2035         | 6.500                          | 575       | 561            | 0,02                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,310              | 24.04.2035         | 6.500                          | 575       | 590            | 0,03                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,430              | 16.05.2035         | 6.600                          | 591       | 598            | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,430              | 16.05.2035         | 6.600                          | 591       | 583            | 0,03                         |
| JPM        | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,500              | 20.02.2026         | 38.000                         | 75        | 109            | 0,01                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,750              | 05.02.2026         | 22.700                         | 93        | 99             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,285              | 07.05.2035         | 6.700                          | 602       | 576            | 0,03                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,285              | 07.05.2035         | 6.700                          | 602       | 616            | 0,03                         |
| MYC        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 29.12.2025         | 28.400                         | 36        | 1              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,081              | 08.12.2025         | 20.000                         | 242       | 127            | 0,01                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,313              | 08.06.2026         | 20.000                         | 411       | 333            | 0,01                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,985              | 29.10.2025         | 13.900                         | 265       | 52             | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,313              | 08.06.2026         | 20.000                         | 411       | 145            | 0,01                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 30.09.2025         | 301.700                        | 167       | 17             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 2,500              | 22.08.2025         | 17.000                         | 211       | 1              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 4,250              | 28.11.2025         | 31.200                         | 480       | 161            | 0,01                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 18.08.2025         | 66.000                         | 84        | 1              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 10.09.2025         | 58.800                         | 163       | 4              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 12.09.2025         | 27.900                         | 73        | 2              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 16.09.2025         | 28.200                         | 75        | 2              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 5,000              | 26.09.2025         | 37.600                         | 135       | 5              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 6,000              | 17.10.2025         | 21.500                         | 147       | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ 24.952 | \$ 20.164      | 0,89                         |

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung                                        | Variabler Zinssatzindex       | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| DUB        | Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,033 %            | 26.01.2027         | 255.000                        | \$ 3.060 | \$1.089        | 0,05                         |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2055  | \$ 95,359          | 07.07.2025         | 27.500                         | \$ 82  | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2055 | 97,734             | 06.08.2025         | 42.700                         | 123    | 309            | 0,02                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.09.2055  | 98,719             | 08.09.2025         | 28.500                         | 53     | 12             | 0,00                         |
| GSC        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2055  | 94,844             | 07.07.2025         | 28.500                         | 94     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2055  | 95,289             | 07.07.2025         | 27.500                         | 79     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.07.2055  | 97,281             | 07.07.2025         | 27.500                         | 43     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.07.2055  | 97,352             | 07.07.2025         | 27.500                         | 47     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.08.2055  | 96,695             | 06.08.2025         | 27.000                         | 84     | 6              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.09.2055  | 96,738             | 08.09.2025         | 39.000                         | 123    | 37             | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.07.2055 | 102,195            | 07.07.2025         | 37.000                         | 61     | 2              | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055  | \$ 98,277          | 06.08.2025         | 28.500                         | \$ 58    | \$ 1           | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055  | 98,508             | 06.08.2025         | 27.000                         | 53       | 2              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055  | 98,559             | 06.08.2025         | 27.000                         | 37       | 2              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055  | 98,629             | 06.08.2025         | 28.500                         | 37       | 2              | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.09.2055  | 99,141             | 08.09.2025         | 40.000                         | 47       | 24             | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.09.2055  | 99,156             | 08.09.2025         | 40.000                         | 45       | 25             | 0,00                         |
| JPM        | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2055 | 98,438             | 07.07.2025         | 28.000                         | 88       | 24             | 0,00                         |
| MSC        | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2055 | 98,434             | 07.07.2025         | 27.500                         | 97       | 24             | 0,00                         |
| SAL        | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2055 | 97,641             | 06.08.2025         | 8.500                          | 25       | 66             | 0,00                         |
|            |                                                                               |                    |                    |                                | \$ 1.276 | \$ 536         | 0,02                         |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|------------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,330 %            | 08.10.2025         | 21.600                         | \$ (288)   | \$ (169)       | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,943              | 07.07.2025         | 28.300                         | (83)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,968              | 04.09.2025         | 83.500                         | (515)      | (143)          | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053              | 07.07.2025         | 30.900                         | (93)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,236              | 06.08.2025         | 20.300                         | (37)       | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,368              | 06.08.2025         | 20.300                         | (57)       | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,670              | 29.08.2025         | 21.800                         | (194)      | (261)          | (0,01)                       |
| BPS        | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,215              | 06.08.2025         | 22.500                         | (85)       | (3)            | 0,00                         |
| BRC        | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 2,750              | 07.07.2025         | 18.000                         | (92)       | 0              | 0,00                         |
| DUB        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 5,500              | 02.09.2025         | 50.000                         | (57)       | 0              | 0,00                         |
| FAR        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 5,500              | 16.12.2025         | 27.800                         | (14)       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 2,980              | 03.07.2025         | 18.000                         | (77)       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,245              | 07.07.2025         | 19.400                         | (88)       | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,300              | 18.09.2025         | 11.500                         | (43)       | (69)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,550              | 11.07.2025         | 21.000                         | (168)      | (103)          | (0,01)                       |
| GLM        | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,257              | 08.09.2025         | 21.200                         | (52)       | (11)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,270              | 06.08.2025         | 19.300                         | (35)       | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,287              | 06.08.2025         | 18.800                         | (51)       | (2)            | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,967              | 07.07.2025         | 25.900                         | (79)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,984              | 07.07.2025         | 17.300                         | (43)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,993              | 07.07.2025         | 19.200                         | (47)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,096              | 08.09.2025         | 25.400                         | (47)       | (27)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,106              | 08.09.2025         | 26.600                         | (45)       | (27)           | 0,00                         |
| MYC        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap   | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 5,500              | 29.12.2025         | 28.400                         | (17)       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,170              | 16.07.2025         | 22.000                         | (95)       | (9)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,453              | 30.09.2025         | 22.000                         | (167)      | (224)          | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,395              | 07.07.2025         | 18.500                         | (98)       | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,317              | 08.09.2025         | 28.100                         | (124)      | (31)           | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ (2.791) | \$ (1.087)     | (0,05)                       |

#### ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung                                        | Variabler Zinssatzindex       | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|------------|----------------|------------------------------|
| DUB        | Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,021 %            | 26.01.2027         | 255.000                        | \$ (1.158) | \$ (313)       | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor <sup>(2)</sup> | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 0,027              | 26.01.2027         | 255.000                        | (1.887)    | (588)          | (0,03)                       |
|            |                                                     |                               |                    |                    |                                | \$ (3.045) | \$ (901)       | (0,04)                       |

#### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.09.2055 | \$ 96,719          | 08.09.2025         | 12.500                         | \$ (47)  | \$ (53)        | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055 | 101,422            | 06.08.2025         | 14.500                         | (37)     | (58)           | (0,01)                       |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055 | 101,664            | 06.08.2025         | 14.500                         | (24)     | (39)           | 0,00                         |
| GSC        | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055 | 101,531            | 06.08.2025         | 15.000                         | (33)     | (51)           | 0,00                         |
| MSC        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2055  | 91,438             | 07.07.2025         | 45.000                         | (241)    | (5)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2055  | 94,813             | 07.07.2025         | 20.000                         | (78)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2055 | 98,813             | 07.07.2025         | 20.000                         | (69)     | (5)            | 0,00                         |
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | 92,469             | 07.07.2025         | 2.000                          | (11)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469             | 07.07.2025         | 2.000                          | (9)      | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.08.2055 | 101,828            | 06.08.2025         | 15.000                         | (33)     | (29)           | 0,00                         |
|            |                                                                               |                    |                    |                                | \$ (582) | \$ (241)       | (0,01)                       |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

<sup>(2)</sup> Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 1.125                | \$ 1.294                 | \$ 0                             | \$ (27)                            | \$ (27)                                              | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £ 1.029                | 1.412                    | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 17.508              | AUD 26.952               | 155                              | 0                                  | 155                                                  | 0,01                         |
|            | 08.2025               | AUD 26.952             | \$ 17.518                | 0                                | (156)                              | (156)                                                | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | \$ 532                 | € 454                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
| BOA        | 08.2025               | 1.412                  | £ 1.029                  | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | € 231.698              | \$ 263.452               | 0                                | (8.527)                            | (8.527)                                              | (0,37)                       |
|            | 07.2025               | \$ 686                 | € 591                    | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025               | £ 538                  | \$ 726                   | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 166.457             | £ 122.340                | 1.192                            | 0                                  | 1.192                                                | 0,05                         |
| BRC        | 08.2025               | £ 122.340              | \$ 166.480               | 0                                | (1.193)                            | (1.193)                                              | (0,05)                       |
|            | 07.2025               | \$ 1.184               | AUD 1.820                | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 563                    | € 492                    | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                         |
| CBK        | 07.2025               | 2.413                  | £ 1.774                  | 23                               | (5)                                | 18                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 267.186                | € 230.313                | 3.167                            | 0                                  | 3.167                                                | 0,14                         |
|            | 08.2025               | € 229.808              | \$ 267.186               | 0                                | (3.162)                            | (3.162)                                              | (0,14)                       |
| DUB        | 07.2025               | AUD 28.020             | 18.078                   | 0                                | (284)                              | (284)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$ 8.467               | AUD 12.919               | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
| FAR        | 08.2025               | AUD 12.919             | \$ 8.472                 | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 13.671                 | 8.933                    | 0                                | (26)                               | (26)                                                 | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | \$ 1.123               | € 972                    | 18                               | 0                                  | 18                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               | € 24                   | \$ 28                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| MBC        | 07.2025               | \$ 4                   | € 4                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 95                     | £ 70                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £ 122.547              | \$ 165.931               | 0                                | (2.001)                            | (2.001)                                              | (0,09)                       |
| SSB        | 07.2025               | \$ 528                 | € 455                    | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 4.596                         | \$ (15.395)                        | \$ (10.799)                                          | (0,47)                       |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CAD 8.597              | \$ 6.302                 | \$ 2                             | \$ 0                               | \$ 2                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$ 6.302               | CAD 8.582                | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025               | 231                    | 314                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 10.292                 | 14.170                   | 92                               | 0                                  | 92                                                   | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025               | 10.979                 | 15.177                   | 144                              | 0                                  | 144                                                  | 0,01                         |
|            | 07.2025               | 253                    | 345                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| CBK        | 07.2025               | CAD 15.325             | \$ 11.149                | 0                                | (83)                               | (83)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 10.958              | CAD 15.050               | 72                               | 0                                  | 72                                                   | 0,00                         |
| JPM        | 08.2025               | 11.149                 | 15.300                   | 83                               | 0                                  | 83                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 76                     | 104                      | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
| MBC        | 07.2025               | CAD 15.327             | \$ 11.231                | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$ 11.231              | CAD 15.302               | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 396                           | \$ (88)                            | \$ 308                                               | 0,01                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CHF 653                | \$ 818                   | \$ 0                             | \$ (3)                             | \$ (3)                                               | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$ 818                 | CHF 651                  | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025               | 18                     | 14                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 3                      | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| CBK        | 07.2025               | CHF 655                | \$ 819                   | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$ 794                 | CHF 654                  | 27                               | 0                                  | 27                                                   | 0,00                         |
| FAR        | 08.2025               | 819                    | 653                      | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 789                    | 648                      | 26                               | 0                                  | 26                                                   | 0,00                         |
| MBC        | 07.2025               | 747                    | 612                      | 23                               | 0                                  | 23                                                   | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 84                            | \$ (8)                             | \$ 76                                                | 0,00                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 242.932              | \$ 284.444               | \$ 0                             | \$ (721)                           | \$ (721)                                             | (0,03)                       |
|            | 07.2025               | \$ 259.128             | € 228.061                | 8.581                            | 0                                  | 8.581                                                | 0,38                         |
|            | 08.2025               | 285.068                | 242.932                  | 720                              | 0                                  | 720                                                  | 0,03                         |
| BOA        | 07.2025               | 273.010                | 240.104                  | 8.836                            | 0                                  | 8.836                                                | 0,39                         |
|            | 07.2025               | € 69                   | \$ 80                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
|            | 07.2025               | \$ 94                  | € 83                     | \$ 3                             | \$ 0                               | \$ 3                                                 | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | € 1.138                | \$ 1.305                 | 0                                | (31)                               | (31)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 274.070             | € 241.335                | 9.221                            | 0                                  | 9.221                                                | 0,40                      |
| CBK        | 07.2025               | € 113                  | \$ 131                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 188                 | € 163                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | € 245.258              | \$ 284.524               | 0                                | (3.371)                            | (3.371)                                              | (0,15)                    |
|            | 08.2025               | \$ 284.524             | € 244.720                | 3.368                            | 0                                  | 3.368                                                | 0,15                      |
| MBC        | 07.2025               | € 661                  | \$ 760                   | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 12.324              | € 10.719                 | 258                              | 0                                  | 258                                                  | 0,01                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 30.991                        | \$ (4.141)                         | \$ 26.850                                            | 1,18                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD                              | 07.2025               | £ 8.769                | \$ 12.032                | \$ 16                            | \$ 0                               | \$ 16                                                | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | \$ 12.034              | £ 8.769                  | 0                                | (16)                               | (16)                                                 | 0,00                      |
| BRC                              | 07.2025               | £ 9.395                | \$ 12.781                | 0                                | (93)                               | (93)                                                 | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$ 12.113              | £ 8.972                  | 181                              | 0                                  | 181                                                  | 0,01                      |
|                                  | 08.2025               | 12.660                 | 9.304                    | 91                               | 0                                  | 91                                                   | 0,00                      |
| CBK                              | 07.2025               | £ 9                    | \$ 12                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$ 446                 | £ 327                    | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                      |
| JPM                              | 07.2025               | 12.106                 | 8.986                    | 208                              | 0                                  | 208                                                  | 0,01                      |
| MBC                              | 07.2025               | 218                    | 161                      | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| SSB                              | 07.2025               | £ 9.217                | \$ 12.638                | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$ 12.109              | £ 8.943                  | 146                              | 0                                  | 146                                                  | 0,01                      |
|                                  | 08.2025               | 12.639                 | 9.217                    | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                      |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 655                           | \$ (117)                           | \$ 538                                               | 0,03                      |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 36.533                                            | 1,61                      |

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|---------------------------------------|----------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>          |                |                          |                              |
| Ginnie Mae, TBA                       |                |                          |                              |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055          | \$ 44.298      | \$ (40.279)              | (1,77)                       |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |                |                          |                              |
| 2,000 % fällig am 01.07.2040          | 17.800         | (16.270)                 | (0,72)                       |
| 2,500 % fällig am 01.08.2055          | 118.700        | (98.454)                 | (4,33)                       |
| 3,000 % fällig am 01.07.2040          | 500            | (477)                    | (0,02)                       |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055          | 68.050         | (58.894)                 | (2,59)                       |
| 3,000 % fällig am 01.08.2055          | 182.000        | (157.470)                | (6,92)                       |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055          | 34.400         | (30.975)                 | (1,36)                       |
| 4,000 % fällig am 01.08.2055          | 34.300         | (31.891)                 | (1,40)                       |
| 5,500 % fällig am 01.08.2055          | 7.650          | (7.643)                  | (0,34)                       |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere       |                | \$ (442.353)             | (19,45)                      |
| Summe Anlagen                         |                | \$ 3.934.522             | 172,98                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva           |                | \$ (1.659.971)           | (72,98)                      |
| Nettovermögen                         |                | \$ 2.274.551             | 100,00                       |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 410.224 USD (31. Dezember 2024: 42.284 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 2.375 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 1.506 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von 17.231 USD (31. Dezember 2024: 13.717 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 2.150 USD (31. Dezember 2024: 8.530 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 4.296.014                                                    | \$ 21.731                                                    | \$ 4.317.745        |
| Investmentfonds               | 5                                                                           | 0                                                               | 0                                                            | 5                   |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 29.200                                                          | 0                                                            | 29.200              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | 29.925                                                          | 0                                                            | 29.925              |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (442.353)                                                       | 0                                                            | (442.353)           |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 5</b>                                                                 | <b>\$ 3.912.786</b>                                             | <b>\$ 21.731</b>                                             | <b>\$ 3.934.522</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 3.152.636                                                    | \$ 20.391                                                    | \$ 3.173.027        |
| Investmentfonds               | 4                                                                           | 0                                                               | 0                                                            | 4                   |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 5.600                                                           | 0                                                            | 5.600               |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | 775                                                             | 0                                                            | 775                 |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (299.909)                                                       | 0                                                            | (299.909)           |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 4</b>                                                                 | <b>\$ 2.859.102</b>                                             | <b>\$ 20.391</b>                                             | <b>\$ 2.879.497</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:**

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|------------------------------|
| CIB                                       | 4,470 %         | 12.06.2025            | 14.07.2025            | \$ (189.444)      | \$ (189.891)                                                    | (8,35)                       |
| FAR                                       | 4,460           | 12.06.2025            | 14.07.2025            | (98.236)          | (98.467)                                                        | (4,33)                       |
| SBI                                       | 4,460           | 26.06.2025            | 14.07.2025            | (103.932)         | (103.996)                                                       | (4,57)                       |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                   | <b>\$ (392.354)</b>                                             | <b>(17,25)</b>               |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 8.553                            | \$ (7.720)                            | \$ 833                              | \$ k. A.                            | \$ k. A.                              | \$ k. A.                            |
| BOA        | 7.820                               | (730)                                 | 7.090                               | 171                                 | (250)                                 | (79)                                |
| BPS        | 99                                  | 0                                     | 99                                  | 122                                 | 0                                     | 122                                 |
| BRC        | 9.406                               | (8.750)                               | 656                                 | 587                                 | (510)                                 | 77                                  |
| CBK        | 267                                 | (260)                                 | 7                                   | 196                                 | 0                                     | 196                                 |
| DUB        | 5.498                               | (260)                                 | 5.238                               | (4.992)                             | 4.400                                 | (592)                               |
| FAR        | 1.661                               | (20)                                  | 1.641                               | 897                                 | (810)                                 | 87                                  |
| GLM        | 2.455                               | 0                                     | 2.455                               | (118)                               | 0                                     | (118)                               |
| GSC        | 50                                  | 0                                     | 50                                  | 330                                 | 0                                     | 330                                 |
| JPM        | 1.578                               | 0                                     | 1.578                               | (66)                                | 0                                     | (66)                                |
| MBC        | 335                                 | (320)                                 | 15                                  | (660)                               | 430                                   | (230)                               |
| MSC        | 14                                  | 0                                     | 14                                  | (647)                               | 0                                     | (647)                               |
| MYC        | 586                                 | (760)                                 | (174)                               | 3.097                               | (3.080)                               | 17                                  |
| RBC        | 23                                  | 0                                     | 23                                  | (6)                                 | 0                                     | (6)                                 |
| SAL        | 36                                  | 0                                     | 36                                  | 38                                  | 0                                     | 38                                  |
| SCX        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | (4.244)                             | 3.700                                 | (544)                               |
| SSB        | (1.849)                             | 2.150                                 | 301                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| UAG        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (19)                                | 0                                     | (19)                                |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

## Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 2,48              | 2,00              |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 48,86             | 55,35             |
| Investmentfonds                                                        | 0,00              | 0,00              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 0,35              | 0,10              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,03              | 0,09              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,08              | 0,20              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,70              | 0,16              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 47,50             | 42,10             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                               | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                    | 0,13              | 0,03              |
| Kommunalanleihen und Wechsel                        | 0,07              | 0,08              |
| US-Regierungsbehörden                               | 145,71            | 134,96            |
| US-Schatzobligationen                               | k. A.             | 0,06              |
| Non-Agency-MBS                                      | 16,81             | 15,87             |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                    | 26,72             | 26,14             |
| Kurzfristige Instrumente                            | 0,39              | k. A.             |
| Investmentfonds                                     | 0,00              | 0,00              |
| Pensionsgeschäfte                                   | 1,28              | 0,31              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate |                   |                   |
| Futures                                             | (0,40)            | 0,09              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                 |                   |                   |
| Zinsswaps                                           | 0,11              | 0,25              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                          |                   |                   |
| Optionskauf                                         |                   |                   |
| Zinsswaptionen                                      | 0,89              | 0,33              |
| Zinsscaps                                           | 0,05              | 0,05              |
| Optionen auf Wertpapiere                            | 0,02              | 0,04              |
| Verkaufsoptionen                                    |                   |                   |
| Zinsswaptionen                                      | (0,05)            | (0,10)            |
| Zinsscaps                                           | (0,04)            | (0,04)            |
| Optionen auf Wertpapiere                            | (0,01)            | (0,05)            |
| Devisenterminkontrakte                              | (0,47)            | 0,29              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                 | 1,22              | (0,82)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                           | (19,45)           | (16,74)           |
| Sonstige Aktiva und Passiva                         | (72,98)           | (60,75)           |
| Nettovermögen                                       | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG      |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |
| Bank of Industry Ltd.                   |                |                          |                                   | 3,509 % fällig am 23.01.2029         | \$ 10.611      | \$ 10.395                | 0,20                              | JetBlue Pass-Through Trust              | \$ 223         | \$ 196                   | 0,00                              |
| 3,695 % fällig am 23.08.2027            | € 7.600        | \$ 8.862                 | 0,17                              | 3,960 % fällig am 29.01.2027         | 2.200          | 2.194                    | 0,04                              | 2,750 % fällig am 15.11.2033            | 141            | 132                      | 0,00                              |
|                                         |                |                          |                                   | 4,603 % fällig am 22.10.2030         | 19.100         | 19.169                   | 0,36                              | 4,000 % fällig am 15.05.2034            |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL        |                |                          |                                   | Lloyds Banking Group PLC             |                |                          |                                   | 3,522 % fällig am 17.09.2025            | 2.000          | 1.989                    | 0,04                              |
| BANKEN UND FINANZEN                     |                |                          |                                   | 5,985 % fällig am 07.08.2027         | 11.419         | 11.595                   | 0,22                              | Occidental Petroleum Corp.              |                |                          |                                   |
| ABN AMRO Bank NV                        |                |                          |                                   | Logicor Financing SARRL              | € 3.000        | 3.629                    | 0,07                              | 5,000 % fällig am 01.08.2027            | 7.100          | 7.166                    | 0,14                              |
| 4,718 % fällig am 22.01.2027            | \$ 23.800      | 24.020                   | 0,45                              | Met Tower Global Funding             | \$ 1.023       | 1.054                    | 0,02                              | Sherwin-Williams Co.                    | 2.504          | 2.527                    | 0,05                              |
| American Express Co.                    |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 12.04.2029         |                |                          |                                   | 4,550 % fällig am 01.03.2028            |                |                          |                                   |
| 5,645 % fällig am 23.04.2027            | 2.669          | 2.694                    | 0,05                              | Mizuho Financial Group, Inc.         |                |                          |                                   | Skyworks Solutions, Inc.                | 100            | 97                       | 0,00                              |
| American Tower Corp.                    |                |                          |                                   | 4,711 % fällig am 08.07.2031 (b)     | 11.100         | 11.102                   | 0,21                              | 1,800 % fällig am 01.06.2026            |                |                          |                                   |
| 1,450 % fällig am 15.09.2026            | 8.200          | 7.923                    | 0,15                              | 5,382 % fällig am 10.07.2030         | 1.733          | 1.784                    | 0,03                              | Spirit Airlines Pass-Through Trust      |                |                          |                                   |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029            | 1.305          | 1.269                    | 0,02                              | Morgan Stanley                       |                |                          |                                   | 4,100 % fällig am 01.10.2029            | 196            | 180                      | 0,00                              |
| Athene Global Funding                   |                |                          |                                   | 2,664 % fällig am 19.03.2027         | € 3.800        | 4.470                    | 0,08                              | Sysco Corp.                             |                |                          |                                   |
| 5,097 % fällig am 16.07.2026            | 7.700          | 7.712                    | 0,15                              | 4,654 % fällig am 18.10.2030         | \$ 13.304      | 13.332                   | 0,25                              | 5,100 % fällig am 23.09.2030            | 7.766          | 7.960                    | 0,15                              |
| 5,380 % fällig am 07.01.2030            | 5.504          | 5.631                    | 0,11                              | 4,679 % fällig am 17.07.2026         | 400            | 400                      | 0,01                              | T-Mobile USA, Inc.                      | 2.600          | 2.583                    | 0,05                              |
| 5,620 % fällig am 08.05.2026            | 1.461          | 1.474                    | 0,03                              | 5,123 % fällig am 01.02.2029         | 5.155          | 5.246                    | 0,10                              | 4,200 % fällig am 01.10.2029            |                |                          |                                   |
| Bank of America Corp.                   |                |                          |                                   | 6,138 % fällig am 16.02.2026         | 300            | 301                      | 0,01                              | United Airlines Pass-Through Trust      |                |                          |                                   |
| 3,593 % fällig am 21.07.2028            | 9.100          | 8.962                    | 0,17                              | Morgan Stanley Bank N.A.             |                |                          |                                   | 2,700 % fällig am 01.11.2033            | 681            | 610                      | 0,01                              |
| 3,705 % fällig am 24.04.2028            | 100            | 99                       | 0,00                              | 4,952 % fällig am 14.01.2028         | 100            | 101                      | 0,00                              | 3,500 % fällig am 01.09.2031            | 476            | 450                      | 0,01                              |
| 5,162 % fällig am 24.01.2031            | 11.889         | 12.189                   | 0,23                              | 4,968 % fällig am 14.07.2028         | 3.700          | 3.745                    | 0,07                              | 5,875 % fällig am 15.04.2029            | 755            | 771                      | 0,01                              |
| 5,933 % fällig am 15.09.2027            | 3.603          | 3.667                    | 0,07                              | 5,504 % fällig am 26.05.2028         | 2.900          | 2.962                    | 0,06                              | Volkswagen Group of America Finance LLC |                |                          |                                   |
| Bank of Montreal                        |                |                          |                                   | NatWest Group PLC                    |                |                          |                                   | 5,327 % fällig am 12.09.2025            | 2.750          | 2.752                    | 0,05                              |
| 5,274 % fällig am 10.09.2027            | 15.600         | 15.650                   | 0,29                              | 5,516 % fällig am 30.09.2028         | 12.479         | 12.748                   | 0,24                              | 5,800 % fällig am 12.09.2025            | 2.450          | 2.454                    | 0,05                              |
| Bank of New York Mellon Corp.           |                |                          |                                   | Nomura Holdings, Inc.                |                |                          |                                   |                                         |                | 58.540                   | 1,10                              |
| 4,441 % fällig am 09.06.2028            | 11.300         | 11.364                   | 0,21                              | 1,851 % fällig am 16.07.2025         | 2.600          | 2.597                    | 0,05                              | VERSORGUNGSUNTERNEHMEN                  |                |                          |                                   |
| Bank of Nova Scotia                     |                |                          |                                   | 5,099 % fällig am 03.07.2025         | 1.200          | 1.200                    | 0,02                              | DTE Energy Co.                          |                |                          |                                   |
| 5,130 % fällig am 14.02.2031            | 9.446          | 9.622                    | 0,18                              | Norinchukin Bank                     |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 01.07.2027            | 9.497          | 9.611                    | 0,18                              |
| Barclays PLC                            |                |                          |                                   | 5,094 % fällig am 16.10.2029         | 20.500         | 20.806                   | 0,39                              | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.   |                |                          |                                   |
| 4,837 % fällig am 10.09.2028            | 12.723         | 12.824                   | 0,24                              | Nykredit Realcredit A/S              |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 15.03.2030            | 8.080          | 8.272                    | 0,16                              |
| 7,385 % fällig am 02.11.2028            | 7.100          | 7.538                    | 0,14                              | 3,625 % fällig am 24.07.2030         | € 700          | 837                      | 0,02                              | ONEOK, Inc.                             |                |                          |                                   |
| BNP Paribas S.A.                        |                |                          |                                   | RGA Global Funding                   |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 24.09.2027            | 15.500         | 15.482                   | 0,29                              |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027            | 12.104         | 11.843                   | 0,22                              | 5,500 % fällig am 11.01.2031         | \$ 800         | 826                      | 0,02                              | Pacific Gas & Electric Co.              |                |                          |                                   |
| BPCE S.A.                               |                |                          |                                   | Royal Bank of Canada                 |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 15.06.2028            | 500            | 475                      | 0,01                              |
| 3,500 % fällig am 23.10.2027            | 3.943          | 3.860                    | 0,07                              | 5,153 % fällig am 04.02.2031         | 11.991         | 12.242                   | 0,23                              | Pinnacle West Capital Corp.             |                |                          |                                   |
| 5,203 % fällig am 18.01.2027            | 250            | 254                      | 0,01                              | Sirius Real Estate Ltd.              |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 10.06.2026            | 1.300          | 1.302                    | 0,02                              |
| Citibank N.A.                           |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 22.06.2026 (g)     | € 1.100        | 1.268                    | 0,02                              | Southern California Edison Co.          |                |                          |                                   |
| 4,576 % fällig am 29.05.2027            | 39.500         | 39.731                   | 0,75                              | 1,750 % fällig am 24.11.2028         | 400            | 445                      | 0,01                              | 1,200 % fällig am 01.02.2026            | 300            | 292                      | 0,01                              |
| 5,488 % fällig am 04.12.2026            | 2.600          | 2.642                    | 0,05                              | Sixth Street Lending Partners        |                |                          |                                   | 3,650 % fällig am 01.03.2028            | 400            | 389                      | 0,01                              |
| Citigroup, Inc.                         |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 15.07.2030         | \$ 1.700       | 1.732                    | 0,03                              | 4,400 % fällig am 06.09.2026            | 12.800         | 12.783                   | 0,24                              |
| 3,520 % fällig am 27.10.2028            | 5.719          | 5.602                    | 0,11                              | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.      |                |                          |                                   | 5,150 % fällig am 01.06.2029            | 2.900          | 2.931                    | 0,06                              |
| Crown Castle, Inc.                      |                |                          |                                   | 4,450 % fällig am 10.09.2027         | 14.700         | 14.763                   | 0,28                              | 5,650 % fällig am 01.10.2028            | 200            | 205                      | 0,00                              |
| 1,350 % fällig am 15.07.2025            | 800            | 799                      | 0,02                              | Toronto-Dominion Bank                |                |                          |                                   | 5,850 % fällig am 01.11.2027            | 200            | 205                      | 0,00                              |
| 4,900 % fällig am 01.09.2029            | 13.200         | 13.325                   | 0,25                              | 4,994 % fällig am 05.04.2029         | 4.920          | 5.023                    | 0,09                              |                                         |                | 51.947                   | 0,98                              |
| Deutsche Bank AG                        |                |                          |                                   | UBS Group AG                         |                |                          |                                   | Summe Unternehmensanleihen und          |                |                          |                                   |
| 6,119 % fällig am 14.07.2026            | 200            | 200                      | 0,00                              | 1,305 % fällig am 02.02.2027         | 4.350          | 4.268                    | 0,08                              | Wechsel                                 |                | 600.868                  | 11,29                             |
| Equitable Financial Life Global Funding |                |                          |                                   | 4,751 % fällig am 12.05.2028         | 2.084          | 2.097                    | 0,04                              | US-REGIERUNGSBEHÖRDEN                   |                |                          |                                   |
| 4,600 % fällig am 01.04.2027            | 17.200         | 17.274                   | 0,32                              | Wells Fargo & Co.                    |                |                          |                                   | Fannie Mae                              |                |                          |                                   |
| Extra Space Storage LP                  |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 26.10.2026         | € 9.400        | 10.900                   | 0,20                              | 1,630 % fällig am 01.05.2027            | 19.900         | 19.029                   | 0,36                              |
| 5,500 % fällig am 01.07.2030            | 2.100          | 2.179                    | 0,04                              | 2,393 % fällig am 02.06.2028         | \$ 8.710       | 8.395                    | 0,16                              | 1,960 % fällig am 25.03.2037 (a)        | 174            | 16                       | 0,00                              |
| F&G Global Funding                      |                |                          |                                   | 3,584 % fällig am 22.05.2028         | 100            | 99                       | 0,00                              | 2,080 % fällig am 01.10.2026            | 2.904          | 2.825                    | 0,05                              |
| 2,000 % fällig am 20.09.2028            | 650            | 597                      | 0,01                              | 5,244 % fällig am 24.01.2031         | 2.000          | 2.052                    | 0,04                              | 2,110 % fällig am 01.02.2027            | 13.138         | 12.728                   | 0,24                              |
| Ford Motor Credit Co. LLC               |                |                          |                                   | INDUSTRIEWERTE                       |                |                          |                                   | 2,170 % fällig am 01.09.2026            | 13.029         | 12.710                   | 0,24                              |
| 2,700 % fällig am 10.08.2026            | 200            | 195                      | 0,00                              | Air Canada Pass-Through Trust        |                |                          |                                   | 2,320 % fällig am 01.01.2026            | 2.288          | 2.257                    | 0,04                              |
| 2,900 % fällig am 16.02.2028            | 200            | 188                      | 0,00                              | 3,600 % fällig am 15.09.2028         | 110            | 108                      | 0,00                              | 2,546 % fällig am 25.12.2026            | 9.278          | 9.049                    | 0,17                              |
| 4,125 % fällig am 17.08.2027            | 1.100          | 1.076                    | 0,02                              | Alaska Airlines Pass-Through Trust   |                |                          |                                   | 2,636 % fällig am 25.12.2026            | 4.428          | 4.319                    | 0,08                              |
| 4,389 % fällig am 08.01.2026            | 400            | 398                      | 0,01                              | 4,800 % fällig am 15.02.2029         | 259            | 259                      | 0,01                              | 2,810 % fällig am 01.11.2025            | 17.406         | 17.268                   | 0,32                              |
| 4,542 % fällig am 01.08.2026            | 800            | 795                      | 0,02                              | American Airlines Pass-Through Trust |                |                          |                                   | 2,907 % fällig am 25.02.2027            | 7.940          | 7.781                    | 0,15                              |
| 5,303 % fällig am 06.09.2029            | 600            | 589                      | 0,01                              | 3,000 % fällig am 15.04.2030         | 120            | 113                      | 0,00                              | 2,939 % fällig am 25.01.2026            | 6.669          | 6.612                    | 0,12                              |
| 5,800 % fällig am 05.03.2027            | 2.600          | 2.621                    | 0,05                              | 3,350 % fällig am 15.04.2031         | 124            | 118                      | 0,00                              | 2,961 % fällig am 25.02.2027            | 9.257          | 9.082                    | 0,17                              |
| 6,950 % fällig am 10.06.2026            | 200            | 203                      | 0,00                              | 3,600 % fällig am 22.03.2029         | 115            | 112                      | 0,00                              | 3,000 % fällig am 25.10.2040            | 492            | 473                      | 0,01                              |
| 7,350 % fällig am 04.11.2027            | 200            | 208                      | 0,00                              | 3,650 % fällig am 15.08.2030         | 123            | 119                      | 0,00                              | 3,040 % fällig am 01.02.2027            | 2.513          | 2.467                    | 0,05                              |
| Goldman Sachs Group, Inc.               |                |                          |                                   | British Airways Pass-Through Trust   |                |                          |                                   | 3,046 % fällig am 01.10.2025            | 6.000          | 5.980                    | 0,11                              |
| 3,615 % fällig am 15.03.2028            | 2.408          | 2.375                    | 0,04                              | 4,250 % fällig am 15.05.2034         | 311            | 299                      | 0,01                              | 3,061 % fällig am 25.05.2027            | 10.516         | 10.317                   | 0,19                              |
| 4,692 % fällig am 23.10.2030            | 24.665         | 24.745                   | 0,47                              | DAE Funding LLC                      |                |                          |                                   | 3,100 % fällig am 01.01.2026            | 20.000         | 19.810                   | 0,37                              |
| 5,049 % fällig am 23.07.2030            | 2.800          | 2.847                    | 0,05                              | 3,375 % fällig am 20.03.2028         | 2.800          | 2.697                    | 0,05                              | 3,150 % fällig am 01.03.2026            | 20.000         | 19.792                   | 0,37                              |
| 5,427 % fällig am 10.08.2026            | 1.300          | 1.301                    | 0,02                              | Expand Energy Corp.                  |                |                          |                                   | 3,162 % fällig am 25.06.2027            | 4.988          | 4.888                    | 0,09                              |
| 5,798 % fällig am 10.08.2026            | 6.200          | 6.209                    | 0,12                              | 6,750 % fällig am 15.04.2029         | 8.850          | 8.962                    | 0,17                              | 3,210 % fällig am 01.07.2026            | 14.309         | 14.130                   | 0,27                              |
| Goodman Australia Finance Pty. Ltd.     |                |                          |                                   | GE HealthCare Technologies, Inc.     |                |                          |                                   | 3,360 % fällig am 01.08.2025            | 9.118          | 9.080                    | 0,17                              |
| 4,250 % fällig am 03.05.2030            | € 300          | 368                      | 0,01                              | 4,800 % fällig am 14.08.2029         | 6.311          | 6.405                    | 0,12                              | 3,470 % fällig am 01.11.2034            | 2.353          | 2.255                    | 0,04                              |
| HPS Corporate Lending Fund              |                |                          |                                   | Hyundai Capital America              |                |                          |                                   | 3,590 % fällig am 01.12.2025            | 8.730          | 8.674                    | 0,16                              |
| 5,450 % fällig am 14.01.2028            | \$ 8.700       | 8.727                    | 0,16                              | 5,300 % fällig am 19.03.2027         | 1.100          | 1.112                    | 0,02                              | 3,600 % fällig am 25.11.2048            | 908            | 874                      | 0,02                              |
| Jackson National Life Global Funding    |                |                          |                                   | 5,450 % fällig am 24.06.2026         | 8.300          | 8.369                    | 0,16                              | 4,250 % fällig am 01.04.2030            | 14.267         | 14.279                   | 0,27                              |
| 5,350 % fällig am 13.01.2030            | 7.649          | 7.873                    | 0,15                              |                                      |                |                          |                                   | 4,300 % fällig am 01.12.2029            | 16.637         | 16.760                   | 0,32                              |
| 5,600 % fällig am 10.04.2026            | 4.900          | 4.942                    | 0,09                              |                                      |                |                          |                                   | 4,532 % fällig am 01.09.2029            | 28.500         | 28.935                   | 0,54                              |
|                                         |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   | 4,600 % fällig am 01.04.2030            | 24.700         | 25.084                   | 0,47                              |
|                                         |                |                          |                                   |                                      |                |                          |                                   | 4,610 % fällig am 01.07.2029            | 19.598         | 19.921                   | 0,37                              |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 4,700 % fällig am 01.08.2031                 | \$ 5.000       | \$ 5.089                 | 0,10                              | 4,946 % fällig am 20.06.2069 -<br>20.11.2069 | \$ 4.927       | \$ 4.940                 | 0,09                              | 4,905 % fällig am 25.09.2035                                | \$ 5           | \$ 3                     | 0,00                              |
| 4,730 % fällig am 01.05.2029                 | 5.090          | 5.186                    | 0,10                              | 4,952 % fällig am 20.02.2074 -<br>20.05.2074 | 5.040          | 5.033                    | 0,09                              | 5,174 % fällig am 25.01.2036                                | 26             | 24                       | 0,00                              |
| 4,740 % fällig am 01.04.2030                 | 10.440         | 10.532                   | 0,20                              | 5,002 % fällig am 20.02.2074                 | 762            | 759                      | 0,01                              | 5,197 % fällig am 25.07.2035                                | 661            | 417                      | 0,01                              |
| 4,760 % fällig am 01.06.2029                 | 41.675         | 42.587                   | 0,80                              | 5,052 % fällig am 20.10.2072                 | 564            | 565                      | 0,01                              | 6,009 % fällig am 25.01.2035                                | 1.481          | 1.448                    | 0,03                              |
| 4,804 % fällig am 01.08.2029                 | 36.429         | 37.297                   | 0,70                              | 5,092 % fällig am 20.04.2074                 | 1.930          | 1.929                    | 0,04                              | <b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>                  |                |                          |                                   |
| 4,864 % fällig am 25.03.2049 -<br>25.09.2049 | 2.672          | 2.655                    | 0,05                              | 5,096 % fällig am 20.02.2070                 | 1.762          | 1.770                    | 0,03                              | 4,774 % fällig am 25.06.2047                                | 282            | 251                      | 0,00                              |
| 4,914 % fällig am 25.09.2046 -<br>25.11.2059 | 2.722          | 2.697                    | 0,05                              | 5,106 % fällig am 20.12.2065                 | 229            | 229                      | 0,00                              | 4,794 % fällig am 25.10.2036                                | 1.169          | 1.041                    | 0,02                              |
| 5,040 % fällig am<br>01.07.2030 (b)          | 942            | 968                      | 0,02                              | 5,146 % fällig am 20.10.2065                 | 1              | 1                        | 0,00                              | <b>Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust</b>         |                |                          |                                   |
| 5,090 % fällig am 25.03.2038                 | 239            | 239                      | 0,00                              | 5,152 % fällig am 20.05.2074                 | 1.962          | 1.966                    | 0,04                              | 4,120 % fällig am 26.12.2046                                | 375            | 298                      | 0,01                              |
| 5,100 % fällig am 01.04.2030                 | 8.600          | 8.861                    | 0,17                              | 5,196 % fällig am 20.11.2065 -<br>20.02.2067 | 5.811          | 5.823                    | 0,11                              | 5,062 % fällig am 26.01.2036                                | 1.283          | 914                      | 0,02                              |
| 5,130 % fällig am 25.12.2047                 | 2.156          | 2.157                    | 0,04                              | 5,202 % fällig am 20.07.2074                 | 600            | 602                      | 0,01                              | <b>Benchmark Mortgage Trust</b>                             |                |                          |                                   |
| 5,150 % fällig am 25.01.2051                 | 5.930          | 5.934                    | 0,11                              | 5,216 % fällig am 20.02.2066                 | 1              | 1                        | 0,00                              | 3,402 % fällig am 15.01.2051                                | 1.417          | 1.376                    | 0,03                              |
| 5,205 % fällig am 25.09.2054                 | 8.141          | 8.114                    | 0,15                              | 5,227 % fällig am 20.06.2067                 | 451            | 457                      | 0,01                              | 4,059 % fällig am 15.07.2051                                | 1.279          | 1.270                    | 0,02                              |
| 5,250 % fällig am 25.12.2050                 | 2.624          | 2.629                    | 0,05                              | 5,246 % fällig am 20.01.2066                 | 97             | 97                       | 0,00                              | <b>Bletchley Park Funding PLC</b>                           |                |                          |                                   |
| 5,255 % fällig am 25.11.2053 -<br>25.03.2055 | 9.970          | 9.984                    | 0,19                              | 5,402 % fällig am 20.05.2073                 | 334            | 337                      | 0,01                              | 5,094 % fällig am 27.07.2070                                | £ 15.448       | 21.265                   | 0,40                              |
| 5,275 % fällig am 25.08.2054                 | 3.609          | 3.617                    | 0,07                              | 5,596 % fällig am 20.03.2066                 | 195            | 197                      | 0,00                              | <b>Braccan Mortgage Funding PLC</b>                         |                |                          |                                   |
| 5,355 % fällig am 25.01.2055                 | 6.936          | 6.922                    | 0,13                              | 7,000 % fällig am 20.06.2055                 | 5.400          | 5.484                    | 0,10                              | 5,077 % fällig am 15.02.2067                                | 19.759         | 27.152                   | 0,51                              |
| 5,402 % fällig am 25.07.2055                 | 2.200          | 2.201                    | 0,04                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>      |                |                          |                                   | <b>Brants Bridge PLC</b>                                    |                |                          |                                   |
| 5,505 % fällig am 25.12.2053 -<br>25.02.2055 | 12.447         | 12.479                   | 0,23                              | 3,000 % fällig am 01.11.2026 -<br>01.02.2027 | 3.485          | 3.444                    | 0,07                              | 5,139 % fällig am 14.06.2066                                | 336            | 461                      | 0,01                              |
| 5,555 % fällig am 25.02.2055                 | 7.667          | 7.701                    | 0,15                              | 4,000 % fällig am 01.04.2043 -<br>01.08.2051 | 1.317          | 1.270                    | 0,02                              | <b>BX Trust</b>                                             |                |                          |                                   |
| 5,697 % fällig am 01.07.2044                 | 1              | 1                        | 0,00                              | 5,000 % fällig am 01.04.2053                 | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,629 % fällig am 15.05.2035                                | \$ 7.010       | 6.994                    | 0,13                              |
| 5,810 % fällig am 25.12.2031                 | 4.800          | 4.981                    | 0,09                              | 5,500 % fällig am 01.08.2053                 | 3.450          | 3.456                    | 0,07                              | <b>Canada Square Funding PLC</b>                            |                |                          |                                   |
| 6,213 % fällig am 01.11.2035                 | 2              | 2                        | 0,00                              | 6,000 % fällig am 01.08.2054                 | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,019 % fällig am 17.06.2058                                | £ 1.878        | 2.574                    | 0,05                              |
| 6,679 % fällig am 01.01.2036                 | 176            | 182                      | 0,00                              | 6,500 % fällig am 01.10.2036                 | 22             | 23                       | 0,00                              | <b>Canterbury Finance PLC</b>                               |                |                          |                                   |
| 7,018 % fällig am 01.05.2038                 | 119            | 123                      | 0,00                              | <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b> |                |                          |                                   | 5,073 % fällig am 16.05.2058                                | 916            | 1.257                    | 0,02                              |
| 7,190 % fällig am 01.09.2035                 | 4              | 4                        | 0,00                              | 4,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 35.180         | 32.710                   | 0,61                              | <b>CD Mortgage Trust</b>                                    |                |                          |                                   |
| 7,430 % fällig am 01.07.2035                 | 3              | 3                        | 0,00                              | 5,000 % fällig am 01.08.2055                 | 43.730         | 42.834                   | 0,81                              | 2,622 % fällig am 10.08.2049                                | \$ 2.740       | 2.716                    | 0,05                              |
| <b>Freddie Mac</b>                           |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.07.2055                 | 23.078         | 23.076                   | 0,43                              | 3,190 % fällig am 13.11.2050                                | 10.000         | 9.758                    | 0,18                              |
| 2,862 % fällig am 25.07.2054                 | 15.600         | 14.637                   | 0,28                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                 | 386.565        | 392.480                  | 7,37                              | <b>CFCRE Commercial Mortgage Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.11.2032                 | 7.518          | 7.312                    | 0,14                              | 6,500 % fällig am 01.08.2055                 | 401.100        | 413.578                  | 7,78                              | 3,091 % fällig am 10.05.2058                                | 196            | 196                      | 0,00                              |
| 3,250 % fällig am 25.10.2033                 | 2.106          | 2.099                    | 0,04                              |                                              |                |                          |                                   | <b>Citigroup Commercial Mortgage Trust</b>                  |                |                          |                                   |
| 3,400 % fällig am 15.08.2040                 | 973            | 944                      | 0,02                              |                                              |                |                          |                                   | 2,779 % fällig am 10.07.2049                                | 2.102          | 2.081                    | 0,04                              |
| 4,000 % fällig am 01.01.2048                 | 1.273          | 1.208                    | 0,02                              |                                              |                |                          |                                   | 2,832 % fällig am 10.08.2049                                | 4.326          | 4.240                    | 0,08                              |
| 4,764 % fällig am 25.09.2033                 | 3.000          | 3.021                    | 0,06                              |                                              |                |                          |                                   | 3,003 % fällig am 10.05.2049                                | 86             | 86                       | 0,00                              |
| 4,862 % fällig am 25.08.2027                 | 6.500          | 6.500                    | 0,12                              |                                              |                |                          |                                   | <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                  |                |                          |                                   |
| 4,904 % fällig am 15.07.2040                 | 303            | 300                      | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   | 5,988 % fällig am 25.08.2035                                | 36             | 32                       | 0,00                              |
| 4,964 % fällig am 15.03.2042                 | 114            | 115                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 6,490 % fällig am 25.05.2035                                | 1              | 1                        | 0,00                              |
| 5,150 % fällig am 15.03.2050                 | 2.405          | 2.375                    | 0,05                              |                                              |                |                          |                                   | 6,560 % fällig am 25.10.2035                                | 23             | 22                       | 0,00                              |
| 5,205 % fällig am 25.11.2054                 | 2.615          | 2.604                    | 0,05                              |                                              |                |                          |                                   | <b>Commercial Mortgage Trust</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,245 % fällig am 25.11.2054                 | 24.350         | 24.300                   | 0,46                              |                                              |                |                          |                                   | 3,349 % fällig am 10.10.2048                                | 317            | 317                      | 0,01                              |
| 5,250 % fällig am 15.04.2049 -<br>15.12.2050 | 8.997          | 9.006                    | 0,17                              |                                              |                |                          |                                   | 3,495 % fällig am 10.02.2049                                | 509            | 507                      | 0,01                              |
| 5,255 % fällig am 25.10.2054 -<br>25.03.2055 | 30.924         | 30.845                   | 0,58                              |                                              |                |                          |                                   | 3,521 % fällig am 10.10.2048                                | 1.006          | 1.003                    | 0,02                              |
| 5,285 % fällig am 25.02.2055                 | 1.253          | 1.257                    | 0,02                              |                                              |                |                          |                                   | <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 5,305 % fällig am 25.09.2054 -<br>25.02.2055 | 5.806          | 5.814                    | 0,11                              |                                              |                |                          |                                   | 4,627 % fällig am 20.12.2046                                | 47             | 41                       | 0,00                              |
| 5,350 % fällig am 15.08.2048                 | 2.860          | 2.880                    | 0,05                              |                                              |                |                          |                                   | 4,634 % fällig am 25.04.2047                                | 920            | 907                      | 0,02                              |
| 5,404 % fällig am 25.07.2055                 | 2.779          | 2.779                    | 0,05                              |                                              |                |                          |                                   | 4,644 % fällig am 25.04.2047                                | 1.035          | 906                      | 0,02                              |
| 5,405 % fällig am 25.11.2054                 | 18.061         | 17.969                   | 0,34                              |                                              |                |                          |                                   | 4,734 % fällig am 25.06.2035                                | 752            | 482                      | 0,01                              |
| 5,455 % fällig am 25.12.2054 -<br>25.01.2055 | 40.353         | 40.373                   | 0,76                              |                                              |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.02.2047                                | 57             | 56                       | 0,00                              |
| 5,505 % fällig am 25.02.2055                 | 12.589         | 12.622                   | 0,24                              |                                              |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.05.2047                                | 221            | 203                      | 0,00                              |
| 5,555 % fällig am 25.05.2054                 | 12.083         | 12.138                   | 0,23                              |                                              |                |                          |                                   | 4,854 % fällig am 25.07.2046                                | 3.167          | 2.863                    | 0,05                              |
| 5,599 % fällig am 25.02.2045                 | 12             | 12                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 5,399 % fällig am 25.12.2035                                | 526            | 452                      | 0,01                              |
| 6,700 % fällig am 01.05.2031                 | 0              | 0                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 25.04.2037                                | 500            | 414                      | 0,01                              |
| 6,826 % fällig am 01.06.2035                 | 6              | 6                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>    |                |                          |                                   |
| 6,901 % fällig am 01.09.2037                 | 218            | 226                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 4,894 % fällig am 25.05.2035                                | 2.375          | 2.083                    | 0,04                              |
| 7,355 % fällig am 01.09.2035                 | 2              | 2                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 25.02.2035                                | 2.657          | 2.476                    | 0,05                              |
| <b>Ginnie Mae</b>                            |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | <b>Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.</b> |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 20.08.2030                 | 38             | 36                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 0,098 % fällig am 25.06.2032                                | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 2,250 % fällig am 20.02.2027                 | 175            | 173                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 5,063 % fällig am 25.03.2032                                | 1              | 1                        | 0,00                              |
| 3,000 % fällig am 15.09.2026 -<br>20.05.2047 | 4.629          | 4.556                    | 0,09                              |                                              |                |                          |                                   | <b>Credit Suisse Mortgage Capital Certificates</b>          |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 20.12.2068 -<br>20.01.2069 | 4.730          | 4.552                    | 0,09                              |                                              |                |                          |                                   | 3,850 % fällig am 25.09.2057                                | 5.834          | 5.744                    | 0,11                              |
| 4,120 % fällig am 20.05.2067                 | 16             | 16                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 3,851 % fällig am 27.12.2037                                | 3.878          | 3.392                    | 0,06                              |
| 4,602 % fällig am 20.01.2068                 | 1.932          | 1.924                    | 0,04                              |                                              |                |                          |                                   | 5,194 % fällig am 15.07.2032                                | 207            | 206                      | 0,00                              |
| 4,625 % fällig am 20.07.2027                 | 1              | 1                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | <b>CSAIL Commercial Mortgage Trust</b>                      |                |                          |                                   |
| 4,750 % fällig am 20.10.2029                 | 4              | 4                        | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 3,757 % fällig am 15.11.2048                                | 5.701          | 5.672                    | 0,11                              |
| 4,786 % fällig am 20.12.2062                 | 23             | 23                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 4,033 % fällig am 15.04.2051                                | 12.073         | 11.872                   | 0,22                              |
| 4,846 % fällig am 20.12.2060                 | 118            | 119                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 4,359 % fällig am 15.11.2051                                | 3.180          | 3.169                    | 0,06                              |
| 4,875 % fällig am 20.04.2026 -<br>20.04.2041 | 108            | 110                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | <b>Curzon Mortgages PLC</b>                                 |                |                          |                                   |
| 4,886 % fällig am 20.06.2065                 | 148            | 148                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 5,482 % fällig am 28.07.2049                                | £ 15.334       | 21.077                   | 0,40                              |
| 4,896 % fällig am 20.06.2069                 | 298            | 299                      | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   | <b>DBGS Mortgage Trust</b>                                  |                |                          |                                   |
| 4,916 % fällig am 20.08.2065                 | 169            | 169                      | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | 4,302 % fällig am 15.10.2051                                | \$ 3.532       | 3.526                    | 0,07                              |
| 4,926 % fällig am 20.03.2061                 | 81             | 81                       | 0,00                              |                                              |                |                          |                                   | <b>DBJPM Mortgage Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| 4,933 % fällig am 20.07.2064                 | 259            | 260                      | 0,01                              |                                              |                |                          |                                   | 3,038 % fällig am 10.05.2049                                | 331            | 330                      | 0,01                              |
|                                              |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | 3,276 % fällig am 10.05.2049                                | 4.819          | 4.750                    | 0,09                              |
|                                              |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | <b>Dilosk RMBS DAC</b>                                      |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | 2,786 % fällig am 24.09.2060                                | € 17.607       | 20.664                   | 0,39                              |
|                                              |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | 2,838 % fällig am 25.01.2063                                | 896            | 1.051                    | 0,02                              |
|                                              |                |                          |                                   |                                              |                |                          |                                   | 3,049 % fällig am 20.10.2062                                | 964            | 1.137                    | 0,02                              |



| BESCHREIBUNG                                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Domi BV</b>                                                      |                |                          |                                   | <b>Polaris PLC</b>                                         |                |                          |                                   | <b>Auto ABS Italian Stella Loans SRL</b>        |                |                          |                                   |
| 2,655 % fällig am 15.06.2056                                        | € 1.864        | \$ 2.185                 | 0,04                              | 5,014 % fällig am 23.12.2058                               | £ 620          | \$ 850                   | 0,02                              | 2,659 % fällig am 29.12.2036                    | € 868          | \$ 1.021                 | 0,02                              |
| <b>Dutch Property Finance BV</b>                                    |                |                          |                                   | 5,044 % fällig am 26.02.2068                               | 5.463          | 7.497                    | 0,14                              | 2,773 % fällig am 28.12.2040                    | 4.900          | 5.770                    | 0,11                              |
| 2,811 % fällig am 28.07.2058                                        | 2.019          | 2.371                    | 0,04                              | <b>Prime Mortgage Trust</b>                                |                |                          |                                   | <b>Auto ABS Spanish Loans</b>                   |                |                          |                                   |
| 2,861 % fällig am 28.04.2059                                        | 7.640          | 8.971                    | 0,17                              | 4,834 % fällig am 25.02.2034                               | \$ 11          | 10                       | 0,00                              | 2,779 % fällig am 28.09.2038                    | 18.944         | 22.305                   | 0,42                              |
| <b>Edenbrook Mortgage Funding PLC</b>                               |                |                          |                                   | <b>Residential Accredit Loans, Inc. Trust</b>              |                |                          |                                   | <b>Auto1 Car Funding SARL</b>                   |                |                          |                                   |
| 5,109 % fällig am 22.03.2057                                        | £ 974          | 1.338                    | 0,02                              | 6,500 % fällig am 25.08.2036                               | 695            | 570                      | 0,01                              | 2,592 % fällig am 15.12.2033                    | 11.900         | 13.994                   | 0,26                              |
| <b>Elstree Funding</b>                                              |                |                          |                                   | <b>Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust</b> |                |                          |                                   | <b>AutoFlorence SRL</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,943 % fällig am 21.01.2065                                        | 979            | 1.342                    | 0,02                              | 5,871 % fällig am 25.09.2035                               | 409            | 262                      | 0,00                              | 2,821 % fällig am 25.12.2046                    | 935            | 1.103                    | 0,02                              |
| <b>GS Mortgage Securities Corp. Trust</b>                           |                |                          |                                   | <b>RMAC PLC</b>                                            |                |                          |                                   | <b>Autonoría Spain</b>                          |                |                          |                                   |
| 2,777 % fällig am 10.10.2049                                        | \$ 126         | 125                      | 0,00                              | 5,437 % fällig am 15.02.2047                               | £ 1.336        | 1.837                    | 0,03                              | 2,589 % fällig am 30.09.2041                    | 1.421          | 1.672                    | 0,03                              |
| 3,178 % fällig am 10.11.2049                                        | 1.070          | 1.054                    | 0,02                              | <b>Sequoia Mortgage Trust</b>                              |                |                          |                                   | <b>Bavarian Sky S.A.</b>                        |                |                          |                                   |
| 3,931 % fällig am 10.09.2047                                        | 93             | 93                       | 0,00                              | 5,032 % fällig am 20.12.2034                               | \$ 84          | 76                       | 0,00                              | 0,000 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| <b>GSR Mortgage Loan Trust</b>                                      |                |                          |                                   | <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                       |                |                          |                                   | 20.08.2032 (b)                                  | 3.600          | 4.227                    | 0,08                              |
| 4,784 % fällig am 25.01.2034                                        | 0              | 0                        | 0,00                              | 5,139 % fällig am 28.06.2050                               | £ 4.694        | 6.440                    | 0,12                              | 2,307 % fällig am 20.03.2030                    | 259            | 304                      | 0,01                              |
| <b>HarborView Mortgage Loan Trust</b>                               |                |                          |                                   | 5,214 % fällig am 25.06.2049                               | 3.082          | 4.229                    | 0,08                              | 2,347 % fällig am 20.11.2031                    | 657            | 771                      | 0,01                              |
| 4,872 % fällig am 19.05.2035                                        | 17             | 16                       | 0,00                              | 5,389 % fällig am 20.06.2060                               | 742            | 1.019                    | 0,02                              | 2,367 % fällig am 21.02.2033                    | 2.100          | 2.465                    | 0,05                              |
| 5,514 % fällig am 19.08.2036                                        | 8              | 8                        | 0,00                              | <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>      |                |                          |                                   | <b>Bavarian Sky UK PLC</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Hops Hill PLC</b>                                                |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.10.2035                               | \$ 1.663       | 1.584                    | 0,03                              | 4,774 % fällig am 20.06.2032                    | £ 6.300        | 8.640                    | 0,16                              |
| 5,103 % fällig am 21.04.2056                                        | £ 877          | 1.207                    | 0,02                              | 5,799 % fällig am 25.01.2035                               | 16             | 15                       | 0,00                              | 4,844 % fällig am 20.04.2031                    | 989            | 1.357                    | 0,03                              |
| 5,223 % fällig am 21.12.2055                                        | 3.012          | 4.151                    | 0,08                              | 6,525 % fällig am 25.02.2034                               | 6              | 6                        | 0,00                              | <b>BBVA Consumer Auto</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Impac CMB Trust</b>                                              |                |                          |                                   | <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>         |                |                          |                                   | 2,723 % fällig am 19.03.2038                    | € 17.211       | 20.278                   | 0,38                              |
| 4,974 % fällig am 25.05.2035                                        | \$ 2.369       | 2.276                    | 0,04                              | 4,794 % fällig am 25.09.2047                               | 524            | 489                      | 0,01                              | <b>Bumper FR</b>                                |                |                          |                                   |
| <b>Jeronimo Funding DAC</b>                                         |                |                          |                                   | 4,932 % fällig am 19.07.2035                               | 8              | 7                        | 0,00                              | 2,789 % fällig am 27.04.2032                    | 2.149          | 2.524                    | 0,05                              |
| 3,408 % fällig am 25.10.2064                                        | € 1.386        | 1.630                    | 0,03                              | 4,994 % fällig am 25.02.2036                               | 6              | 5                        | 0,00                              | <b>Bumper NL BV</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust</b>                   |                |                          |                                   | 5,799 % fällig am 25.12.2035                               | 41             | 34                       | 0,00                              | 2,539 % fällig am 21.03.2036                    | 20.000         | 23.503                   | 0,44                              |
| 2,954 % fällig am 15.06.2049                                        | \$ 182         | 181                      | 0,00                              | <b>Thornburg Mortgage Securities Trust</b>                 |                |                          |                                   | 2,569 % fällig am 22.03.2035                    | 1.598          | 1.879                    | 0,04                              |
| 3,311 % fällig am 17.03.2049                                        | 1.916          | 1.903                    | 0,04                              | 5,074 % fällig am 25.09.2043                               | 216            | 214                      | 0,00                              | <b>Cars Alliance Auto Loans Germany</b>         |                |                          |                                   |
| <b>JPMorgan Alternative Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   | <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                     |                |                          |                                   | 2,431 % fällig am 18.01.2036                    | 934            | 1.097                    | 0,02                              |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036                                        | 1.324          | 679                      | 0,01                              | 5,074 % fällig am 20.04.2051                               | £ 22.432       | 30.759                   | 0,58                              | <b>Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC</b> |                |                          |                                   |
| <b>JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust</b>          |                |                          |                                   | 5,223 % fällig am 20.07.2053                               | 2.395          | 3.289                    | 0,06                              | 2,742 % fällig am 15.12.2032                    | 610            | 717                      | 0,01                              |
| 3,650 % fällig am 15.01.2049                                        | 3.106          | 3.091                    | 0,06                              | <b>Towd Point Mortgage Trust</b>                           |                |                          |                                   | <b>Compartment Driver UK Eight</b>              |                |                          |                                   |
| 5,709 % fällig am 15.02.2035                                        | 5.842          | 5.653                    | 0,11                              | 3,750 % fällig am 25.10.2056                               | \$ 8.100       | 7.949                    | 0,15                              | 4,824 % fällig am 25.09.2031                    | £ 3.154        | 4.327                    | 0,08                              |
| <b>JPMorgan Mortgage Trust</b>                                      |                |                          |                                   | <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                            |                |                          |                                   | <b>Compartment Driver UK Nine</b>               |                |                          |                                   |
| 4,861 % fällig am 25.04.2036                                        | 488            | 432                      | 0,01                              | 5,029 % fällig am 20.12.2066                               | £ 9.910        | 13.598                   | 0,26                              | 4,824 % fällig am 26.04.2032                    | 18.344         | 25.165                   | 0,47                              |
| <b>Jubilee Place BV</b>                                             |                |                          |                                   | 5,117 % fällig am 20.05.2066                               | 924            | 1.269                    | 0,02                              | <b>Compartment Private Driver UK</b>            |                |                          |                                   |
| 2,724 % fällig am 18.09.2062                                        | € 1.344        | 1.578                    | 0,03                              | 5,398 % fällig am 20.01.2066                               | 866            | 1.189                    | 0,02                              | 4,874 % fällig am 25.04.2031                    | 5.891          | 8.088                    | 0,15                              |
| 2,804 % fällig am 17.09.2060                                        | 2.228          | 2.622                    | 0,05                              | <b>Twin Bridges PLC</b>                                    |                |                          |                                   | <b>Compartment VCL</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Kinbane DAC</b>                                                  |                |                          |                                   | 5,009 % fällig am 12.12.2055                               | 6.287          | 8.622                    | 0,16                              | 2,319 % fällig am 21.04.2029                    | € 219          | 257                      | 0,00                              |
| 3,188 % fällig am 24.01.2063                                        | 912            | 1.072                    | 0,02                              | 5,188 % fällig am 14.06.2055                               | 352            | 484                      | 0,01                              | 2,319 % fällig am 21.08.2029                    | 885            | 1.040                    | 0,02                              |
| <b>Lanebrook Mortgage Transaction PLC</b>                           |                |                          |                                   | 5,417 % fällig am 15.05.2056                               | 422            | 582                      | 0,01                              | 2,329 % fällig am 21.01.2029                    | 500            | 587                      | 0,01                              |
| 5,039 % fällig am 15.03.2061                                        | £ 969          | 1.330                    | 0,02                              | <b>UBS Commercial Mortgage Trust</b>                       |                |                          |                                   | 2,431 % fällig am 21.04.2031                    | 8.700          | 10.219                   | 0,19                              |
| <b>Lehman XS Trust</b>                                              |                |                          |                                   | 3,225 % fällig am 15.08.2050                               | \$ 1.350       | 1.320                    | 0,02                              | <b>E-Carat DE</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.11.2035                                        | \$ 2.464       | 2.485                    | 0,05                              | 3,264 % fällig am 15.08.2050                               | 1.520          | 1.503                    | 0,03                              | 2,321 % fällig am 25.11.2035                    | 1.800          | 2.112                    | 0,04                              |
| 4,794 % fällig am 25.07.2037                                        | 8.059          | 7.377                    | 0,14                              | 3,903 % fällig am 15.02.2051                               | 3.067          | 3.050                    | 0,06                              | <b>FACT Master S.A.</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.12.2035                                        | 3.769          | 3.513                    | 0,07                              | 4,030 % fällig am 15.08.2051                               | 15.722         | 15.506                   | 0,29                              | 2,576 % fällig am 20.07.2028                    | 189            | 222                      | 0,00                              |
| <b>London Wall Mortgage Capital PLC</b>                             |                |                          |                                   | 4,197 % fällig am 15.12.2051                               | 2.224          | 2.214                    | 0,04                              | <b>FACT S.A.</b>                                |                |                          |                                   |
| 4,987 % fällig am 15.05.2051                                        | £ 4.560        | 6.256                    | 0,12                              | <b>Verus Securitization Trust</b>                          |                |                          |                                   | 2,547 % fällig am 22.09.2031                    | 16.114         | 18.953                   | 0,36                              |
| 5,037 % fällig am 15.05.2052                                        | 3.925          | 5.384                    | 0,10                              | 1,829 % fällig am 25.10.2066                               | 5.008          | 4.508                    | 0,08                              | <b>FACT CA Leasing</b>                          |                |                          |                                   |
| 5,227 % fällig am 15.05.2057                                        | 8.981          | 12.350                   | 0,23                              | <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>       |                |                          |                                   | 2,794 % fällig am 26.02.2042                    | 2.433          | 2.859                    | 0,05                              |
| <b>Lugo Funding DAC</b>                                             |                |                          |                                   | 4,926 % fällig am 25.08.2046                               | 20             | 19                       | 0,00                              | <b>FTA Santander Consumer Spain Auto</b>        |                |                          |                                   |
| 3,049 % fällig am 26.05.2066                                        | € 1.740        | 2.047                    | 0,04                              | 4,974 % fällig am 25.12.2045                               | 4              | 4                        | 0,00                              | 2,886 % fällig am 22.09.2039                    | 14.918         | 17.610                   | 0,33                              |
| <b>Luminent Mortgage Trust</b>                                      |                |                          |                                   | 4,983 % fällig am 25.10.2035                               | 191            | 175                      | 0,00                              | <b>Globaldrive Auto Receivables BV</b>          |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.10.2046                                        | \$ 124         | 113                      | 0,00                              | 5,014 % fällig am 25.10.2045                               | 2              | 2                        | 0,00                              | 2,327 % fällig am 22.06.2032                    | 713            | 838                      | 0,02                              |
| <b>MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust</b>                        |                |                          |                                   | 5,099 % fällig am 25.03.2047                               | 1.562          | 1.365                    | 0,03                              | <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>            |                |                          |                                   |
| 5,199 % fällig am 25.12.2046                                        | 8.396          | 6.842                    | 0,13                              | 5,354 % fällig am 25.10.2044                               | 338            | 330                      | 0,01                              | 3,086 % fällig am 22.09.2043                    | 3.473          | 4.104                    | 0,08                              |
| <b>Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust</b> |                |                          |                                   | 5,414 % fällig am 25.10.2045                               | 1.320          | 1.309                    | 0,02                              | <b>Hill FL BV</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,906 % fällig am 15.06.2030                                        | 2              | 2                        | 0,00                              | 5,594 % fällig am 25.11.2045                               | 753            | 711                      | 0,01                              | 2,611 % fällig am 18.05.2030                    | 2.359          | 2.773                    | 0,05                              |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                       |                |                          |                                   | <b>Wells Fargo Commercial Mortgage Trust</b>               |                |                          |                                   | 2,631 % fällig am 18.10.2032                    | 21.300         | 25.038                   | 0,47                              |
| 4,854 % fällig am 25.02.2036                                        | 4              | 4                        | 0,00                              | 2,684 % fällig am 15.10.2049                               | 1.299          | 1.277                    | 0,02                              | 2,671 % fällig am 18.05.2031                    | 6.247          | 7.345                    | 0,14                              |
| 4,894 % fällig am 25.04.2029                                        | 71             | 66                       | 0,00                              | 3,370 % fällig am 15.01.2059                               | 348            | 346                      | 0,01                              | <b>Koromo Italy Compartment</b>                 |                |                          |                                   |
| 4,934 % fällig am 25.11.2035                                        | 2              | 2                        | 0,00                              | 3,374 % fällig am 15.12.2059                               | 4.364          | 4.294                    | 0,08                              | 2,614 % fällig am 26.02.2032                    | 918            | 1.080                    | 0,02                              |
| 5,361 % fällig am 25.12.2029                                        | 56             | 54                       | 0,00                              | 3,390 % fällig am 15.11.2050                               | 604            | 598                      | 0,01                              | <b>Koromo Italy SRL</b>                         |                |                          |                                   |
| 5,415 % fällig am 25.12.2034                                        | 3              | 3                        | 0,00                              | 3,453 % fällig am 15.01.2060                               | 590            | 587                      | 0,01                              | 2,734 % fällig am 26.02.2035                    | 217            | 255                      | 0,00                              |
| <b>Merrion Square Residential DAC</b>                               |                |                          |                                   | 3,951 % fällig am 15.03.2051                               | 1.904          | 1.892                    | 0,04                              | <b>Koromo UK PLC</b>                            |                |                          |                                   |
| 2,999 % fällig am 24.03.2081                                        | € 2.528        | 2.971                    | 0,06                              | 4,365 % fällig am 15.09.2061                               | 8.271          | 8.267                    | 0,16                              | 4,824 % fällig am 23.10.2034                    | £ 14.803       | 20.313                   | 0,38                              |
| <b>Morgan Stanley Capital Trust</b>                                 |                |                          |                                   | <b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>        |                |                          |                                   | <b>LT Autorahoitus DAC</b>                      |                |                          |                                   |
| 2,606 % fällig am 15.08.2049                                        | \$ 295         | 292                      | 0,01                              | 6,741 % fällig am 25.04.2036                               | 1.099          | 1.113                    | 0,02                              | 2,601 % fällig am 18.07.2033                    | € 5.445        | 6.406                    | 0,12                              |
| 3,337 % fällig am 15.12.2049                                        | 2.915          | 2.863                    | 0,05                              |                                                            |                | 462.248                  | 8,68                              | 2,811 % fällig am 18.12.2032                    | 3.089          | 3.637                    | 0,07                              |
| <b>Mortimer BTL PLC</b>                                             |                |                          |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                    |                |                          |                                   | <b>LT Rahoitus DAC</b>                          |                |                          |                                   |
| 4,939 % fällig am 23.06.2053                                        | £ 361          | 495                      | 0,01                              | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                             |                |                          |                                   | 2,451 % fällig am 18.07.2036                    | 1.327          | 1.559                    | 0,03                              |
| 5,409 % fällig am 22.12.2056                                        | 590            | 812                      | 0,02                              | <b>Asset-Backed European Securitisation Transaction</b>    |                |                          |                                   | <b>Plenti Auto ABS</b>                          |                |                          |                                   |
| <b>Mortimer Mix PLC</b>                                             |                |                          |                                   | <b>Twenty-One BV</b>                                       |                |                          |                                   | 4,853 % fällig am 12.08.2033                    | AUD 417        | 274                      | 0,01                              |
| 5,069 % fällig am 22.09.2067                                        | 1.071          | 1.472                    | 0,03                              | 2,576 % fällig am 21.09.2031                               | € 200          | 235                      | 0,00                              | <b>Pulse UK PLC</b>                             |                |                          |                                   |
| <b>Pierpont BTL PLC</b>                                             |                |                          |                                   | <b>Auto ABS French Loans</b>                               |                |                          |                                   | 4,884 % fällig am 27.05.2036                    | £ 4.200        | 5.761                    | 0,11                              |
| 5,039 % fällig am 22.12.2053                                        | 6.946          | 9.530                    | 0,18                              | 2,421 % fällig am 24.07.2036                               | 4.396          | 5.164                    | 0,10                              | <b>Red &amp; Black Auto Italy SRL</b>           |                |                          |                                   |
|                                                                     |                |                          |                                   |                                                            |                |                          |                                   | 2,739 % fällig am 28.07.2036                    | € 15.583       | 18.359                   | 0,34                              |
|                                                                     |                |                          |                                   |                                                            |                |                          |                                   | 2,929 % fällig am 28.07.2034                    | 900            | 1.062                    | 0,02                              |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Red & Black Auto Lease France                                              |                |                          |                                   | JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.                                   |                |                          |                                   | 5,269 % fällig am 23.04.2035                   | \$ 12.900      | \$ 12.861                | 0,24                              |
| 2,536 % fällig am 27.06.2039                                               | € 400          | \$ 470                   | 0,01                              | 5,364 % fällig am 25.12.2035                                          | \$ 784         | \$ 773                   | 0,01                              | 5,335 % fällig am 24.07.2034                   | 5.600          | 5.577                    | 0,11                              |
| 2,656 % fällig am 27.06.2035                                               | 1.372          | 1.613                    | 0,03                              | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                   |                |                          |                                   | 5,359 % fällig am 21.10.2034                   | 5.600          | 5.606                    | 0,11                              |
| Retail Automotive CP Germany UG                                            |                |                          |                                   | 4,869 % fällig am 25.05.2036                                          | 411            | 396                      | 0,01                              | 5,469 % fällig am 20.10.2034                   | 20.000         | 20.049                   | 0,38                              |
| 2,576 % fällig am 21.07.2034                                               | 2.510          | 2.954                    | 0,06                              | Long Beach Mortgage Loan Trust                                        |                |                          |                                   | 5,491 % fällig am 16.07.2034                   | 20.000         | 19.986                   | 0,38                              |
| Revocar UG                                                                 |                |                          |                                   | 4,874 % fällig am 25.02.2036                                          | 631            | 622                      | 0,01                              | 5,719 % fällig am 20.10.2034                   | 1.800          | 1.802                    | 0,03                              |
| 2,436 % fällig am 21.02.2037                                               | 1.024          | 1.204                    | 0,02                              | 4,994 % fällig am 25.10.2034                                          | 4              | 4                        | 0,00                              | 5,919 % fällig am 20.10.2034                   | 5.000          | 5.019                    | 0,09                              |
| 2,536 % fällig am 21.04.2036                                               | 511            | 601                      | 0,01                              | 5,034 % fällig am 25.01.2036                                          | 297            | 278                      | 0,01                              | Bain Capital Euro CLO DAC                      |                |                          |                                   |
| SCF Rahoituspalvelut DAC                                                   |                |                          |                                   | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust                                |                |                          |                                   | 2,976 % fällig am 20.01.2032                   | € 387          | 454                      | 0,01                              |
| 2,479 % fällig am 25.06.2034                                               | 243            | 285                      | 0,01                              | 4,564 % fällig am 25.10.2036                                          | 636            | 564                      | 0,01                              | Ballyrock CLO Ltd.                             |                |                          |                                   |
| 2,489 % fällig am 25.06.2032                                               | 495            | 582                      | 0,01                              | 4,934 % fällig am 25.04.2036                                          | 1.396          | 1.333                    | 0,03                              | 5,792 % fällig am 25.07.2037                   | \$ 1.000       | 1.006                    | 0,02                              |
| 2,599 % fällig am 25.06.2033                                               | 5.431          | 6.393                    | 0,12                              | 5,289 % fällig am 25.03.2034                                          | 565            | 577                      | 0,01                              | BBAM European CLO DAC                          |                |                          |                                   |
| Silver Arrow S.A.                                                          |                |                          |                                   | 5,349 % fällig am 25.07.2034                                          | 707            | 718                      | 0,01                              | 3,106 % fällig am 22.07.2034                   | € 1.900        | 2.225                    | 0,04                              |
| 2,332 % fällig am 15.02.2030                                               | 2.215          | 2.601                    | 0,05                              | 5,349 % fällig am 25.09.2034                                          | 1.244          | 1.242                    | 0,02                              | 3,199 % fällig am 15.01.2036                   | 1.523          | 1.782                    | 0,03                              |
| 4,773 % fällig am 20.01.2031                                               | £ 819          | 1.123                    | 0,02                              | Morgan Stanley Home Equity Loan Trust                                 |                |                          |                                   | BBVA Consumo FTA                               |                |                          |                                   |
| VCL Multi-Compartment S.A.                                                 |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.04.2036                                          | 176            | 123                      | 0,00                              | 2,757 % fällig am 21.08.2038                   | 4.600          | 5.412                    | 0,10                              |
| 2,389 % fällig am 21.12.2030                                               | € 2.200        | 2.585                    | 0,05                              | Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                                    |                |                          |                                   | Betony CLO Ltd.                                |                |                          |                                   |
|                                                                            |                | 329.680                  | 6,19                              | 4,614 % fällig am 25.12.2036                                          | 1.690          | 574                      | 0,01                              | 5,621 % fällig am 30.04.2031                   | \$ 366         | 366                      | 0,01                              |
| CMBS SONSTIGE                                                              |                |                          |                                   | Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust                  |                |                          |                                   | Black Diamond CLO DAC                          |                |                          |                                   |
| ACREC LLC                                                                  |                |                          |                                   | 5,064 % fällig am 25.02.2036                                          | 1.210          | 1.131                    | 0,02                              | 2,500 % fällig am 15.05.2032                   | 2.235          | 2.224                    | 0,04                              |
| 5,625 % fällig am 18.08.2042                                               | \$ 6.900       | 6.878                    | 0,13                              | Option One Mortgage Loan Trust                                        |                |                          |                                   | 3,096 % fällig am 20.01.2032                   | € 76           | 90                       | 0,00                              |
| AREIT LLC                                                                  |                |                          |                                   | 4,654 % fällig am 25.04.2037                                          | 1.756          | 1.243                    | 0,02                              | 3,123 % fällig am 15.05.2032                   | 12.458         | 14.621                   | 0,27                              |
| 6,426 % fällig am 17.08.2041                                               | 490            | 491                      | 0,01                              | Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                   | 3,993 % fällig am 15.05.2032                   | 1.000          | 1.177                    | 0,02                              |
| MF1 LLC                                                                    |                |                          |                                   | 5,169 % fällig am 25.11.2035                                          | 274            | 236                      | 0,00                              | Blackrock European CLO DAC                     |                |                          |                                   |
| 5,635 % fällig am 18.02.2040                                               | 8.500          | 8.489                    | 0,16                              | Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates    |                |                          |                                   | 3,116 % fällig am 19.07.2035                   | 10.000         | 11.687                   | 0,22                              |
|                                                                            |                | 15.858                   | 0,30                              | 5,754 % fällig am 25.01.2036                                          | 990            | 949                      | 0,02                              | BPCE Consumer Loans FCT                        |                |                          |                                   |
| HYPOTHEKEN SONSTIGE                                                        |                |                          |                                   | Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust                               |                |                          |                                   | 2,629 % fällig am 31.10.2042                   | 1.700          | 2.001                    | 0,04                              |
| Aames Mortgage Investment Trust                                            |                |                          |                                   | 5,304 % fällig am 25.02.2036                                          | 1.505          | 1.430                    | 0,03                              | Cairn CLO DAC                                  |                |                          |                                   |
| 5,349 % fällig am 25.10.2035                                               | 2.900          | 2.733                    | 0,05                              | Residential Asset Mortgage Products Trust                             |                |                          |                                   | 2,856 % fällig am 31.01.2030                   | 358            | 419                      | 0,01                              |
| ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust                                |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.02.2036                                          | 957            | 929                      | 0,02                              | 3,059 % fällig am 15.10.2031                   | 437            | 512                      | 0,01                              |
| 4,754 % fällig am 25.10.2036                                               | 3.665          | 1.441                    | 0,03                              | 5,499 % fällig am 25.05.2035                                          | 1.985          | 1.931                    | 0,04                              | Canyon Capital CLO Ltd.                        |                |                          |                                   |
| Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates |                |                          |                                   | Residential Asset Securities Corp. Trust                              |                |                          |                                   | 5,266 % fällig am 15.10.2034                   | \$ 4.200       | 4.205                    | 0,08                              |
| 5,304 % fällig am 25.11.2035                                               | 3.026          | 2.852                    | 0,05                              | 4,714 % fällig am 25.07.2036                                          | 1.003          | 982                      | 0,02                              | Carlyle Euro CLO DAC                           |                |                          |                                   |
| 5,349 % fällig am 25.09.2035                                               | 6.000          | 5.834                    | 0,11                              | Saxon Asset Securities Trust                                          |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 15.08.2038                   | € 6.700        | 7.865                    | 0,15                              |
| 5,394 % fällig am 25.10.2035                                               | 1.700          | 1.630                    | 0,03                              | 5,334 % fällig am 26.12.2034                                          | 138            | 134                      | 0,00                              | (b)                                            |                |                          |                                   |
| Asset-Backed Funding Certificates Trust                                    |                |                          |                                   | Structured Asset Investment Loan Trust                                |                |                          |                                   | 2,979 % fällig am 15.01.2031                   | 458            | 537                      | 0,01                              |
| 4,754 % fällig am 25.11.2036                                               | 5.779          | 2.349                    | 0,04                              | 4,614 % fällig am 25.09.2036                                          | 6.195          | 3.827                    | 0,07                              | 3,033 % fällig am 15.08.2032                   | 5.487          | 6.413                    | 0,12                              |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust                                 |                |                          |                                   | 5,054 % fällig am 25.01.2036                                          | 996            | 938                      | 0,02                              | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.      |                |                          |                                   |
| 4,944 % fällig am 25.12.2036                                               | 357            | 346                      | 0,01                              | 5,199 % fällig am 25.08.2035                                          | 1.071          | 1.048                    | 0,02                              | 5,658 % fällig am 15.07.2031                   | \$ 2.534       | 2.541                    | 0,05                              |
| 4,944 % fällig am 25.12.2036                                               | 438            | 435                      | 0,01                              | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                 |                |                          |                                   | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC  |                |                          |                                   |
| Carrington Mortgage Loan Trust                                             |                |                          |                                   | 4,704 % fällig am 25.03.2036                                          | 1.262          | 1.208                    | 0,02                              | 3,212 % fällig am 16.01.2033                   | € 6.813        | 8.005                    | 0,15                              |
| 5,424 % fällig am 25.06.2035                                               | 277            | 278                      | 0,01                              | 4,744 % fällig am 25.08.2046                                          | 2.541          | 2.326                    | 0,04                              | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. |                |                          |                                   |
| Chase Funding Trust                                                        |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.10.2036                                          | 1.425          | 963                      | 0,02                              | 2,893 % fällig am 15.11.2031                   | 403            | 473                      | 0,01                              |
| 5,174 % fällig am 25.10.2032                                               | 1              | 1                        | 0,00                              | 4,854 % fällig am 25.02.2037                                          | 851            | 838                      | 0,02                              | Cumulus Static CLO DAC                         |                |                          |                                   |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.                          |                |                          |                                   | Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust                     |                |                          |                                   | 3,343 % fällig am 15.11.2033                   | 439            | 516                      | 0,01                              |
| 4,209 % fällig am 25.10.2035                                               | 0              | 0                        | 0,00                              | 4,744 % fällig am 25.08.2036                                          | 695            | 670                      | 0,01                              | CVC Cordatus Loan Fund DAC                     |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.02.2037                                               | 553            | 523                      | 0,01                              |                                                                       |                | 61.045                   | 1,15                              | 2,605 % fällig am 15.09.2031                   | 605            | 710                      | 0,01                              |
| 4,714 % fällig am 25.03.2037                                               | 522            | 510                      | 0,01                              | HYPOTHEKEN SEQUENTIELL                                                |                |                          |                                   | 4,790 % fällig am 23.10.2034                   | 1.500          | 1.770                    | 0,03                              |
| 4,834 % fällig am 25.08.2034                                               | 88             | 86                       | 0,00                              | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust                                   |                |                          |                                   | Dryden Euro CLO DAC                            |                |                          |                                   |
| 4,974 % fällig am 25.03.2036                                               | 470            | 415                      | 0,01                              | 4,714 % fällig am 25.03.2047                                          | 581            | 556                      | 0,01                              | 1,950 % fällig am 18.10.2034                   | 1.000          | 1.081                    | 0,02                              |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                       |                |                          |                                   | ABS SONSTIGE                                                          |                |                          |                                   | 3,003 % fällig am 15.05.2034                   | 720            | 844                      | 0,02                              |
| 4,562 % fällig am 25.01.2032                                               | 1              | 1                        | 0,00                              | AlbaCore Euro CLO DAC                                                 |                |                          |                                   | 3,219 % fällig am 15.01.2034                   | 4.998          | 5.861                    | 0,11                              |
| Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC                          |                |                          |                                   | 3,269 % fällig am 15.07.2035                                          | € 17.500       | 20.570                   | 0,39                              | 3,236 % fällig am 18.04.2033                   | 1.467          | 1.721                    | 0,03                              |
| 6,009 % fällig am 25.03.2046                                               | 1.500          | 1.461                    | 0,03                              | Anchorage Capital Europe CLO DAC                                      |                |                          |                                   | 3,986 % fällig am 18.01.2032                   | 1.000          | 1.177                    | 0,02                              |
| Ellington Loan Acquisition Trust                                           |                |                          |                                   | 3,499 % fällig am 15.10.2038                                          | 6.100          | 7.150                    | 0,13                              | FCT Ponant                                     |                |                          |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.05.2037                                               | 1.399          | 1.374                    | 0,03                              | Arbour CLO DAC                                                        |                |                          |                                   | 2,564 % fällig am 27.09.2038                   | 896            | 1.054                    | 0,02                              |
| EquiFirst Mortgage Loan Trust                                              |                |                          |                                   | 3,155 % fällig am 15.12.2038                                          | 1.000          | 1.175                    | 0,02                              | FTA Santander Consumo                          |                |                          |                                   |
| 6,159 % fällig am 25.12.2034                                               | 449            | 438                      | 0,01                              | 3,293 % fällig am 15.11.2037                                          | 23.500         | 27.592                   | 0,52                              | 2,756 % fällig am 21.12.2037                   | 808            | 950                      | 0,02                              |
| Fremont Home Loan Trust                                                    |                |                          |                                   | 3,473 % fällig am 15.05.2038                                          | 5.250          | 6.166                    | 0,12                              | 2,886 % fällig am 21.03.2036                   | 443            | 521                      | 0,01                              |
| 4,774 % fällig am 25.02.2037                                               | 3.736          | 1.143                    | 0,02                              | 4,025 % fällig am 15.12.2038                                          | 2.000          | 2.355                    | 0,04                              | GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos   |                |                          |                                   |
| GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates                              |                |                          |                                   | Arcano Euro CLO DAC                                                   |                |                          |                                   | 2,949 % fällig am 25.02.2034                   | 4.517          | 5.321                    | 0,10                              |
| 5,074 % fällig am 25.12.2035                                               | 2.259          | 2.192                    | 0,04                              | 0,000 % fällig am 25.07.2039 (b)                                      | 1.700          | 1.996                    | 0,04                              | Ginkgo Personal Loans                          |                |                          |                                   |
| GSAA Home Equity Trust                                                     |                |                          |                                   | Ares European CLO DAC                                                 |                |                          |                                   | 2,689 % fällig am 23.09.2044                   | 854            | 1.003                    | 0,02                              |
| 4,934 % fällig am 25.01.2036                                               | 896            | 275                      | 0,01                              | 3,059 % fällig am 15.10.2031                                          | 495            | 580                      | 0,01                              | Ginkgo Sales Finance                           |                |                          |                                   |
| GSAMP Trust                                                                |                |                          |                                   | 3,266 % fällig am 21.10.2034                                          | 3.639          | 4.271                    | 0,08                              | 2,589 % fällig am 25.11.2049                   | 1.870          | 2.200                    | 0,04                              |
| 4,574 % fällig am 25.12.2036                                               | 922            | 492                      | 0,01                              | 4,036 % fällig am 21.10.2034                                          | 5.000          | 5.890                    | 0,11                              | Golden Bar Securitisation SRL                  |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.09.2036                                               | 2.606          | 900                      | 0,02                              | Avoca CLO DAC                                                         |                |                          |                                   | 2,866 % fällig am 22.09.2043                   | 15.766         | 18.591                   | 0,35                              |
| 4,914 % fällig am 25.03.2046                                               | 195            | 192                      | 0,00                              | 3,099 % fällig am 15.10.2032                                          | 3.738          | 4.384                    | 0,08                              | Goldentree Loan Management U.S. CLO Ltd.       |                |                          |                                   |
| 5,334 % fällig am 25.11.2035                                               | 1.358          | 1.326                    | 0,02                              | Avoca Static CLO DAC                                                  |                |                          |                                   | 5,419 % fällig am 20.10.2034                   | \$ 10.000      | 10.007                   | 0,19                              |
| Home Equity Asset Trust                                                    |                |                          |                                   | 3,249 % fällig am 15.01.2035                                          | 925            | 1.086                    | 0,02                              | Golub Capital Partners CLO Ltd.                |                |                          |                                   |
| 4,668 % fällig am 25.10.2035                                               | 2.109          | 2.092                    | 0,04                              | 3,979 % fällig am 15.01.2035                                          | 1.000          | 1.176                    | 0,02                              | 5,592 % fällig am 25.10.2034                   | 1.300          | 1.301                    | 0,02                              |
| 5,139 % fällig am 25.01.2036                                               | 733            | 702                      | 0,01                              | Bain Capital Credit CLO Ltd.                                          |                |                          |                                   | Griffith Park CLO DAC                          |                |                          |                                   |
| HSI Asset Securitization Corp. Trust                                       |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 22.04.2035 (b)                                      | \$ 11.100      | 11.100                   | 0,21                              | 2,795 % fällig am 21.11.2031                   | € 2.637        | 3.088                    | 0,06                              |
| 5,214 % fällig am 25.01.2036                                               | 1.200          | 1.037                    | 0,02                              |                                                                       |                |                          |                                   | Grosvenor Place CLO DAC                        |                |                          |                                   |
|                                                                            |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 15.01.2039                   | 1.000          | 1.173                    | 0,02                              |
|                                                                            |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | Harvest CLO DAC                                |                |                          |                                   |
|                                                                            |                |                          |                                   |                                                                       |                |                          |                                   | 3,039 % fällig am 15.07.2031                   | 669            | 786                      | 0,02                              |

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Hayfin Emerald CLO DAC                  |                |                          |                                   | Providus CLO DAC                      |                |                          |                                   | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust |                |                          |                                   |
| 3,337 % fällig am 17.11.2037            | € 1.000        | \$ 1.173                 | 0,02                              | 3,439 % fällig am 15.10.2038          | € 5.700        | \$ 6.700                 | 0,13                              | 4,674 % fällig am 25.03.2037                       | \$ 4.229       | \$ 2.163                 | 0,04                              |
| 3,586 % fällig am 18.07.2038            | 7.750          | 9.114                    | 0,17                              | Regatta Funding Ltd.                  |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.06.2037                       | 5.512          | 3.257                    | 0,06                              |
| 3,898 % fällig am 25.01.2037            | 1.000          | 1.176                    | 0,02                              | 5,456 % fällig am 15.01.2033          | \$ 9.444       | 9.446                    | 0,18                              | 5,409 % fällig am 25.12.2035                       | 54             | 53                       | 0,00                              |
| 3,914 % fällig am 22.01.2039            | 1.000          | 1.175                    | 0,02                              | Rockford Tower Europe CLO DAC         |                |                          |                                   |                                                    |                | 14.035                   | 0,26                              |
| Henley CLO DAC                          |                |                          |                                   | 3,151 % fällig am 24.01.2035          | € 1.800        | 2.106                    | 0,04                              |                                                    |                | 1.134.649                | 21,31                             |
| 3,148 % fällig am 25.04.2034            | 19.600         | 22.984                   | 0,43                              | 3,561 % fällig am 24.04.2037          | 500            | 587                      | 0,01                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,158 % fällig am 10.06.2034            | 5.000          | 5.855                    | 0,11                              | Sabadell Consumo FT                   |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Indigo Credit Management DAC            |                |                          |                                   | 2,699 % fällig am 22.10.2035          | 11.936         | 14.048                   | 0,26                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,479 % fällig am 15.07.2038            | 1.000          | 1.176                    | 0,02                              | SC Germany S.A., Compartment Consumer |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Invesco Euro CLO DAC                    |                |                          |                                   | 2,564 % fällig am 14.01.2038          | 2.153          | 2.532                    | 0,05                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,296 % fällig am 30.10.2038            | 19.100         | 22.379                   | 0,42                              | 2,592 % fällig am 14.05.2038          | 9.662          | 11.374                   | 0,21                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,979 % fällig am 15.04.2033            | 1.000          | 1.177                    | 0,02                              | 2,612 % fällig am 15.09.2037          | 14.907         | 17.549                   | 0,33                              |                                                    |                |                          |                                   |
| Jubilee CLO DAC                         |                |                          |                                   | SLM Private Credit Student Loan Trust |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 2,929 % fällig am 15.04.2031            | 1.167          | 1.366                    | 0,03                              | 4,820 % fällig am 16.12.2041          | \$ 676         | 660                      | 0,01                              |                                                    |                |                          |                                   |
| KKR CLO Ltd.                            |                |                          |                                   | 4,910 % fällig am 15.06.2039          | 1.233          | 1.202                    | 0,02                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,518 % fällig am 15.04.2031            | \$ 1.059       | 1.060                    | 0,02                              | SLM Student Loan Trust                |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| LCM LP                                  |                |                          |                                   | 2,558 % fällig am 25.10.2039          | € 6.040        | 6.614                    | 0,12                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,648 % fällig am 15.10.2031            | 2.043          | 2.045                    | 0,04                              | St. Paul's CLO DAC                    |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Man Euro CLO DAC                        |                |                          |                                   | 3,113 % fällig am 17.01.2032          | 6.740          | 7.876                    | 0,15                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 4,029 % fällig am 15.10.2036            | € 600          | 706                      | 0,01                              | Steele Creek CLO Ltd.                 |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Man GLG Euro CLO DAC                    |                |                          |                                   | 5,528 % fällig am 15.04.2031          | \$ 1.803       | 1.806                    | 0,03                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 2,665 % fällig am 15.12.2031            | 435            | 509                      | 0,01                              | Symphony CLO Ltd.                     |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Marzio Finance SRL                      |                |                          |                                   | 5,482 % fällig am 16.04.2031          | 2.661          | 2.663                    | 0,05                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 2,759 % fällig am 28.09.2049            | 816            | 962                      | 0,02                              | Takehau CLO DAC                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 2,809 % fällig am 28.05.2049            | 784            | 925                      | 0,02                              | 4,079 % fällig am 15.04.2032          | € 1.000        | 1.178                    | 0,02                              |                                                    |                |                          |                                   |
| Mila BV                                 |                |                          |                                   | Toro European CLO DAC                 |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 2,778 % fällig am 16.09.2041            | 1.000          | 1.176                    | 0,02                              | 2,953 % fällig am 15.02.2034          | 5.030          | 5.886                    | 0,11                              |                                                    |                |                          |                                   |
| Noria DE                                |                |                          |                                   | Trinitas CLO Ltd.                     |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 2,479 % fällig am 25.02.2043            | 13.300         | 15.617                   | 0,29                              | 5,309 % fällig am 20.07.2035          | \$ 5.600       | 5.572                    | 0,11                              |                                                    |                |                          |                                   |
| Ocean Trails CLO                        |                |                          |                                   | 5,379 % fällig am 20.10.2033          | 9.100          | 9.105                    | 0,17                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,299 % fällig am 20.07.2034            | \$ 9.300       | 9.301                    | 0,18                              | 5,612 % fällig am 25.01.2034          | 7.600          | 7.609                    | 0,14                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,556 % fällig am 15.10.2034            | 3.700          | 3.702                    | 0,07                              | 5,622 % fällig am 25.01.2034          | 13.500         | 13.508                   | 0,25                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,956 % fällig am 15.10.2034            | 8.800          | 8.822                    | 0,17                              | 5,631 % fällig am 20.07.2031          | 268            | 268                      | 0,01                              |                                                    |                |                          |                                   |
| Palmer Square BDC CLO Ltd.              |                |                          |                                   | 5,832 % fällig am 25.04.2037          | 2.100          | 2.105                    | 0,04                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,856 % fällig am 15.07.2037            | 500            | 502                      | 0,01                              | Trinitas Euro CLO DAC                 |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Palmer Square European CLO DAC          |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am                     |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,209 % fällig am 15.04.2035            | € 10.000       | 11.734                   | 0,22                              | 15.07.2039 (b)                        | € 1.000        | 1.174                    | 0,02                              |                                                    |                |                          |                                   |
| Palmer Square European Loan Funding DAC |                |                          |                                   | TSTAT Ltd.                            |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,113 % fällig am 15.05.2033            | 584            | 686                      | 0,01                              | 5,419 % fällig am 20.07.2037          | \$ 1.441       | 1.442                    | 0,03                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,133 % fällig am 15.05.2034            | 16.091         | 18.876                   | 0,35                              | 5,669 % fällig am 20.07.2037          | 11.450         | 11.460                   | 0,22                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,143 % fällig am 15.05.2034            | 21.922         | 25.712                   | 0,48                              | Venture CLO Ltd.                      |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,170 % fällig am 15.10.2034            | 1.300          | 1.522                    | 0,03                              | 5,778 % fällig am 15.01.2032          | 609            | 610                      | 0,01                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,203 % fällig am 15.02.2035            | 2.100          | 2.465                    | 0,05                              | Voya Euro CLO DAC                     |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,259 % fällig am 15.01.2033            | 11.695         | 13.739                   | 0,26                              | 3,249 % fällig am 15.10.2034          | € 20.000       | 23.459                   | 0,44                              |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,793 % fällig am 15.05.2033            | 1.000          | 1.176                    | 0,02                              |                                       |                | 713.475                  | 13,40                             |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,870 % fällig am 15.10.2034            | 1.000          | 1.177                    | 0,02                              |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 3,993 % fällig am 15.05.2034            | 15.000         | 17.662                   | 0,33                              |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 4,179 % fällig am 15.01.2033            | 10.700         | 12.581                   | 0,24                              |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Park Blue CLO Ltd.                      |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,689 % fällig am 20.07.2037            | \$ 4.600       | 4.606                    | 0,09                              |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| Pikes Peak CLO                          |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,466 % fällig am 15.07.2034            | 10.000         | 10.007                   | 0,19                              |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |
| 5,489 % fällig am 11.10.2034            | 10.000         | 10.010                   | 0,19                              |                                       |                |                          |                                   |                                                    |                |                          |                                   |

## STAATSEMISSIONEN

|                                              |                |        |      |
|----------------------------------------------|----------------|--------|------|
| Colombian TES                                |                |        |      |
| 6,000 % fällig am                            |                |        |      |
| 28.04.2028                                   | COP 65.456.000 | 14.421 | 0,27 |
| Czech Republic Government International Bond |                |        |      |
| 4,200 % fällig am                            |                |        |      |
| 04.12.2036                                   | CZK 82.400     | 3.856  | 0,07 |
| Israel Government International Bond         |                |        |      |
| 1,750 % fällig am                            |                |        |      |
| 31.08.2025                                   | ILS 76.100     | 22.507 | 0,42 |
| Mexico Government International Bond         |                |        |      |
| 8,000 % fällig am                            |                |        |      |
| 07.11.2047                                   | MXN 155.500    | 6.866  | 0,13 |
| 8,500 % fällig am 01.03.2029                 | 90.700         | 4.794  | 0,09 |
| Poland Government International Bond         |                |        |      |
| 4,750 % fällig am                            |                |        |      |
| 25.07.2029                                   | PLN 56.600     | 15.650 | 0,29 |
| Saudi Arabia Government International Bond   |                |        |      |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028                 | \$ 19.100      | 19.423 | 0,37 |
|                                              |                | 87.517 | 1,64 |

## KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

|                                |        |        |      |
|--------------------------------|--------|--------|------|
| Pacific Gas & Electric Co.     |        |        |      |
| 5,339 % fällig am 04.09.2025   | 22.500 | 22.501 | 0,42 |
| U.S. TREASURY BILLS            |        |        |      |
| 4,297 % fällig am              |        |        |      |
| 25.09.2025 (c)(d)              | 30.000 | 29.700 | 0,56 |
| Summe kurzfristige Instrumente |        | 52.201 | 0,98 |

Summe Übertragbare Wertpapiere \$ 4.036.214 75,82

## AKTIEN

|                                   |            |            |      |
|-----------------------------------|------------|------------|------|
| INVESTMENTFONDS                   |            |            |      |
| ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN |            |            |      |
| PIMCO Select Funds plc -          |            |            |      |
| PIMCO US Dollar                   |            |            |      |
| Short-Term Floating               |            |            |      |
| NAV Fund (f)                      | 48.103.247 | 479.674    | 9,01 |
| Summe Investmentfonds             |            | \$ 479.674 | 9,01 |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                                                    | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                     | 4,470 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 807.100         | U.S. Treasury Inflation<br>Protected Securities<br>2,125 % fällig am<br>15.04.2029 | \$ (824.293)               | \$ 807.100                          | \$ 807.200                                                          | 15,15                        |
|                         | 4,480           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 254.300            | Ginnie Mae 6,000 % fällig am<br>20.06.2053                                         | (258.504)                  | 254.300                             | 254.332                                                             | 4,78                         |
| GSC                     | 4,470           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 270.000            | Ginnie Mae 5,500 % fällig am<br>20.06.2054                                         | (277.140)                  | 270.000                             | 270.034                                                             | 5,07                         |
| MFK                     | 4,480           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 200.000            | U.S. Treasury Bonds 4,750 %<br>fällig am 15.11.2053                                | (205.119)                  | 200.000                             | 200.025                                                             | 3,76                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                                                                    | \$ (1.565.056)             | \$ 1.531.400                        | \$ 1.531.591                                                        | 28,76                        |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| E-mini S&P 500 Index September Futures                         | Long  | 09/2025          | 4.665                   | \$ 44.057                                       | 0,83                         |
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09/2025          | 3                       | 4                                               | 0,00                         |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Short | 09/2025          | 2                       | 5                                               | 0,00                         |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Short | 09/2025          | 1.981                   | (1.345)                                         | (0,03)                       |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09/2025          | 2.605                   | 2.285                                           | 0,04                         |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Short | 09/2025          | 3.307                   | (6.087)                                         | (0,12)                       |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09/2025          | 52                      | (151)                                           | 0,00                         |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09/2025          | 57                      | (176)                                           | 0,00                         |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Short | 09/2025          | 5                       | (11)                                            | 0,00                         |
|                                                                |       |                  |                         | <b>\$ 38.581</b>                                | <b>0,72</b>                  |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | <b>\$ 38.581</b>                                | <b>0,72</b>                  |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Bank of America Corp. | 1,000 %                        | 20.12.2025            | \$ 300                         | \$ (1)                                          | 0,00                         |
| Bank of America Corp. | 1,000                          | 20.12.2026            | 12.400                         | (42)                                            | 0,00                         |
| Citigroup, Inc.       | 1,000                          | 20.12.2025            | 1.100                          | (3)                                             | 0,00                         |
| Deutsche Bank AG      | 1,000                          | 20.06.2030            | € 10.000                       | 37                                              | 0,00                         |
| Ford Motor Co.        | 5,000                          | 20.12.2028            | \$ 300                         | (9)                                             | 0,00                         |
| General Electric Co.  | 1,000                          | 20.06.2026            | 1.700                          | 1                                               | 0,00                         |
| General Electric Co.  | 1,000                          | 20.12.2026            | 3.700                          | 7                                               | 0,00                         |
|                       |                                |                       |                                | <b>\$ (10)</b>                                  | <b>0,00</b>                  |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.IG-41 5-Year Index | 1,000 %                        | 20.12.2028            | \$ 2.300                       | \$ 0                                            | 0,00                         |
| CDX.IG-43 5-Year Index | 1,000                          | 20.12.2029            | 47.100                         | 39                                              | 0,00                         |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030            | 150.000                        | 646                                             | 0,01                         |
|                        |                                |                       |                                | <b>\$ 685</b>                                   | <b>0,01</b>                  |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 81.840        | \$ (228)                                        | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,750              | 15.06.2032            | \$ 28.900       | (587)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 19.03.2030            | 23.130          | (742)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 21.06.2030            | 7.100           | 37                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 21.06.2028            | 12.300          | (65)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.09.2025            | 3.500           | (31)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.12.2030            | 37.700          | (127)                                           | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,734              | 31.05.2032            | 124.100         | 1.772                                           | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2026            | 252.990         | (238)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2027            | 22.000          | (258)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2028            | 21.900          | (26)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2028            | 27.210          | (378)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.12.2028            | 47.930          | (333)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2029            | 4.800           | (183)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2029            | 28.690          | (426)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2031            | 18.300          | (254)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2033            | 9.900           | 84                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2034            | 100.050         | 445                                             | 0,01                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,791              | 31.05.2032            | 83.700          | 1.480                                           | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,000              | 18.12.2025            | 41.050          | 307                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,000              | 20.06.2026            | 62.500          | (584)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,250              | 20.12.2025            | 104.500         | 74                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,498              | 28.04.2028            | COP 57.903.400  | 358                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR             | 3,760              | 01.11.2034            | CZK 91.800      | (58)                                            | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,000              | 17.09.2027            | € 24.700        | (114)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month PLN-WIBOR              | 4,930              | 25.07.2029            | PLN 56.600      | (542)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 28-Day MXN-TIE                 | 7,760              | 01.03.2029            | MXN 19.200      | 6                                               | 0,00                         |

| Zahlung/<br>Erhalt                             | variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                         |                       | 28-Day MXN-TIIE        | 9,000 %            | 01.03.2029            | MXN 104.400     | \$ (257)                                        | (0,01)                       |
| Erhalt                                         |                       | 28-Day MXN-TIIE        | 9,390              | 12.12.2025            | 71.200          | (21)                                            | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          |                       | 28-Day MXN-TIIE        | 9,390              | 03.11.2034            | 71.200          | (255)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | 28-Day MXN-TIIE        | 9,430              | 25.12.2025            | 96.400          | (34)                                            | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          |                       | 28-Day MXN-TIIE        | 9,430              | 19.10.2034            | 96.400          | (356)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,418              | 11.07.2052            | \$ 5.700        | 121                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,503              | 25.03.2030            | 73.100          | (101)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,505              | 25.03.2030            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,515              | 27.03.2030            | 14.200          | (31)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,520              | 27.03.2030            | 27.400          | (66)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,523              | 27.03.2030            | 5.200           | (13)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,541              | 04.04.2030            | 125.000         | (484)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                        |                       | CPURNSA                | 2,556              | 15.05.2030            | 49.400          | 202                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        |                       | CPURNSA                | 2,571              | 16.05.2030            | 46.100          | 218                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        |                       | CPURNSA                | 2,595              | 16.05.2030            | 52.500          | 306                                             | 0,01                         |
|                                                |                       |                        |                    |                       |                 | \$ (1.382)                                      | (0,02)                       |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                       |                        |                    |                       |                 | \$ (707)                                        | (0,01)                       |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                        | Variable Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------|------------------------|-----------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| CBK        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                  | 5,850 %            | 21.11.2025         | 122.100                        | \$ 45  | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                  | 5,850              | 24.11.2025         | 46.400                         | 19     | 0              | 0,00                         |
|            |                                     |                        |                                         |                    |                    |                                | \$ 64  | \$ 0           | 0,00                         |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.12.2029            | € 82.986                       | \$ 16.563                                | \$ 1.388                                        | \$ 17.951      | 0.34                         |
| JPM        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000                          | 20.12.2029            | 129.057                        | 26.383                                   | 1.534                                           | 27.917         | 0.52                         |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.16 Index             | 0,500                          | 17.04.2065            | \$ 15.400                      | (236)                                    | 100                                             | (136)          | 0.00                         |
|            |                                  |                                |                       |                                | \$ 42.710                                | \$ 3.022                                        | \$ 45.732      | 0.86                         |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier                 | Anzahl der<br>Anteile<br>oder Einheiten | Variabler<br>Zinssatz                                   | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------|----------------------------|-----------------------------------------|---------------------------------------------------------|-----------------|-----------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| CBK        | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 7.976                                   | 4,820 %                                                 | \$ 104.080      | 21.11.2025            | \$ 0                                         | \$ 4.895                                        | \$ 4.895       | 0,09                         |
| GST        | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 24.002                                  | 4,770                                                   | 313.205         | 06.08.2025            | 0                                            | 14.742                                          | 14.742         | 0,28                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 7.976                                   | 4,790                                                   | 104.080         | 19.09.2025            | 0                                            | 4.897                                           | 4.897          | 0,09                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 7.976                                   | 4,810                                                   | 104.080         | 17.10.2025            | 0                                            | 4.895                                           | 4.895          | 0,09                         |
| RBC        | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 28.555                                  | FEDL01 Zinssatz<br>zzgl. eines<br>bestimmten<br>Spreads | 372.618         | 09.07.2025            | 0                                            | 17.482                                          | 17.482         | 0,33                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 22.310                                  | 4,800                                                   | 291.126         | 09.07.2025            | 0                                            | 13.696                                          | 13.696         | 0,26                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 2.839                                   | 4,850                                                   | 37.046          | 16.07.2025            | 0                                            | 1.741                                           | 1.741          | 0,03                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 17.164                                  | FEDL01 Zinssatz<br>zzgl. eines<br>bestimmten<br>Spreads | 223.975         | 03.09.2025            | 0                                            | 10.510                                          | 10.510         | 0,20                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 8.767                                   | FEDL01 Zinssatz<br>zzgl. eines<br>bestimmten<br>Spreads | 114.402         | 24.09.2025            | 0                                            | 5.361                                           | 5.361          | 0,10                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier                 | Anzahl der<br>Anteile<br>oder Einheiten | Variabler Zinssatz                                   | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------|----------------------------|-----------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------|-----------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 29.185                                  | FEDL01 Zinssatz<br>zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 380.839         | 15.10.2025            | \$ 0                                         | \$ 17.842                                          | \$ 17.842      | 0,34                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 10.074                                  | 4,920                                                | 131.457         | 16.01.2026            | 0                                            | 6.171                                              | 6.171          | 0,12                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 13.777                                  | 4,940                                                | 179.778         | 08.04.2026            | 0                                            | 8.437                                              | 8.437          | 0,16                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 22.309                                  | 4,960                                                | 291.113         | 08.04.2026            | 0                                            | 13.657                                             | 13.657         | 0,26                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 2.838                                   | 5,020                                                | 37.033          | 15.04.2026            | 0                                            | 1.736                                              | 1.736          | 0,03                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 3.340                                   | 5,010                                                | 44.028          | 03.06.2026            | 0                                            | 1.616                                              | 1.616          | 0,03                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 29.288                                  | 4,970                                                | 394.251         | 24.06.2026            | 0                                            | 7.095                                              | 7.095          | 0,13                         |
| TOR        | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 4.554                                   | FEDL01 Zinssatz<br>zzgl. eines<br>bestimmten Spreads | 59.426          | 20.08.2025            | 0                                            | 2.784                                              | 2.784          | 0,05                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 4.554                                   | 4,860                                                | 58.735          | 20.08.2025            | 0                                            | 3.400                                              | 3.400          | 0,06                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 22.309                                  | 4,880                                                | 291.113         | 01.10.2025            | 0                                            | 13.676                                             | 13.676         | 0,26                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 14.885                                  | 4,890                                                | 194.236         | 01.10.2025            | 0                                            | 9.123                                              | 9.123          | 0,17                         |
|            |                    |                            |                                         |                                                      |                 |                       | \$ 0                                         | \$ 163.756                                         | \$ 163.756     | 3,08                         |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £                      | 3.680                    | \$ 5.050                         | \$ 7                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 314                      | AUD 484                          | 3                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 27                       | € 24                             | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 80                       | NZD 132                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | AUD                    | 484                      | \$ 315                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | NZD                    | 132                      | 80                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 5.050                    | £ 3.680                          | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025               |                        | 3.591                    | CHF 2.942                        | 105                                | 0                                                    | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025               | BRL                    | 72.960                   | \$ 12.983                        | 0                                  | (385)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | €                      | 2.648                    | 3.028                            | 0                                  | (82)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 786                      | 24                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 11.266                   | CAD 15.390                       | 12                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 542                      | IDR 8.862.980                    | 3                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.725                    | ¥ 248.300                        | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CZK                    | 8.851                    | \$ 398                           | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 16.405                   | CNH 117.230                      | 22                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 1.105                    | INR 96.038                       | 12                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 21.905                   | TWD 660.081                      | 1.039                              | 0                                                    | 0,02                         |
| BRC        | 07.2025               | €                      | 714.187                  | \$ 811.059                       | 0                                  | (27.290)                                             | (0,51)                       |
|            | 07.2025               | ILS                    | 1.634                    | 469                              | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | PLN                    | 1.669                    | 446                              | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 13.140                   | € 11.625                         | 506                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 292.104                  | £ 214.681                        | 2.089                              | (4)                                                  | 0,04                         |
|            | 07.2025               |                        | 233                      | ILS 786                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 2.005                    | THB 65.498                       | 12                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | ZAR 97                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CZK                    | 87.344                   | \$ 3.927                         | 0                                  | (227)                                                | 0,00                         |
|            | 08.2025               | £                      | 212.970                  | 289.809                          | 0                                  | (2.077)                                              | (0,04)                       |
| CBK        | 07.2025               | €                      | 4.318                    | 4.970                            | 0                                  | (99)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 4.412                    | 5.990                            | 0                                  | (56)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | IDR                    | 3.351.269                | 206                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 11.658.500               | 8.501                            | 0                                  | (119)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 41.153                   | 1.238                            | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 6.895                    | AUD 10.584                       | 41                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.082                    | € 945                            | 27                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 3.834                    | £ 2.789                          | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.501.465                | \$ 17.454                        | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 8.273                    | INR 713.093                      | 27                                 | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025               | ILS                    | 75.643                   | \$ 20.028                        | 0                                  | (2.450)                                              | (0,05)                       |
| DUB        | 07.2025               | DKK                    | 2.648                    | 416                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                    | 794                      | 229                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 53                       | 41                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 390.440                  | € 336.557                        | 4.628                              | 0                                                    | 0,09                         |
|            | 08.2025               | €                      | 335.820                  | \$ 390.440                       | 0                                  | (4.622)                                              | (0,09)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 416                      | DKK 2.641                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 3.835                    | INR 330.910                      | 15                                 | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025               | MXN                    | 0                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| FAR        | 07.2025               | AUD                    | 11.068                   | 7.141                            | 0                                  | (112)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | BRL                    | 775                      | 140                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CHF                    | 2.951                    | 3.584                            | 0                                  | (124)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | DKK                    | 3.599                    | 565                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 1.883.444                | 12.939                           | 0                                  | (100)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | PLN                    | 10.104                   | 2.740                            | 0                                  | (55)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 134                      | 104                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 12.896                   | BRL 73.733                       | 613                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 12                       | CHF 9                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 28.056                   | ¥ 4.024.874                      | 0                                  | (192)                                                | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CHF                    | 9                        | \$ 12                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 565                      | DKK 3.590                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 1.833                    | INR 158.486                      | 11                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 12.939                   | ¥ 1.876.518                      | 100                                | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | MXN                    | 198.482                  | \$ 10.193                        | 0                                  | (228)                                                | 0,00                         |



| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| GLM        | 09.2025               | \$                     | 140                      | BRL 787                          | \$ 2                               | \$ 2                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR                    | 794.886                  | \$ 49                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 36                       | € 30                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| JPM        | 07.2025               | KRW                    | 663.993                  | \$ 485                           | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | NZD                    | 132                      | 79                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 36.160                   | 9.706                            | 0                                  | (297)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 3.540                    | 2.756                            | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 946                      | DKK 6.244                        | 37                                 | 37                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 3                        | ZAR 56                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 1.235                    | INR 107.112                      | 11                                 | 11                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 7.737                    | TWD 246.858                      | 844                                | 844                                                  | 0,02                      |
|            | 07.2025               | CAD                    | 15.494                   | \$ 11.281                        | 0                                  | (74)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR                    | 667.515                  | 41                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 60.127                   | 418                              | 2                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 12.823                   | 3.424                            | 0                                  | (123)                                                | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | 8.503                    | 6.628                            | 0                                  | (48)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB                    | 20.658                   | 624                              | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 75                       | CAD 104                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 5.948                    | € 5.159                          | 107                                | 107                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 4.422                    | £ 3.254                          | 37                                 | 37                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 901                      | ¥ 129.458                        | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 33                       | SGD 43                           | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CAD                    | 103                      | \$ 75                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD                    | 43                       | 33                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD                    | 45.819                   | 1.454                            | 0                                  | (139)                                                | 0,00                      |
|            | 07.2025               | €                      | 201                      | 235                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 797.557                  | 5.483                            | 0                                  | (39)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 53                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 629                      | ¥ 90.921                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 9.488                    | SGD 12.171                       | 68                                 | 68                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 5.483                    | ¥ 794.624                        | 40                                 | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 09.2025               | COP                    | 63.077.472               | \$ 15.295                        | 17                                 | 17                                                   | 0,00                      |
| RYL        | 08.2025               | CNH                    | 211.478                  | 29.395                           | 0                                  | (239)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | IDR                    | 3.697.075                | 227                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ILS                    | 12                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SCX        | 07.2025               | ¥                      | 585.960                  | 4.077                            | 20                                 | 20                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 7                        | SGD 9                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD                    | 8                        | \$ 7                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 14.428                   | CNH 104.599                      | 230                                | 230                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 1.293                    | INR 111.029                      | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 264                      | ¥ 38.019                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SOG        | 07.2025               | €                      | 3.403                    | \$ 3.921                         | 0                                  | (79)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 87.046                   | 603                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD                    | 952.936                  | 29.122                           | 0                                  | (4.002)                                              | (0,08)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 7                        | INR 640                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 603                      | ¥ 86.726                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 2.684                    | TWD 85.564                       | 290                                | 290                                                  | 0,01                      |
|            | 09.2025               | MXN                    | 39.375                   | \$ 2.043                         | 0                                  | (24)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | £                      | 213.929                  | 289.664                          | 0                                  | (3.494)                                              | (0,07)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 4.280                    | € 3.691                          | 52                                 | 52                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 9.021                    | KRW 12.241.677                   | 30                                 | 30                                                   | 0,00                      |
| UAG        | 07.2025               | ILS                    | 120                      | \$ 33                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 65.596                   | 453                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB                    | 3.280                    | 99                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.747                    | £ 1.297                          | 30                                 | 30                                                   | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 11.086                   | \$ 1.549                         | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                      |
|            | 09.2025               | \$                     | 343                      | MXN 6.657                        | 6                                  | 6                                                    | 0,00                      |
| WST        | 07.2025               | €                      | 9.767                    | \$ 11.034                        | 0                                  | (431)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 1.000.184                | 6.945                            | 21                                 | 21                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 435.821                  | € 371.655                        | 446                                | 446                                                  | 0,01                      |
|            | 08.2025               | €                      | 371.655                  | \$ 436.773                       | 0                                  | (446)                                                | (0,01)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 6.945                    | ¥ 996.503                        | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 11.569                        | \$ (47.886)                        | \$ (36.317)                                          | (0,68)                    |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | €                      | 60.354                   | \$ 70.668                        | \$ 0                               | \$ (179)                                             | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 55.650                   | € 48.978                         | 1.843                              | 1.843                                                | 0,03                      |
|            | 08.2025               |                        | 70.823                   | 60.354                           | 179                                | 179                                                  | 0,00                      |
| BOA        | 07.2025               |                        | 67.462                   | 59.331                           | 2.183                              | 2.183                                                | 0,04                      |
|            | 07.2025               |                        | 3                        | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 78.895                   | 69.423                           | 2.598                              | 2.598                                                | 0,05                      |
| BRC        | 07.2025               | €                      | 4.728                    | \$ 5.481                         | 0                                  | (69)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 223                      | € 192                            | 3                                  | 3                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | €                      | 60.882                   | \$ 70.629                        | 0                                  | (838)                                                | (0,02)                    |
| DUB        | 08.2025               | \$                     | 70.629                   | € 60.748                         | 836                                | 836                                                  | 0,02                      |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| MBC                              | 07.2025               | €                      | 465                      | \$ 537                           | \$ 0                               | \$ (8)                                               | 0,00                         |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 928                      | € 804                            | 15                                 | 15                                                   | 0,00                         |
|                                  |                       |                        |                          |                                  | \$ 7.657                           | \$ (1.094)                                           | 6.563                        |
|                                  |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      | 0,12                         |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 179.734                                           | 3,38                         |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 6.264.896                                         | 117,68                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (941.052)                                         | (17,68)                      |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 5.323.844                                         | 100,00                       |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von USD 153.116 (31. Dezember 2024: 181.899 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 31.780 USD (31. Dezember 2024: 59.550 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 4.024.917                                                    | \$ 11.297                                                    | \$ 4.036.214 |
| Investmentfonds               | 479.674                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 479.674      |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 1.531.400                                                       | 0                                                            | 1.531.400    |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 44.054                                                                      | 173.554                                                         | 0                                                            | 217.608      |
| Summen                        | \$ 523.728                                                                  | \$ 5.729.871                                                    | \$ 11.297                                                    | \$ 6.264.896 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 4.207.875                                                    | \$ 26.772                                                    | \$ 4.234.647 |
| Investmentfonds               | 436.651                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 436.651      |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 453.100                                                         | 0                                                            | 453.100      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (82.648)                                                                    | 39.807                                                          | 0                                                            | (42.841)     |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (147.276)                                                       | 0                                                            | (147.276)    |
| Summen                        | \$ 354.003                                                                  | \$ 4.553.506                                                    | \$ 26.772                                                    | \$ 4.934.281 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                           |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                           |                                     |
|------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/<br>verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.844                            | \$ (1.580)                                | \$ 264                              | \$ 5                                | \$ 0                                      | \$ 5                                |
| BOA        | 2.288                               | (2.180)                                   | 108                                 | (1.679)                             | 1.410                                     | (269)                               |
| BPS        | 18.543                              | (18.710)                                  | (167)                               | 5.166                               | (570)                                     | 4.596                               |
| BRC        | (24.424)                            | 22.570                                    | (1.854)                             | 1.111                               | (1.070)                                   | 41                                  |
| CBK        | 2.140                               | (1.710)                                   | 430                                 | (782)                               | 910                                       | 128                                 |
| DUB        | 11                                  | 0                                         | 11                                  | (1.351)                             | 1.190                                     | (161)                               |
| FAR        | (88)                                | 330                                       | 242                                 | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               |
| GST        | 24.534                              | (21.740)                                  | 2.794                               | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               |
| IND        | k. A.                               | k. A.                                     | k. A.                               | (11)                                | 0                                         | (11)                                |

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| JPM        | \$ 28.482                           | \$ (28.190)                           | \$ 292                              | \$ 13.324                           | \$ (13.330)                           | \$ (6)                              |
| MBC        | (248)                               | 130                                   | (118)                               | (497)                               | 410                                   | (87)                                |
| MYC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| MYI        | 84                                  | (10)                                  | 74                                  | (17)                                | (10)                                  | (27)                                |
| RBC        | 105.344                             | (92.750)                              | 12.594                              | (9.937)                             | 55.610                                | 45.673                              |
| RYL        | (239)                               | 270                                   | 31                                  | 1                                   | 0                                     | 1                                   |
| SAL        | (136)                               | 280                                   | 144                                 | (193)                               | 0                                     | (193)                               |
| SCX        | 247                                 | (290)                                 | (43)                                | 14.110                              | (12.200)                              | 1.910                               |
| SOG        | (3.815)                             | 4.170                                 | 355                                 | 124                                 | 0                                     | 124                                 |
| SSB        | (3.412)                             | 3.650                                 | 238                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| TOR        | 28.983                              | (25.810)                              | 3.173                               | (34)                                | 20                                    | (14)                                |
| UAG        | 27                                  | 0                                     | 27                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| WST        | (431)                               | 380                                   | (51)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 12,56             | 30,58             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 37,94             | 39,63             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 1,33              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 6,16              | 7,23              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 19,67             | 7,50              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,60              | 0,03              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,08              | 0,31              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,94              | 0,61              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 18,72             | 14,11             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,17              | 0,17              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 11,29             | 12,34             |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 30,95             | 23,57             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 0,80              | 12,77             |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 8,68              | 9,36              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 21,31             | 22,11             |
| Staatsemissionen                                                                       | 1,64              | 1,45              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,98              | 2,55              |
| Investmentfonds                                                                        | 9,01              | 8,69              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 28,76             | 9,02              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,72              | (1,61)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,01              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,02)            | 0,37              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | k. A.             | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,86              | 0,37              |
| Total Return Swaps auf Indizes                                                         | 3,08              | (0,27)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,68)            | 0,37              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,12              | (0,08)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | k. A.             | (2,93)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (17,68)           | 1,75              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

| BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                          | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                    | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                              |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 |                           |                                   |                                                                                 |                 |                           |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                      |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 |                           |                                   |                                                                                 |                 |                           |                                   |
| <b>BANKEN UND FINANZEN</b>                                   |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 |                           |                                   |                                                                                 |                 |                           |                                   |
| Avolon Holdings Funding Ltd.<br>2,528 % fällig am 18.11.2027 | \$ 43           | \$ 41                     | 0,39                              | Chase Mortgage Finance Trust<br>4,939 % fällig am 25.07.2037                          | \$ 1            | \$ 1                      | 0,01                              | Griffith Park CLO DAC<br>2,795 % fällig am 21.11.2031                           | € 44            | \$ 51                     | 0,49                              |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>6,249 % fällig am 15.03.2028    | 100             | 102                       | 0,97                              | Countrywide Alternative Loan Trust<br>5,399 % fällig am 25.12.2035                    | 20              | 18                        | 0,17                              | Hayfin Emerald CLO DAC<br>3,586 % fällig am 18.07.2038                          | 250             | 294                       | 2,81                              |
| JPMorgan Chase & Co.<br>5,040 % fällig am 23.01.2028         | 100             | 101                       | 0,96                              | 5,500 % fällig am 25.11.2035                                                          | 11              | 8                         | 0,08                              | Marzio Finance SRL<br>2,759 % fällig am 28.09.2049                              | 82              | 96                        | 0,92                              |
| Morgan Stanley Bank N.A.<br>4,952 % fällig am 14.01.2028     | 100             | 101                       | 0,97                              | 5,915 % fällig am 25.11.2035                                                          | 30              | 14                        | 0,13                              | Oak Hill European Credit Partners DAC<br>2,966 % fällig am 20.01.2032           | 33              | 39                        | 0,37                              |
|                                                              |                 | 345                       | 3,29                              | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust<br>4,894 % fällig am 25.05.2035     | 62              | 54                        | 0,52                              | Ocean Trails CLO<br>5,556 % fällig am 15.10.2034                                | \$ 300          | 300                       | 2,87                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust<br>4,859 % fällig am 25.11.2034        | 6               | 6                         | 0,06                              | Providus CLO DAC<br>3,439 % fällig am 15.10.2038                                | € 300           | 353                       | 3,37                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | GSR Mortgage Loan Trust<br>4,429 % fällig am 25.11.2035                               | 12              | 10                        | 0,09                              |                                                                                 |                 | 1.358                     | 12,98                             |
|                                                              |                 |                           |                                   | London Wall Mortgage Capital PLC<br>5,227 % fällig am 15.05.2057                      | £ 55            | 75                        | 0,72                              |                                                                                 |                 | 2.223                     | 21,25                             |
|                                                              |                 |                           |                                   | Mortgage Equity Conversion Asset Trust<br>4,460 % fällig am 25.02.2042                | \$ 25           | 25                        | 0,24                              | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                         |                 |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   | Polaris PLC<br>5,044 % fällig am 26.02.2068                                           | £ 99            | 136                       | 1,30                              | Colombian TES<br>6,000 % fällig am 28.04.2028                                   | 123,60          |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   | Stratton Mortgage Funding PLC<br>5,139 % fällig am 28.06.2050                         | 77              | 106                       | 1,01                              | COP                                                                             | 0               | 27                        | 0,26                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | 5,214 % fällig am 25.06.2049                                                          | 205             | 282                       | 2,69                              | Czech Republic Government International Bond<br>4,200 % fällig am 04.12.2036    | CZK 200         | 9                         | 0,09                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Structured Asset Mortgage Investments Trust<br>4,932 % fällig am 19.07.2035           | \$ 11           | 11                        | 0,10                              | Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2055             | ¥ 6.000         | 38                        | 0,36                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | 5,054 % fällig am 25.09.2045                                                          | 9               | 8                         | 0,08                              | Mexico Government International Bond<br>2,750 % fällig am 27.11.2031 (a) MXN    | 170             | 8                         | 0,08                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust<br>4,714 % fällig am 25.01.2036 | 10              | 9                         | 0,09                              | 3,000 % fällig am 03.12.2026 (a)                                                | 1.700           | 88                        | 0,84                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | 4,784 % fällig am 25.03.2035                                                          | 33              | 30                        | 0,29                              | 4,000 % fällig am 24.08.2034 (a)                                                | 935             | 46                        | 0,44                              |
|                                                              |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 | 866                       | 8,28                              | 8,500 % fällig am 01.03.2029                                                    | 200             | 11                        | 0,10                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                               |                 |                           |                                   | Peru Government International Bond<br>5,400 % fällig am 12.08.2034              | PEN 108         | 29                        | 0,28                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | <b>AUTOMOBILE ABS SONSTIGE</b>                                                        |                 |                           |                                   | 6,150 % fällig am 12.08.2032                                                    | 600             | 175                       | 1,67                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Auto ABS Spanish Loans<br>2,779 % fällig am 28.09.2038                                | € 90            | 106                       | 1,01                              | 6,950 % fällig am 12.08.2031                                                    | 81              | 25                        | 0,24                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Plenti Auto ABS<br>4,853 % fällig am 12.08.2033                                       | AUD 417         | 274                       | 2,62                              | 7,300 % fällig am 12.08.2033                                                    | 100             | 31                        | 0,30                              |
|                                                              |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 | 380                       | 3,63                              | Poland Government International Bond<br>4,750 % fällig am 25.07.2029            | PLN 100         | 28                        | 0,27                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>                                                            |                 |                           |                                   | South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031      | ZAR 400         | 21                        | 0,20                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>4,754 % fällig am 25.08.2036            | \$ 63           | 61                        | 0,58                              | 8,000 % fällig am 31.01.2030                                                    | 200             | 11                        | 0,10                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | 5,684 % fällig am 25.08.2037                                                          | 4               | 4                         | 0,04                              | 8,250 % fällig am 31.03.2032                                                    | 300             | 16                        | 0,15                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Fremont Home Loan Trust<br>5,049 % fällig am 25.11.2035                               | 93              | 86                        | 0,82                              | 8,500 % fällig am 31.01.2037                                                    | 200             | 10                        | 0,09                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | GSAA Home Equity Trust<br>6,309 % fällig am 25.02.2035                                | 90              | 90                        | 0,86                              | 9,000 % fällig am 31.01.2040                                                    | 1.000           | 49                        | 0,47                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | GSAMP Trust<br>4,574 % fällig am 25.12.2036                                           | 129             | 69                        | 0,66                              | Turkey Government International Bond<br>47,469 % fällig am 06.09.2028           | TRY 1.100       | 26                        | 0,25                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Home Equity Loan Trust<br>4,664 % fällig am 25.04.2037                                | 46              | 45                        | 0,43                              |                                                                                 |                 | 648                       | 6,19                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | HSI Asset Securitization Corp. Trust<br>5,214 % fällig am 25.01.2036                  | 100             | 86                        | 0,82                              | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>                                           |                 |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   | JPMorgan Mortgage Acquisition Trust<br>4,644 % fällig am 25.10.2036                   | 8               | 8                         | 0,08                              |                                                                                 |                 | \$ 9.887                  | 94,50                             |
|                                                              |                 |                           |                                   | Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust<br>5,289 % fällig am 25.03.2034                | 35              | 36                        | 0,35                              | <b>AKTIEN</b>                                                                   |                 |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 | 485                       | 4,64                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                                                          |                 |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   | <b>ABS SONSTIGE</b>                                                                   |                 |                           |                                   | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                        |                 |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   | Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC<br>3,212 % fällig am 16.01.2033         | € 92            | 108                       | 1,03                              | PIMCO Select Funds plc - PIMCO<br>US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (b) | 61.246          | 611                       | 5,84                              |
|                                                              |                 |                           |                                   | Contego CLO DAC<br>2,823 % fällig am 23.01.2030                                       | 99              | 117                       | 1,12                              | <b>BÖRSENGEHADELTE FONDS</b>                                                    |                 |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 |                           |                                   | PIMCO ETFs plc - PIMCO<br>US Dollar Short Maturity<br>UCITS ETF (b)             | 3.800           | 380                       | 3,63                              |
|                                                              |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 |                           |                                   | <b>Summe Investmentfonds</b>                                                    |                 |                           |                                   |
|                                                              |                 |                           |                                   |                                                                                       |                 |                           |                                   |                                                                                 |                 | \$ 991                    | 9,47                              |

## PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent                     | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                                                    | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                            | 4,470 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 1.900           | U.S. Treasury Inflation<br>Protected Securities<br>2,125 % fällig am<br>15.04.2029 | \$ (1.932)                 | \$ 1.900                            | \$ 1.900                                                            | 18,16                        |
|                                | 4,480           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 700                | Ginnie Mae 4,000 % fällig<br>am 20.01.2049                                         | (772)                      | 700                                 | 700                                                                 | 6,69                         |
| <b>Summe Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                    |                                                                                    | \$ (2.704)                 | \$ 2.600                            | \$ 2.600                                                            | 24,85                        |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| E-mini S&P 500 Index September Futures                         | Long  | 09.2025          | 10                      | \$ 95                                           | 0,90                         |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025          | 9                       | 7                                               | 0,07                         |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025          | 15                      | 18                                              | 0,18                         |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025          | 8                       | 9                                               | 0,08                         |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025          | 3                       | (9)                                             | (0,08)                       |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures                 | Long  | 09.2025          | 1                       | 4                                               | 0,04                         |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025          | 1                       | (2)                                             | (0,02)                       |
|                                                                |       |                  |                         | \$ 122                                          | 1,17                         |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |                  |                         | \$ 122                                          | 1,17                         |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Bank of America Corp. | 1,000 %                        | 20.12.2026            | \$ 100                         | \$ 0                                            | 0,00                         |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.06.2030            | \$ 200                         | \$ 4                                            | 0,04                         |
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030            | 3.400                          | 21                                              | 0,20                         |
|                        |                                |                       |                                | \$ 25                                           | 0,24                         |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 862           | \$ 6                                            | 0,06                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 0,740              | 15.02.2027            | \$ 100          | 6                                               | 0,06                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,000              | 16.12.2027            | 300             | (19)                                            | (0,18)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,250              | 17.06.2030            | 100             | (6)                                             | (0,06)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,250              | 16.06.2051            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,277              | 21.07.2031            | 200             | (12)                                            | (0,11)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,750              | 15.06.2032            | 700             | (38)                                            | (0,35)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 2,750              | 21.06.2053            | 100             | 1                                               | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 19.03.2030            | 940             | (26)                                            | (0,25)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 21.06.2030            | 60              | (2)                                             | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 21.06.2033            | 150             | (6)                                             | (0,06)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 21.06.2028            | 200             | (7)                                             | (0,06)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250              | 18.06.2032            | 300             | 2                                               | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,435              | 05.11.2034            | 10              | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.12.2033            | 200             | (6)                                             | (0,06)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 18.12.2054            | 325             | 21                                              | 0,19                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,650              | 31.05.2028            | 300             | (2)                                             | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,655              | 31.05.2028            | 200             | (1)                                             | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,662              | 31.05.2028            | 230             | (2)                                             | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,700              | 20.02.2049            | 125             | 4                                               | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2031            | 200             | (3)                                             | (0,03)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 20.06.2034            | 150             | (1)                                             | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,850              | 08.01.2035            | 100             | 2                                               | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,982              | 30.09.2026            | 400             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,000              | 20.06.2026            | 320             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,000              | 26.02.2035            | 50              | (1)                                             | (0,01)                       |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,046              | 15.11.2052            | 110             | 2                                               | 0,02                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,054              | 15.11.2052            | 120             | 2                                               | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,291             | 02.01.2029            | BRL 300         | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,354             | 02.01.2029            | 700             | 1                                               | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                 | 13,927             | 04.01.2027            | 600             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 7,498              | 28.04.2028            | COP 109.300     | 1                                               | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW           | 4,500              | 20.09.2033            | AUD 200         | 9                                               | 0,09                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW           | 4,500              | 18.06.2035            | 200             | 1                                               | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR             | 3,760              | 01.11.2034            | CZK 200         | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2035            | € 290           | 3                                               | 0,03                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2055            | 120             | 5                                               | 0,04                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,710              | 06.08.2034            | 100             | (3)                                             | (0,03)                       |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt                             | variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                         |                       | 6-Month PLN-WIBOR      | 4,930 %            | 25.07.2029            | PLN 100         | \$ (1)                                          | (0,01)                       |
| Zahlung                                        |                       | 28-Day MXN-TIIE        | 7,760              | 01.03.2029            | MXN 300         | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | 28-Day MXN-TIIE        | 9,000              | 01.03.2029            | 500             | (1)                                             | (0,01)                       |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,503              | 25.03.2030            | \$ 200          | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         |                       | CPURNSA                | 2,520              | 27.03.2030            | 200             | 0                                               | 0,00                         |
|                                                |                       |                        |                    |                       |                 | \$ (71)                                         | (0,68)                       |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                       |                        |                    |                       |                 | \$ (46)                                         | (0,44)                       |

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| BRC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,750 %            | 30.10.2025         | 1.000                          | \$ 5   | \$ 3           | 0,03                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| BRC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 2,830 %            | 30.10.2025         | 1.000                          | \$ (2)  | \$ (1)         | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,290              | 30.10.2025         | 1.000                          | (3)     | (1)            | (0,01)                       |
|            |                                      |                        |                                             |                    |                    |                                | \$ (5)  | \$ (2)         | (0,02)                       |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BOA        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.12.2029            | € 98                           | \$ 19                                    | \$ 2                                            | \$ 21          | 0,21                         |
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000                          | 20.12.2029            | 197                            | 38                                       | 5                                               | 43             | 0,41                         |
| JPM        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000                          | 20.12.2029            | 98                             | 21                                       | 0                                               | 21             | 0,20                         |
|            |                                  |                                |                       |                                | \$ 78                                    | \$ 7                                            | \$ 85          | 0,82                         |

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

#### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier                 | Anzahl der<br>Anteile<br>oder Einheiten | Variable Zinssatz                                    | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------|----------------------------|-----------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------|-----------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BRC        | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 97                                      | 4,920 %                                              | \$ 1.266        | 04.02.2026            | \$ 0                                     | \$ 59                                           | \$ 59          | 0,57                         |
| CIB        | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 74                                      | 4,850                                                | 966             | 02.07.2025            | 0                                        | 45                                              | 45             | 0,43                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 75                                      | 4,820                                                | 979             | 09.07.2025            | 0                                        | 46                                              | 46             | 0,44                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 50                                      | FEDL01 Zinssatz zzgl.<br>eines bestimmten<br>Spreads | 652             | 07.01.2026            | 0                                        | 31                                              | 31             | 0,29                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 87                                      | FEDL01 Zinssatz zzgl.<br>eines bestimmten<br>Spreads | 1.135           | 18.02.2026            | 0                                        | 53                                              | 53             | 0,51                         |
|            | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 111                                     | 4,980                                                | 1.448           | 01.04.2026            | 0                                        | 68                                              | 68             | 0,65                         |
| RBC        | Erhalt             | S&P 500 Total Return Index | 35                                      | 4,940                                                | 457             | 08.04.2026            | 0                                        | 22                                              | 22             | 0,21                         |
|            |                    |                            |                                         |                                                      |                 |                       |                                          | \$ 324                                          | \$ 324         | 3,10                         |

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CNH                    | 192                      | \$ 27                            | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | 7                        | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 19                       | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 315                      | AUD 485                          | 3                                  | 3                                                    | 0,03                         |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | NZD 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | AUD                    | 485                      | \$ 315                           | 0                                  | (3)                                                  | (0,03)                       |
|            | 08.2025               | CNH                    | 245                      | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | NZD                    | 6                        | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 26                       | £ 19                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | 923                      | \$ 1.049                         | 0                                  | (35)                                                 | (0,33)                       |
| BOA        | 07.2025               | \$                     | 13                       | CHF 11                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 2                        | SGD 3                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 3                        | \$ 2                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 3                        | INR 257                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 10                       | TWD 316                          | 1                                  | 1                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               | BRL                    | 264                      | \$ 47                            | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
| BPS        | 07.2025               | THB                    | 7                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TRY                    | 124                      | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 738                      | 23                               | 0                                  | (3)                                                  | (0,03)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 28                       | BRL 158                          | 1                                  | 1                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 44                       | CAD 60                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | IDR 79.073                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 591                      | \$ 82                            | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | CZK                    | 18                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 3.728                    | 115                              | 0                                  | (16)                                                 | (0,14)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 84                       | CNH 599                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BRC        | 08.2025               |                        | 10                       | INR 834                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 102                      | TWD 3.127                        | 8                                  | 8                                                    | 0,06                         |
|            | 07.2025               | ILS                    | 45                       | \$ 13                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 230                      | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TRY                    | 1.191                    | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 601                      | £ 442                            | 4                                  | 4                                                    | 0,04                         |
|            | 07.2025               |                        | 6                        | ILS 22                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | ¥ 37                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 11                       | THB 359                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 27                       | TRY 1.114                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| CBK        | 07.2025               | ZAR                    | 1.011                    | \$ 56                            | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | CZK                    | 176                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | £                      | 442                      | 601                              | 0                                  | (4)                                                  | (0,04)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 18                       | CNH 131                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | PEN                    | 181                      | \$ 49                            | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 11.2025               |                        | 57                       | 16                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | 11                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 16                       | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 94.716                   | 69                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | NOK                    | 30                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 07.2025               | SEK                    | 30                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 371                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 1.194                    | 37                               | 0                                  | (4)                                                  | (0,04)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 38                       | AUD 59                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 26                       | £ 19                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 10                       | IDR 167.616                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | PEN 17                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 14                       | TWD 407                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 83                       | \$ 12                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | COP                    | 21.686                   | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| FAR        | 08.2025               | INR                    | 5.420                    | 63                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | PEN                    | 161                      | 44                               | 0                                  | (2)                                                  | (0,02)                       |
|            | 08.2025               | TWD                    | 2.280                    | 71                               | 0                                  | (9)                                                  | (0,08)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 72                       | INR 6.193                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 4                        | TWD 118                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | PEN                    | 328                      | \$ 89                            | 0                                  | (3)                                                  | (0,03)                       |
|            | 12.2025               |                        | 52                       | 14                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | ILS                    | 22                       | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.081                    | € 932                            | 14                                 | 14                                                   | 0,12                         |
|            | 08.2025               | €                      | 930                      | \$ 1.081                         | 0                                  | (14)                                                 | (0,12)                       |
| FAR        | 08.2025               | \$                     | 33                       | INR 2.874                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | AUD                    | 538                      | \$ 347                           | 0                                  | (6)                                                  | (0,05)                       |
|            | 07.2025               | BRL                    | 513                      | 93                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | CHF                    | 27                       | 33                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | CNH                    | 98                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 10.108                   | 69                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | SGD                    | 1                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 37                       | BRL 210                          | 2                                  | 2                                                    | 0,02                         |
|            | 07.2025               |                        | 20                       | CHF 16                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 140                      | ¥ 20.100                         | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               |                        | 2                        | PLN 8                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 2                        | SGD 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CHF                    | 16                       | \$ 20                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 49                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 2                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
|                                  | 08.2025               | \$                     | 16                       | INR 1.377                        | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 69                       | ¥ 10.071                         | 1                                  | 1                                                    | 0,01                      |
|                                  | 09.2025               | MXN                    | 2.728                    | \$ 140                           | 0                                  | (3)                                                  | (0,03)                    |
|                                  | 09.2025               | \$                     | 93                       | BRL 521                          | 1                                  | 1                                                    | 0,01                      |
|                                  | 11.2025               | PEN                    | 101                      | \$ 28                            | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                    |
| GLM                              | 07.2025               |                        | 17                       | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 2                        | IDR 39.760                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 1                        | SGD 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | SGD                    | 1                        | \$ 1                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 12.2025               | PEN                    | 49                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| IND                              | 07.2025               | \$                     | 3                        | SEK 30                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | SEK                    | 30                       | \$ 3                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| JPM                              | 07.2025               | CNH                    | 185                      | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | KRW                    | 6.791                    | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | NZD                    | 6                        | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | SGD                    | 30                       | 23                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | TWD                    | 762                      | 23                               | 0                                  | (3)                                                  | (0,03)                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 70                       | BRL 408                          | 6                                  | 6                                                    | 0,05                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 5                        | PLN 18                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 1                        | SGD 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | ZAR                    | 287                      | \$ 16                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | CNH                    | 261                      | 36                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | SGD                    | 2                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | TWD                    | 1.010                    | 31                               | 0                                  | (5)                                                  | (0,04)                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 7                        | BRL 40                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 11                       | INR 930                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MBC                              | 08.2025               |                        | 105                      | TWD 3.361                        | 13                                 | 13                                                   | 0,11                      |
|                                  | 07.2025               | AUD                    | 6                        | \$ 4                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | CAD                    | 142                      | 104                              | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                    |
|                                  | 07.2025               | CNH                    | 117                      | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | SGD                    | 72                       | 56                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | THB                    | 186                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | TWD                    | 282                      | 9                                | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 60                       | CAD 82                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 6                        | € 5                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 2                        | IDR 33.389                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 6                        | ¥ 882                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 34                       | SGD 44                           | 1                                  | 1                                                    | 0,01                      |
|                                  | 08.2025               | CAD                    | 82                       | \$ 60                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | CNH                    | 117                      | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | SGD                    | 44                       | 34                               | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                    |
|                                  | 08.2025               | TWD                    | 269                      | 8                                | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 4                        | TWD 116                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MYI                              | 07.2025               | ¥                      | 3.399                    | \$ 23                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 3                        | ¥ 454                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 3                        | NOK 27                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 0                        | PLN 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 33                       | SGD 42                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | CNH                    | 50                       | \$ 7                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | NOK                    | 27                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 23                       | ¥ 3.387                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 09.2025               | COP                    | 99.138                   | \$ 24                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| RBC                              | 09.2025               | \$                     | 25                       | MXN 474                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 5                        | CNH 37                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| RYL                              | 08.2025               | CNH                    | 161                      | \$ 22                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SCX                              | 07.2025               | ILS                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | ¥                      | 2.638                    | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 5                        | € 4                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 11                       | IDR 184.894                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               |                        | 7                        | SGD 9                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | CNH                    | 86                       | \$ 12                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | SGD                    | 9                        | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | TWD                    | 161                      | 5                                | 0                                  | (1)                                                  | (0,01)                    |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 83                       | CNH 599                          | 1                                  | 1                                                    | 0,01                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 11                       | INR 964                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 0                        | ¥ 38                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SOG                              | 07.2025               | ¥                      | 5.610                    | \$ 39                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 3                        | IDR 48.987                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 0                        | INR 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 39                       | ¥ 5.590                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 18                       | TWD 574                          | 2                                  | 2                                                    | 0,02                      |
|                                  | 09.2025               | MXN                    | 213                      | \$ 11                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SSB                              | 07.2025               | £                      | 426                      | 576                              | 0                                  | (7)                                                  | (0,07)                    |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 32                       | KRW 43.425                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 10.2025               | PEN                    | 35                       | \$ 10                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| UAG                              | 07.2025               | ILS                    | 3                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | THB                    | 30                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 2                        | ¥ 296                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               |                        | 27                       | CNH 197                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 09.2025               |                        | 11                       | MXN 208                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 58                            | \$ (134)                           | \$ (76)                                              | (0,73)                    |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 334                                               | 3,20                      |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|-----------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|------------------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                          |                 |                           |                              |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>3,500 % fällig am 01.08.2055 | \$ 600          | \$ (540)                  | (5,16)                       |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere                                       |                 | \$ (540)                  | (5,16)                       |
| Summe Anlagen                                                         |                 | \$ 13.348                 | 127,59                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                           |                 | \$ (2.886)                | (27,59)                      |
| Nettovermögen                                                         |                 | \$ 10.462                 | 100,00                       |

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 580 USD (31. Dezember 2024: 457 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 9.887                                                        | \$ 0                                                         | \$ 9.887  |
| Investmentfonds               | 991                                                                         | 0                                                               | 0                                                            | 991       |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 2.600                                                           | 0                                                            | 2.600     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 95                                                                          | 315                                                             | 0                                                            | 410       |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (540)                                                           | 0                                                            | (540)     |
| Summen                        | \$ 1.086                                                                    | \$ 12.262                                                       | \$ 0                                                         | \$ 13.348 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 8.137                                                        | \$ 0                                                         | \$ 8.137  |
| Investmentfonds               | 601                                                                         | 380                                                             | 0                                                            | 981       |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 2.400                                                           | 0                                                            | 2.400     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (41)                                                                        | 59                                                              | 0                                                            | 18        |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (675)                                                           | 0                                                            | (675)     |
| Summen                        | \$ 560                                                                      | \$ 10.301                                                       | \$ 0                                                         | \$ 10.861 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ k. A.                            | \$ k. A.                              | \$ k. A.                            | \$ (1)                              | \$ 0                                  | \$ (1)                              |
| BOA        | (13)                                | 0                                     | (13)                                | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| BPS        | 31                                  | 0                                     | 31                                  | 1                                   | 0                                     | 1                                   |
| BRC        | 57                                  | (50)                                  | 7                                   | 22                                  | 0                                     | 22                                  |
| CBK        | (20)                                | 0                                     | (20)                                | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 |
| CIB        | 243                                 | (30)                                  | 213                                 | (31)                                | 0                                     | (31)                                |
| DUB        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 9                                   | 0                                     | 9                                   |
| GLM        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 4                                   | 0                                     | 4                                   |
| FAR        | (10)                                | 0                                     | (10)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| JPM        | 32                                  | 0                                     | 32                                  | 19                                  | 0                                     | 19                                  |
| MBC        | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 | 34                                  | 0                                     | 34                                  |
| RBC        | 22                                  | 0                                     | 22                                  | (4)                                 | 0                                     | (4)                                 |
| SCX        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 1                                   | 0                                     | 1                                   |
| SOG        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SSB        | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 12,43             | 14,41             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 32,76             | 35,69             |
| Investmentfonds                                                        | 4,53              | 6,04              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 11,88             | 14,78             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,61              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,42              | 0,45              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,15              | 0,63              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 35,22             | 28,00             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 3,90              | 3,89              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 48,76             | 30,56             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 6,12              | 6,07              |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 8,28              | 8,70              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 21,25             | 19,03             |
| Staatsemissionen                                                                       | 6,19              | 5,64              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | k. A.             | 6,52              |
| Investmentfonds                                                                        | 9,47              | 9,70              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 24,85             | 23,72             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 1,17              | (0,69)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,24              | 0,03              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,68)            | 0,32              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,03              | 0,03              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,02)            | (0,05)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,82              | 0,20              |
| Total Return Swaps auf Indizes                                                         | 3,10              | (0,38)            |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,73)            | 0,72              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (5,16)            | (6,67)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (27,59)           | (7,34)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

Halbiahresbericht | 30. Juni 2025 789

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC</b> |                |                          |                                   |
| 2,950 % fällig am 27.01.2029 \$         | 5.100          | \$ 3.646                 | 0,15                              |
| <b>Pacific Gas &amp; Electric Co.</b>   |                |                          |                                   |
| 2,100 % fällig am 01.08.2027            | 5.100          | 4.832                    | 0,20                              |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026            | 1.154          | 1.139                    | 0,05                              |
| 3,250 % fällig am 01.06.2031            | 2.460          | 2.209                    | 0,09                              |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027            | 324            | 317                      | 0,01                              |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027            | 6.700          | 6.484                    | 0,27                              |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028            | 1.102          | 1.070                    | 0,04                              |
| 4,200 % fällig am 01.03.2029            | 1.000          | 976                      | 0,04                              |
| 5,450 % fällig am 15.06.2027            | 7.300          | 7.388                    | 0,30                              |
| 6,100 % fällig am 15.01.2029            | 4.500          | 4.664                    | 0,19                              |
| <b>Rio Oil Finance Trust</b>            |                |                          |                                   |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028            | 139            | 145                      | 0,01                              |
| <b>Southern California Edison Co.</b>   |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 01.02.2032            | 300            | 259                      | 0,01                              |
| 5,950 % fällig am 01.11.2032            | 2.900          | 2.979                    | 0,12                              |
| <b>Southern Gas Corridor CJSC</b>       |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026            | 4.000          | 4.057                    | 0,17                              |
|                                         |                | 48.334                   | 1,98                              |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel  |                | 294.066                  | 12,04                             |

## KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL

|                                                                                |     |     |      |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----|-----|------|
| <b>Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010</b>            |     |     |      |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035                                                   | 23  | 24  | 0,00 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035                                                   | 12  | 13  | 0,00 |
| <b>New York City, New York General Obligation Bonds, Series 2025</b>           |     |     |      |
| 6,291 % fällig am 01.02.2045                                                   | 100 | 105 | 0,01 |
| 6,385 % fällig am 01.02.2055                                                   | 420 | 437 | 0,02 |
| <b>Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010</b> |     |     |      |
| 6,125 % fällig am 01.07.2040 ^                                                 | 200 | 97  | 0,00 |
|                                                                                |     | 676 | 0,03 |

## US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

|                                              |         |           |       |
|----------------------------------------------|---------|-----------|-------|
| <b>Fannie Mae</b>                            |         |           |       |
| 1,580 % fällig am 25.11.2049 (a)             | 92      | 12        | 0,00  |
| 3,230 % fällig am 25.07.2033 (a)             | 27      | 3         | 0,00  |
| <b>Freddie Mac</b>                           |         |           |       |
| 2,132 % fällig am 15.06.2042 (a)             | 32      | 5         | 0,00  |
| 4,750 % fällig am 25.08.2057                 | 9.146   | 8.871     | 0,36  |
| <b>Ginnie Mae</b>                            |         |           |       |
| 3,500 % fällig am 20.03.2055 - 20.06.2055    | 39.500  | 35.989    | 1,47  |
| 4,500 % fällig am 20.07.2040 - 20.07.2043    | 8.185   | 8.109     | 0,33  |
| <b>Ginnie Mae, TBA</b>                       |         |           |       |
| 3,000 % fällig am 01.08.2055                 | 68.200  | 60.319    | 2,47  |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055                 | 9.800   | 8.911     | 0,37  |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055                 | 29.200  | 27.154    | 1,11  |
| 4,500 % fällig am 01.07.2055                 | 8.800   | 8.425     | 0,35  |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055                 | 1.100   | 1.080     | 0,04  |
| 5,500 % fällig am 01.07.2055                 | 600     | 601       | 0,02  |
| 6,500 % fällig am 01.08.2055                 | 31.100  | 31.869    | 1,31  |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security</b>      |         |           |       |
| 3,000 % fällig am 01.03.2050 - 01.05.2052    | 1.252   | 1.089     | 0,05  |
| 3,500 % fällig am 01.04.2048 - 01.02.2050    | 433     | 396       | 0,02  |
| 4,000 % fällig am 01.08.2039 - 01.05.2047    | 975     | 942       | 0,04  |
| 5,000 % fällig am 01.11.2054                 | 27.660  | 27.133    | 1,11  |
| <b>Uniform Mortgage-Backed Security, TBA</b> |         |           |       |
| 3,000 % fällig am 01.07.2040 - 01.08.2055    | 229.200 | 198.604   | 8,13  |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055                 | 12.150  | 10.940    | 0,45  |
| 4,000 % fällig am 01.08.2055                 | 32.800  | 30.496    | 1,25  |
| 4,500 % fällig am 01.08.2055                 | 10.100  | 9.657     | 0,40  |
| 5,000 % fällig am 01.08.2055                 | 238.174 | 233.294   | 9,55  |
| 5,500 % fällig am 01.07.2055 - 01.08.2055    | 21.175  | 21.167    | 0,87  |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                 | 342.025 | 347.259   | 14,22 |
| 6,500 % fällig am 01.08.2055                 | 117.475 | 121.130   | 4,96  |
| 7,000 % fällig am 01.08.2055 - 01.09.2055    | 4.950   | 5.191     | 0,21  |
|                                              |         | 1.198.646 | 49,09 |

| BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>US-SCHATZ Obligationen</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)</b> |                |                          |                                   |
| 0,125 % fällig am 15.04.2026                            | \$ 17.735      | \$ 17.539                | 0,72                              |
| 0,125 % fällig am 15.01.2031                            | 123            | 114                      | 0,01                              |
| 0,125 % fällig am 15.07.2031                            | 120            | 110                      | 0,00                              |
| 0,625 % fällig am 15.07.2032                            | 3.312          | 3.091                    | 0,13                              |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042                            | 142            | 110                      | 0,00                              |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047                            | 1.329          | 964                      | 0,04                              |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046                            | 20.306         | 15.400                   | 0,63                              |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049                            | 4.092          | 2.972                    | 0,12                              |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033                            | 48.372         | 46.998                   | 1,92                              |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044                            | 138            | 116                      | 0,01                              |
| 1,750 % fällig am 15.01.2034                            | 1.252          | 1.242                    | 0,05                              |
| 1,875 % fällig am 15.07.2034                            | 28.725         | 28.764                   | 1,18                              |
| 2,125 % fällig am 15.04.2029                            | 32.666         | 33.553                   | 1,37                              |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041                            | 146            | 143                      | 0,01                              |
| 2,375 % fällig am 15.10.2028                            | 36.549         | 37.919                   | 1,55                              |
|                                                         |                | 189.035                  | 7,74                              |

## NON-AGENCY-MBS

|                                                             |          |       |      |
|-------------------------------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>Adjustable Rate Mortgage Trust</b>                       |          |       |      |
| 5,423 % fällig am 25.04.2035                                | 21       | 21    | 0,00 |
| <b>American Home Mortgage Assets Trust</b>                  |          |       |      |
| 5,319 % fällig am 25.11.2046                                | 4.391    | 1.066 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 25.11.2046                                | 42       | 38    | 0,00 |
| <b>American Home Mortgage Investment Trust</b>              |          |       |      |
| 6,460 % fällig am 25.12.2035                                | 9.129    | 3.059 | 0,13 |
| <b>Avon Finance PLC</b>                                     |          |       |      |
| 5,139 % fällig am 28.12.2049                                | £ 2.181  | 2.994 | 0,12 |
| <b>Banc of America Funding Corp.</b>                        |          |       |      |
| 4,460 % fällig am 25.09.2048                                | \$ 1.328 | 1.250 | 0,05 |
| <b>Banc of America Funding Trust</b>                        |          |       |      |
| 4,011 % fällig am 20.05.2036                                | 33       | 28    | 0,00 |
| <b>Banc of America Merrill Lynch Trust</b>                  |          |       |      |
| 2,848 % fällig am 14.08.2034                                | 5.100    | 4.334 | 0,18 |
| <b>BCAP LLC Trust</b>                                       |          |       |      |
| 4,466 % fällig am 26.03.2037                                | 154      | 154   | 0,01 |
| 5,734 % fällig am 25.09.2047                                | 147      | 131   | 0,01 |
| <b>Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust</b>          |          |       |      |
| 3,805 % fällig am 25.07.2036                                | 389      | 336   | 0,01 |
| <b>Bear Stearns ALT-A Trust</b>                             |          |       |      |
| 4,328 % fällig am 25.09.2047                                | 4.776    | 2.320 | 0,10 |
| 4,954 % fällig am 25.11.2035                                | 1.388    | 1.296 | 0,05 |
| 6,159 % fällig am 25.07.2034                                | 435      | 484   | 0,02 |
| <b>Bear Stearns Mortgage Funding Trust</b>                  |          |       |      |
| 4,874 % fällig am 25.08.2036                                | 767      | 721   | 0,03 |
| <b>Bletchley Park Funding PLC</b>                           |          |       |      |
| 5,094 % fällig am 27.07.2070                                | £ 959    | 1.321 | 0,05 |
| <b>Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates</b> |          |       |      |
| 4,634 % fällig am 25.01.2036                                | \$ 341   | 325   | 0,01 |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                  |          |       |      |
| 4,783 % fällig am 25.09.2037                                | 39       | 36    | 0,00 |
| <b>CitiMortgage Alternative Loan Trust</b>                  |          |       |      |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036                                | 158      | 141   | 0,01 |
| <b>Commercial Mortgage Trust</b>                            |          |       |      |
| 3,140 % fällig am 10.10.2036                                | 1.800    | 1.674 | 0,07 |
| <b>Countrywide Alternative Loan Trust</b>                   |          |       |      |
| 4,400 % fällig am 25.06.2037                                | 288      | 274   | 0,01 |
| 4,668 % fällig am 25.03.2047                                | 1.482    | 1.168 | 0,05 |
| 4,714 % fällig am 25.06.2037                                | 1.471    | 1.341 | 0,05 |
| 4,754 % fällig am 25.02.2047                                | 46       | 45    | 0,00 |
| 4,934 % fällig am 25.05.2035                                | 1.435    | 1.076 | 0,04 |
| 5,034 % fällig am 25.08.2035                                | 505      | 478   | 0,02 |
| 5,072 % fällig am 20.12.2035                                | 79       | 75    | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035                                | 1.673    | 1.191 | 0,05 |
| 5,734 % fällig am 25.10.2035                                | 274      | 189   | 0,01 |
| 5,894 % fällig am 25.11.2035                                | 2.838    | 2.640 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037                                | 242      | 121   | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037                                | 105      | 54    | 0,00 |
| 6,109 % fällig am 20.11.2035                                | 1.119    | 964   | 0,04 |
| <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>    |          |       |      |
| 4,914 % fällig am 25.04.2036                                | 256      | 228   | 0,01 |
| <b>Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust</b>    |          |       |      |
| 4,607 % fällig am 25.11.2037                                | 61       | 58    | 0,00 |
| 5,014 % fällig am 25.04.2035                                | 1.266    | 1.207 | 0,05 |
| 5,034 % fällig am 25.05.2035                                | 111      | 97    | 0,00 |
| 5,094 % fällig am 25.02.2035                                | 465      | 375   | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036                                | 65       | 31    | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037                                | 95       | 38    | 0,00 |

| BESCHREIBUNG                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust           |                |                          |                                   |
| 4,744 % fällig am 25.01.2034                             | \$ 503         | \$ 454                   | 0,02                              |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034                             | 123            | 120                      | 0,00                              |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates              |                |                          |                                   |
| 3,241 % fällig am 30.11.2037                             | 3.303          | 3.020                    | 0,12                              |
| Dilosk RMBS DAC                                          |                |                          |                                   |
| 2,786 % fällig am 24.09.2060                             | € 27.731       | 32.546                   | 1,33                              |
| 3,049 % fällig am 20.10.2062                             | 2.003          | 2.361                    | 0,10                              |
| Domi BV                                                  |                |                          |                                   |
| 2,605 % fällig am 15.06.2053                             | 3.643          | 4.278                    | 0,18                              |
| 3,263 % fällig am 15.02.2055                             | 926            | 1.097                    | 0,04                              |
| Downey Savings & Loan Association Mortgage<br>Loan Trust |                |                          |                                   |
| 4,622 % fällig am 19.10.2036                             | \$ 75          | 68                       | 0,00                              |
| Dutch Property Finance BV                                |                |                          |                                   |
| 2,911 % fällig am 28.10.2059                             | € 1.178        | 1.384                    | 0,06                              |
| 3,061 % fällig am 28.04.2062                             | 1.000          | 1.179                    | 0,05                              |
| Edenbrook Mortgage Funding PLC                           |                |                          |                                   |
| 5,109 % fällig am 22.03.2057                             | £ 2.668        | 3.665                    | 0,15                              |
| EMF-UK PLC                                               |                |                          |                                   |
| 5,338 % fällig am 13.03.2046                             | 856            | 1.173                    | 0,05                              |
| Eurosail PLC                                             |                |                          |                                   |
| 5,058 % fällig am 13.09.2045                             | 1.613          | 2.193                    | 0,09                              |
| 5,308 % fällig am 13.06.2045                             | 492            | 674                      | 0,03                              |
| GreenPoint Mortgage Funding Trust                        |                |                          |                                   |
| 4,674 % fällig am 25.10.2045                             | \$ 438         | 426                      | 0,02                              |
| 4,834 % fällig am 25.10.2046                             | 329            | 311                      | 0,01                              |
| Grifonas Finance PLC                                     |                |                          |                                   |
| 2,669 % fällig am 28.08.2039                             | € 121          | 138                      | 0,01                              |
| GS Mortgage Securities Corp. Trust                       |                |                          |                                   |
| 3,055 % fällig am 26.04.2037                             | \$ 7.355       | 1.683                    | 0,07                              |
| 3,721 % fällig am 10.02.2037                             | 28.400         | 27.410                   | 1,12                              |
| GSMPS Mortgage Loan Trust                                |                |                          |                                   |
| 4,784 % fällig am 25.03.2035                             | 1.608          | 1.509                    | 0,06                              |
| 7,056 % fällig am 20.10.2032                             | 950            | 890                      | 0,04                              |
| GSR Mortgage Loan Trust                                  |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036                             | 2.047          | 568                      | 0,02                              |
| HarborView Mortgage Loan Trust                           |                |                          |                                   |
| 4,842 % fällig am 19.12.2036                             | 480            | 377                      | 0,02                              |
| 4,852 % fällig am 19.11.2036                             | 3.364          | 3.082                    | 0,13                              |
| 6,399 % fällig am 19.10.2035                             | 74             | 35                       | 0,00                              |
| HomeBanc Mortgage Trust                                  |                |                          |                                   |
| 4,645 % fällig am 25.04.2037                             | 12             | 12                       | 0,00                              |
| Impac CMB Trust                                          |                |                          |                                   |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                             | 35             | 34                       | 0,00                              |
| IndyMac Mortgage Loan Trust                              |                |                          |                                   |
| 3,612 % fällig am 25.08.2037                             | 2.559          | 1.676                    | 0,07                              |
| 4,154 % fällig am 25.06.2036                             | 1.477          | 1.246                    | 0,05                              |
| 4,794 % fällig am 25.02.2037                             | 69             | 63                       | 0,00                              |
| 5,014 % fällig am 25.01.2036                             | 466            | 313                      | 0,01                              |
| Jeronimo Funding DAC                                     |                |                          |                                   |
| 3,408 % fällig am 25.10.2064                             | € 7.394        | 8.694                    | 0,36                              |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust      |                |                          |                                   |
| 4,248 % fällig am 05.07.2033                             | \$ 1.000       | 950                      | 0,04                              |
| 5,505 % fällig am 05.07.2033                             | 510            | 498                      | 0,02                              |
| JPMorgan Mortgage Trust                                  |                |                          |                                   |
| 4,881 % fällig am 25.08.2036                             | 26             | 20                       | 0,00                              |
| 5,531 % fällig am 25.01.2037                             | 64             | 54                       | 0,00                              |
| Jubilee Place BV                                         |                |                          |                                   |
| 2,724 % fällig am 18.09.2062                             | € 13.245       | 15.557                   | 0,64                              |
| Lehman XS Trust                                          |                |                          |                                   |
| 4,934 % fällig am 25.08.2037                             | \$ 1.177       | 1.156                    | 0,05                              |
| London Wall Mortgage Capital PLC                         |                |                          |                                   |
| 5,227 % fällig am 15.05.2057                             | £ 19.167       | 26.357                   | 1,08                              |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                    |                |                          |                                   |
| 5,534 % fällig am 25.09.2037                             | \$ 7.006       | 2.804                    | 0,11                              |
| Merrion Square Residential DAC                           |                |                          |                                   |
| 2,999 % fällig am 24.03.2081                             | € 2.528        | 2.971                    | 0,12                              |
| Mill City Mortgage Loan Trust                            |                |                          |                                   |
| 3,953 % fällig am 25.11.2058                             | \$ 7.400       | 6.245                    | 0,26                              |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust                       |                |                          |                                   |
| 4,694 % fällig am 25.04.2035                             | 39             | 38                       | 0,00                              |
| Mortgage Equity Conversion Asset Trust                   |                |                          |                                   |
| 10,000 % fällig am 25.05.2042                            | 41             | 34                       | 0,00                              |
| Mortimer BTL PLC                                         |                |                          |                                   |
| 5,409 % fällig am 22.12.2056                             | £ 708          | 975                      | 0,04                              |



| BESCHREIBUNG                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>New Residential Mortgage Loan Trust</b>                        |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058                                      | \$ 813         | \$ 797                   | 0,03                              |
| <b>Polaris PLC</b>                                                |                |                          |                                   |
| 5,014 % fällig am 23.12.2058                                      | £ 472          | 648                      | 0,03                              |
| 5,044 % fällig am 26.02.2068                                      | 4.966          | 6.815                    | 0,28                              |
| 5,524 % fällig am 23.05.2059                                      | 4.271          | 5.856                    | 0,24                              |
| <b>Primrose Residential DAC</b>                                   |                |                          |                                   |
| 3,399 % fällig am 24.10.2061                                      | € 2.042        | 2.398                    | 0,10                              |
| <b>RBSGC Mortgage Loan Trust</b>                                  |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037                                      | \$ 13          | 11                       | 0,00                              |
| <b>Residential Accredited Loans, Inc. Trust</b>                   |                |                          |                                   |
| 4,814 % fällig am 25.09.2036                                      | 2.899          | 2.664                    | 0,11                              |
| 5,397 % fällig am 25.10.2037                                      | 280            | 226                      | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036                                      | 70             | 58                       | 0,00                              |
| <b>RMAC PLC</b>                                                   |                |                          |                                   |
| 5,437 % fällig am 15.02.2047                                      | £ 868          | 1.194                    | 0,05                              |
| <b>Sandwell Commercial Finance PLC</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,854 % fällig am 30.09.2037                                      | 20             | 11                       | 0,00                              |
| <b>Stratton Mortgage Funding PLC</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,139 % fällig am 28.06.2050                                      | 3.001          | 4.116                    | 0,17                              |
| <b>Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust</b>             |                |                          |                                   |
| 4,605 % fällig am 25.09.2035                                      | \$ 44          | 27                       | 0,00                              |
| 5,799 % fällig am 25.05.2035                                      | 102            | 81                       | 0,00                              |
| <b>Structured Asset Mortgage Investments Trust</b>                |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.08.2036                                      | 4.018          | 2.921                    | 0,12                              |
| <b>Towd Point Mortgage Funding PLC</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,223 % fällig am 20.07.2053                                      | £ 1.004        | 1.379                    | 0,06                              |
| 5,474 % fällig am 20.04.2051                                      | 2.106          | 2.890                    | 0,12                              |
| 5,774 % fällig am 20.04.2051                                      | 1.264          | 1.735                    | 0,07                              |
| 6,474 % fällig am 20.04.2051                                      | 1.053          | 1.446                    | 0,06                              |
| 7,474 % fällig am 20.04.2051                                      | 843            | 1.156                    | 0,05                              |
| 8,474 % fällig am 20.04.2051                                      | 526            | 722                      | 0,03                              |
| <b>Tower Bridge Funding PLC</b>                                   |                |                          |                                   |
| 5,798 % fällig am 20.10.2064                                      | 4.925          | 6.753                    | 0,28                              |
| <b>Twin Bridges PLC</b>                                           |                |                          |                                   |
| 5,417 % fällig am 15.05.2056                                      | 507            | 698                      | 0,03                              |
| <b>Vecht Residential BV</b>                                       |                |                          |                                   |
| 3,060 % fällig am 22.05.2058                                      | € 988          | 1.164                    | 0,05                              |
| <b>WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 4,068 % fällig am 25.12.2046                                      | \$ 1.668       | 1.426                    | 0,06                              |
| 4,152 % fällig am 25.02.2037                                      | 29             | 27                       | 0,00                              |
| 4,290 % fällig am 25.05.2046                                      | 3.127          | 2.931                    | 0,12                              |
| 5,014 % fällig am 25.07.2045                                      | 536            | 528                      | 0,02                              |
| 5,234 % fällig am 25.06.2044                                      | 236            | 235                      | 0,01                              |
| 5,334 % fällig am 25.10.2045                                      | 4.306          | 3.728                    | 0,15                              |
| 5,447 % fällig am 25.08.2046                                      | 7.910          | 6.795                    | 0,28                              |
| <b>Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust</b> |                |                          |                                   |
| 4,884 % fällig am 25.05.2035                                      | 234            | 197                      | 0,01                              |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036                                      | 642            | 544                      | 0,02                              |
| <b>Wells Fargo Alternative Loan Trust</b>                         |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 25.07.2037                                      | 767            | 671                      | 0,03                              |
| <b>Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust</b>               |                |                          |                                   |
| 7,379 % fällig am 25.10.2036                                      | 8              | 8                        | 0,00                              |
| <b>Winchester PLC</b>                                             |                |                          |                                   |
| 5,188 % fällig am 21.10.2056                                      | £ 5.133        | 7.046                    | 0,29                              |
|                                                                   |                | 263.619                  | 10,80                             |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE****AUTOMOBILE ABS SONSTIGE**

|                                          |            |        |      |
|------------------------------------------|------------|--------|------|
| <b>Angle Asset Finance Radian Trust</b>  |            |        |      |
| 4,952 % fällig am 16.03.2033             | AUD 24.000 | 15.731 | 0,64 |
| <b>Auto1 Car Funding SARL</b>            |            |        |      |
| 2,592 % fällig am 15.12.2033             | € 322      | 378    | 0,01 |
| <b>Driver Australia Ten Trust</b>        |            |        |      |
| 4,843 % fällig am 21.02.2033             | AUD 3.659  | 2.402  | 0,10 |
| <b>Flexicommercial ABS Trust</b>         |            |        |      |
| 4,876 % fällig am 14.06.2031             | 14.000     | 9.175  | 0,38 |
| <b>FTA Santander Consumer Spain Auto</b> |            |        |      |
| 2,886 % fällig am 22.09.2039             | € 8.525    | 10.063 | 0,41 |
| <b>Golden Bar Securitisation SRL</b>     |            |        |      |
| 4,936 % fällig am 22.09.2043             | 1.184      | 1.421  | 0,06 |
|                                          |            | 39.170 | 1,60 |

| BESCHREIBUNG                                                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>AUTOMOBILE SEQUENTIELL</b>                                                     |                |                          |                                   |
| <b>Harley Marine Financing LLC</b>                                                |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 15.12.2027                                                      | \$ 38          | \$ 39                    | 0,00                              |
| 9,750 % fällig am 15.12.2027                                                      | 38             | 38                       | 0,00                              |
|                                                                                   |                | 77                       | 0,00                              |
| <b>HYPOTHEKEN SONSTIGE</b>                                                        |                |                          |                                   |
| <b>Aames Mortgage Investment Trust</b>                                            |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.10.2035                                                      | 119            | 118                      | 0,01                              |
| <b>Accredited Mortgage Loan Trust</b>                                             |                |                          |                                   |
| 4,704 % fällig am 25.09.2036                                                      | 16.826         | 16.055                   | 0,66                              |
| 4,894 % fällig am 25.12.2035                                                      | 2.500          | 2.016                    | 0,08                              |
| 5,304 % fällig am 25.09.2035                                                      | 1.836          | 1.766                    | 0,07                              |
| <b>ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>                                |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.04.2036                                                      | 131            | 127                      | 0,01                              |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                      | 225            | 75                       | 0,00                              |
| 4,914 % fällig am 25.04.2036                                                      | 5.578          | 5.159                    | 0,21                              |
| <b>Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates</b>     |                |                          |                                   |
| 5,079 % fällig am 25.12.2035                                                      | 2.113          | 1.987                    | 0,08                              |
| 5,434 % fällig am 25.03.2035                                                      | 314            | 299                      | 0,01                              |
| <b>Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   |
| 5,409 % fällig am 25.09.2035                                                      | 1.635          | 1.441                    | 0,06                              |
| <b>Argent Securities Trust</b>                                                    |                |                          |                                   |
| 4,654 % fällig am 25.05.2036                                                      | 293            | 71                       | 0,00                              |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                                      | 4.368          | 3.925                    | 0,16                              |
| <b>Asset-Backed Pass-Through Certificates Series</b>                              |                |                          |                                   |
| 5,409 % fällig am 25.07.2035                                                      | 3.990          | 3.794                    | 0,16                              |
| <b>Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust</b>                       |                |                          |                                   |
| 5,394 % fällig am 25.11.2035                                                      | 1.670          | 1.450                    | 0,06                              |
| <b>Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| 5,484 % fällig am 25.08.2037                                                      | 143            | 128                      | 0,01                              |
| <b>Carrington Mortgage Loan Trust</b>                                             |                |                          |                                   |
| 5,034 % fällig am 25.01.2036                                                      | 6.295          | 6.148                    | 0,25                              |
| 5,484 % fällig am 25.05.2035                                                      | 1.160          | 1.125                    | 0,05                              |
| <b>CIT Mortgage Loan Trust</b>                                                    |                |                          |                                   |
| 6,684 % fällig am 25.10.2037                                                      | 358            | 361                      | 0,02                              |
| <b>Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.</b>                                        |                |                          |                                   |
| 4,316 % fällig am 25.10.2037                                                      | 679            | 596                      | 0,02                              |
| <b>Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.</b>                          |                |                          |                                   |
| 4,684 % fällig am 25.02.2036                                                      | 76             | 73                       | 0,00                              |
| 4,694 % fällig am 25.12.2036                                                      | 1.660          | 1.522                    | 0,06                              |
| 4,714 % fällig am 25.04.2047                                                      | 123            | 120                      | 0,01                              |
| 4,874 % fällig am 25.09.2037                                                      | 38             | 40                       | 0,00                              |
| 4,934 % fällig am 25.10.2034                                                      | 2.862          | 2.820                    | 0,12                              |
| 4,934 % fällig am 25.11.2047                                                      | 4.825          | 4.406                    | 0,18                              |
| 4,954 % fällig am 25.09.2046                                                      | 220            | 213                      | 0,01                              |
| 5,505 % fällig am 25.07.2035                                                      | 884            | 873                      | 0,04                              |
| <b>Ellington Loan Acquisition Trust</b>                                           |                |                          |                                   |
| 5,534 % fällig am 25.05.2037                                                      | 62             | 61                       | 0,00                              |
| <b>Fieldstone Mortgage Investment Trust</b>                                       |                |                          |                                   |
| 4,679 % fällig am 25.11.2036                                                      | 1.635          | 1.020                    | 0,04                              |
| <b>Fremont Home Loan Trust</b>                                                    |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.01.2037                                                      | 353            | 183                      | 0,01                              |
| 4,584 % fällig am 25.01.2037                                                      | 1.361          | 621                      | 0,03                              |
| 5,499 % fällig am 25.06.2035                                                      | 338            | 334                      | 0,01                              |
| <b>GSAA Home Equity Trust</b>                                                     |                |                          |                                   |
| 4,534 % fällig am 25.09.2036                                                      | 13.933         | 3.107                    | 0,13                              |
| 4,534 % fällig am 25.12.2046                                                      | 839            | 406                      | 0,02                              |
| 5,034 % fällig am 25.03.2037                                                      | 170            | 67                       | 0,00                              |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036                                                      | 1.090          | 244                      | 0,01                              |
| <b>GSAMP Trust</b>                                                                |                |                          |                                   |
| 4,804 % fällig am 25.03.2047                                                      | 8.522          | 6.516                    | 0,27                              |
| <b>Home Equity Asset Trust</b>                                                    |                |                          |                                   |
| 5,109 % fällig am 25.02.2036                                                      | 173            | 169                      | 0,01                              |
| 5,379 % fällig am 25.12.2035                                                      | 780            | 754                      | 0,03                              |
| <b>Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust</b>                               |                |                          |                                   |
| 4,554 % fällig am 25.04.2037                                                      | 1.725          | 1.220                    | 0,05                              |
| 4,594 % fällig am 25.11.2036                                                      | 2.679          | 2.427                    | 0,10                              |
| 4,604 % fällig am 25.04.2037                                                      | 1.640          | 1.160                    | 0,05                              |
| <b>HSI Asset Securitization Corp. Trust</b>                                       |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.01.2037                                                      | 4.432          | 3.354                    | 0,14                              |
| 4,774 % fällig am 25.12.2036                                                      | 24.589         | 5.884                    | 0,24                              |
| <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.</b>                                        |                |                          |                                   |
| 5,019 % fällig am 25.05.2035                                                      | 900            | 893                      | 0,04                              |
| 5,184 % fällig am 25.06.2035                                                      | 961            | 950                      | 0,04                              |

| BESCHREIBUNG                                                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>JPMorgan Mortgage Acquisition Trust</b>                                |                |                          |                                   |
| 4,644 % fällig am 25.10.2036                                              | \$ 30          | \$ 30                    | 0,00                              |
| 4,704 % fällig am 25.07.2036                                              | 3.026          | 2.738                    | 0,11                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                                              | 11.800         | 11.478                   | 0,47                              |
| <b>Long Beach Mortgage Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   |
| 4,794 % fällig am 25.03.2046                                              | 2.588          | 2.026                    | 0,08                              |
| 5,034 % fällig am 25.01.2036                                              | 2.241          | 2.069                    | 0,08                              |
| <b>MASTR Asset-Backed Securities Trust</b>                                |                |                          |                                   |
| 4,954 % fällig am 25.06.2036                                              | 1.254          | 1.169                    | 0,05                              |
| 5,214 % fällig am 25.02.2034                                              | 992            | 1.014                    | 0,04                              |
| <b>Merrill Lynch Mortgage Investors Trust</b>                             |                |                          |                                   |
| 4,734 % fällig am 25.08.2037                                              | 678            | 646                      | 0,03                              |
| <b>Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust</b>                             |                |                          |                                   |
| 3,829 % fällig am 25.01.2035                                              | 810            | 741                      | 0,03                              |
| 4,544 % fällig am 25.02.2037                                              | 1.176          | 512                      | 0,02                              |
| 4,584 % fällig am 25.02.2037                                              | 2.040          | 888                      | 0,04                              |
| 4,684 % fällig am 25.07.2036                                              | 109            | 99                       | 0,00                              |
| 4,684 % fällig am 25.03.2037                                              | 7.582          | 3.231                    | 0,13                              |
| 4,734 % fällig am 25.07.2036                                              | 243            | 89                       | 0,00                              |
| 4,934 % fällig am 25.04.2036                                              | 1.715          | 1.638                    | 0,07                              |
| <b>Morgan Stanley Home Equity Loan Trust</b>                              |                |                          |                                   |
| 4,534 % fällig am 25.04.2037                                              | 91             | 47                       | 0,00                              |
| <b>Morgan Stanley Mortgage Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| 6,077 % fällig am 25.10.2046                                              | 3.834          | 893                      | 0,04                              |
| <b>New Century Home Equity Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| 5,214 % fällig am 25.03.2035                                              | 72             | 71                       | 0,00                              |
| 5,409 % fällig am 25.06.2035                                              | 3.383          | 3.333                    | 0,14                              |
| 6,459 % fällig am 25.05.2034                                              | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>NovaStar Mortgage Funding Trust</b>                                    |                |                          |                                   |
| 4,634 % fällig am 25.09.2037                                              | 86             | 84                       | 0,00                              |
| <b>Option One Mortgage Loan Trust</b>                                     |                |                          |                                   |
| 4,574 % fällig am 25.03.2037                                              | 136            | 125                      | 0,01                              |
| 4,654 % fällig am 25.04.2037                                              | 424            | 293                      | 0,01                              |
| 4,654 % fällig am 25.05.2037                                              | 314            | 189                      | 0,01                              |
| 4,974 % fällig am 25.01.2036                                              | 1.617          | 1.523                    | 0,06                              |
| 5,214 % fällig am 25.11.2034                                              | 92             | 97                       | 0,00                              |
| <b>Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates</b> |                |                          |                                   |
| 5,259 % fällig am 25.07.2035                                              | 2.500          | 2.412                    | 0,10                              |
| 5,754 % fällig am 25.01.2036                                              | 5.312          | 5.092                    | 0,21                              |
| <b>Renaissance Home Equity Loan Trust</b>                                 |                |                          |                                   |
| 5,285 % fällig am 25.01.2037                                              | 227            | 69                       | 0,00                              |
| 5,434 % fällig am 25.08.2035                                              | 8              | 8                        | 0,00                              |
| 5,545 % fällig am 25.01.2037                                              | 334            | 107                      | 0,00                              |
| 5,580 % fällig am 25.11.2036                                              | 683            | 221                      | 0,01                              |
| <b>Residential Asset Securities Corp. Trust</b>                           |                |                          |                                   |
| 5,114 % fällig am 25.05.2037                                              | 516            | 513                      | 0,02                              |
| 5,469 % fällig am 25.10.2035                                              | 350            | 346                      | 0,01                              |
| <b>Saxon Asset Securities Trust</b>                                       |                |                          |                                   |
| 1,814 % fällig am 25.05.2035                                              | 70             | 68                       | 0,00                              |
| 4,869 % fällig am 25.09.2036                                              | 5.639          | 5.366                    | 0,22                              |
| 6,184 % fällig am 25.12.2037                                              | 1.294          | 1.238                    | 0,05                              |
| <b>Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust</b>                     |                |                          |                                   |
| 4,714 % fällig am 25.01.2037                                              | 3.523          | 3.020                    | 0,12                              |
| <b>Soundview Home Loan Trust</b>                                          |                |                          |                                   |
| 4,584 % fällig am 25.06.2037                                              | 350            | 230                      | 0,01                              |
| 4,604 % fällig am 25.07.2037                                              | 610            | 539                      | 0,02                              |
| 4,604 % fällig am 25.08.2037                                              | 740            | 647                      | 0,03                              |
| 4,734 % fällig am 25.03.2037                                              | 40             | 39                       | 0,00                              |
| 4,899 % fällig am 25.06.2036                                              | 7.584          | 6.776                    | 0,28                              |
| 4,934 % fällig am 25.10.2036                                              | 121            | 116                      | 0,00                              |
| 5,334 % fällig am 25.10.2037                                              | 1.681          | 1.290                    | 0,05                              |
| 5,434 % fällig am 25.09.2037                                              | 5.225          | 3.795                    | 0,16                              |
| 5,469 % fällig am 25.05.2035                                              | 742            | 742                      | 0,03                              |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 4,934 % fällig am 25.11.2037                                              | 2.600          | 2.376                    | 0,10                              |
| 5,559 % fällig am 25.07.2035                                              | 1.220          | 1.247                    | 0,05                              |
|                                                                           |                | 157.358                  | 6,45                              |
| <b>HYPOTHEKEN SEQUENTIELL</b>                                             |                |                          |                                   |
| <b>Credit-Based Asset Servicing &amp; Securitization LLC</b>              |                |                          |                                   |
| 3,114 % fällig am 25.01.2037                                              | 159            | 44                       | 0,00                              |
| <b>Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 4,774 % fällig am 25.12.2036                                              | 12             | 12                       | 0,00                              |
| <b>Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust</b>              |                |                          |                                   |
| 4,854 % fällig am 25.03.2037                                              | 4              | 3                        | 0,00                              |
|                                                                           |                | 59                       | 0,00                              |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

|                                                |        |        |        | % DES                                          |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        | % DES                                   |                                       |         |        |      |  |  |
|------------------------------------------------|--------|--------|--------|------------------------------------------------|--------------------------------------------|---------|--------|----------------------------------------------------|----------------------------------|---------|--------|-----------------------------------------|---------------------------------------|---------|--------|------|--|--|
| BESCHREIBUNG                                   | PARI   | MARKT- | NETTO- | BESCHREIBUNG                                   | PARI                                       | MARKT-  | NETTO- | BESCHREIBUNG                                       | PARI                             | MARKT-  | NETTO- | BESCHREIBUNG                            | PARI                                  | MARKT-  | NETTO- |      |  |  |
| ABS SONSTIGE                                   | (000S) | WERT   | VERMÖ- |                                                | (000S)                                     | WERT    | VERMÖ- |                                                    | (000S)                           | WERT    | VERMÖ- |                                         | (000S)                                | WERT    | VERMÖ- |      |  |  |
|                                                |        |        | GENS   |                                                |                                            |         | GENS   |                                                    |                                  |         | GENS   |                                         |                                       |         | GENS   |      |  |  |
| Accunia European CLO DAC                       |        |        |        | Golden Bar Securitisation SRL                  |                                            |         |        | Specialty Underwriting & Residential Finance Trust |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,229 % fällig am 15.07.2030                   | €      | 257    | \$     | 2,866 % fällig am 22.09.2043                   | €                                          | 15.766  | \$     | 4,734 % fällig am 25.11.2037                       | \$                               | 4.977   | \$     | 2,738                                   | 0,11                                  |         |        |      |  |  |
| Adagio CLO DAC                                 |        |        |        | Griffith Park CLO DAC                          |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       | 21.594  | 0,89   |      |  |  |
| 3,209 % fällig am 15.04.2032                   | 2.722  | 3.192  | 0,13   | 2,795 % fällig am 21.11.2031                   | 7.075                                      | 8.286   | 0,34   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       | 597.240 | 24,46  |      |  |  |
| AlbaCore Euro CLO DAC                          |        |        |        | Harvest CLO DAC                                |                                            |         |        | STAATSEMISSIONEN                                   |                                  |         |        | Argentina Government International Bond |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,269 % fällig am 15.07.2035                   | 1.000  | 1.175  | 0,05   | 1,040 % fällig am 15.07.2031                   | 372                                        | 424     | 0,02   | 0,750 % fällig am 09.07.2030                       | 4.571                            | 3.422   | 0,14   | 1,000 % fällig am 09.07.2029            | 339                                   | 284     | 0,01   |      |  |  |
| Arbour CLO DAC                                 |        |        |        | 2,916 % fällig am 20.10.2031                   | 5.301                                      | 6.222   | 0,25   | 3,500 % fällig am 09.07.2041                       | 448                              | 279     | 0,01   | 3,500 % fällig am 09.07.2035            | 2.879                                 | 1.898   | 0,08   |      |  |  |
| 3,155 % fällig am 15.12.2038                   | 1.600  | 1.879  | 0,08   | 2,919 % fällig am 15.10.2031                   | 2.510                                      | 2.946   | 0,12   | 4,125 % fällig am 09.07.2046                       | 112                              | 74      | 0,00   | Australia Government International Bond |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,293 % fällig am 15.11.2037                   | 3.500  | 4.109  | 0,17   | 2,997 % fällig am 18.11.2030                   | 7.190                                      | 8.443   | 0,35   | 1,750 % fällig am 21.06.2051 AUD                   | 2.200                            | 784     | 0,03   | Bulgaria Government International Bond  |                                       |         |        |      |  |  |
| Ares European CLO DAC                          |        |        |        | 3,039 % fällig am 15.07.2031                   | 2.975                                      | 3.494   | 0,14   | 3,500 % fällig am 07.05.2034                       | €                                | 1.100   | 1.306  | 0,05                                    | 3,500 % fällig am 07.05.2038          | 1.100   | 1.317  | 0,05 |  |  |
| 3,059 % fällig am 15.10.2031                   | 3.166  | 3.711  | 0,15   | 3,129 % fällig am 15.01.2032                   | 18.698                                     | 21.937  | 0,90   | Egypt Government International Bond                |                                  |         |        | 21,954 % fällig am 04.03.2028           | EGP                                   | 200.400 | 3.990  | 0,16 |  |  |
| 3,183 % fällig am 17.04.2032                   | 19.273 | 22.643 | 0,93   | Henley CLO DAC                                 |                                            |         |        | Hungary Government International Bond              |                                  |         |        | 4,875 % fällig am 22.03.2040            | €                                     | 1.400   | 1.609  | 0,07 |  |  |
| Aurium CLO DAC                                 |        |        |        | 3,148 % fällig am 25.04.2034                   | 30.000                                     | 35.179  | 1,44   | Israel Government International Bond               |                                  |         |        | 5,000 % fällig am 30.10.2026            | 2.200                                 | 2.656   | 0,11   |      |  |  |
| 2,922 % fällig am 16.04.2030                   | 548    | 644    | 0,03   | Invesco Euro CLO DAC                           |                                            |         |        | 5,375 % fällig am 19.02.2030 (k)                   | \$                               | 2.300   | 2.347  | 0,10                                    | 5,500 % fällig am 12.03.2034          | 7.400   | 7.503  | 0,31 |  |  |
| Avoca CLO DAC                                  |        |        |        | 2,929 % fällig am 15.07.2031                   | 370                                        | 434     | 0,02   | 5,625 % fällig am 19.02.2035 (k)                   | 1.900                            | 1.935   | 0,08   | Japan Government International Bond     |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,075 % fällig am 12.01.2031                   | 4.201  | 4.931  | 0,20   | 3,209 % fällig am 15.04.2033                   | 5.250                                      | 6.144   | 0,25   | 2,400 % fällig am 20.03.2045                       | ¥                                | 169.000 | 1.178  | 0,05                                    | 2,400 % fällig am 20.03.2055          | 44.000  | 280    | 0,01 |  |  |
| 3,099 % fällig am 15.10.2032                   | 1.691  | 1.983  | 0,08   | 3,296 % fällig am 30.10.2038                   | 1.000                                      | 1.172   | 0,05   | Mexico Government International Bond               |                                  |         |        | 2,750 % fällig am 27.11.2031 (g)        | MXN                                   | 23.462  | 1.101  | 0,05 |  |  |
| Bain Capital Euro CLO DAC                      |        |        |        | Jubilee CLO DAC                                |                                            |         |        | 3,000 % fällig am 03.12.2026 (g)                   | 19.552                           | 1.014   | 0,04   | 4,000 % fällig am 30.11.2028 (g)        | 1.955                                 | 101     | 0,00   |      |  |  |
| 2,976 % fällig am 20.01.2032                   | 1.604  | 1.879  | 0,08   | 2,929 % fällig am 15.04.2031                   | 4.182                                      | 4.896   | 0,20   | 4,000 % fällig am 24.08.2034 (g)                   | 247.035                          | 12.166  | 0,50   | 4,625 % fällig am 04.05.2033            | €                                     | 1.200   | 1.408  | 0,06 |  |  |
| Black Diamond CLO DAC                          |        |        |        | 3,322 % fällig am 16.01.2034                   | 5.000                                      | 5.867   | 0,24   | 5,850 % fällig am 02.07.2032 (b)                   | \$                               | 500     | 507    | 0,02                                    | 5,850 % fällig am 13.05.2037          | 1.500   | 1.568  | 0,06 |  |  |
| 3,096 % fällig am 20.01.2032                   | 153    | 180    | 0,01   | Lyra Music Assets Delaware LP                  |                                            |         |        | 6,875 % fällig am 26.05.2033 MXN                   | 4.500                            | 218     | 0,01   | 7,500 % fällig am 29.05.2031            | 1.100                                 | 56      | 0,00   |      |  |  |
| 3,123 % fällig am 15.05.2032                   | 6.787  | 7.966  | 0,33   | 5,760 % fällig am 22.12.2064                   | \$                                         | 699     | 703    | 0,03                                               | 7,750 % fällig am 23.11.2034     | 55.980  | 2.711  | 0,11                                    | 7,750 % fällig am 01.03.2029          | 6.800   | 359    | 0,02 |  |  |
| 3,993 % fällig am 15.05.2032                   | 5.000  | 5.886  | 0,24   | Madison Park Euro Funding DAC                  |                                            |         |        | 7,500 % fällig am 31.05.2029                       | 11.100                           | 586     | 0,02   | Peru Government International Bond      |                                       |         |        |      |  |  |
| Blackrock European CLO DAC                     |        |        |        | 3,029 % fällig am 15.01.2032                   | €                                          | 1.485   | 1.738  | 0,07                                               | 5,400 % fällig am 12.08.2034 PEN | 383     | 102    | 0,00                                    | 5,400 % fällig am 12.08.2034          | 100     | 27     | 0,00 |  |  |
| 2,899 % fällig am 15.10.2031                   | 3.118  | 3.650  | 0,15   | 3,079 % fällig am 15.07.2032                   | 3.192                                      | 3.736   | 0,15   | 4,000 % fällig am 30.01.2033                       | 61                               | 76      | 0,00   | 6,150 % fällig am 12.08.2032            | 13.789                                | 4.020   | 0,17   |      |  |  |
| BlueMountain Fuji EUR CLO DAC                  |        |        |        | Man Euro CLO DAC                               |                                            |         |        | 4,625 % fällig am 04.05.2033                       | €                                | 1.200   | 1.408  | 0,06                                    | 6,900 % fällig am 12.08.2037          | 822     | 236    | 0,01 |  |  |
| 1,050 % fällig am 15.01.2031                   | 198    | 229    | 0,01   | 4,029 % fällig am 15.10.2036                   | 2.880                                      | 3.390   | 0,14   | 5,850 % fällig am 02.07.2032 (b)                   | \$                               | 500     | 507    | 0,02                                    | 6,950 % fällig am 12.08.2031          | 7.762   | 2.378  | 0,10 |  |  |
| 2,999 % fällig am 15.01.2031                   | 1.535  | 1.803  | 0,07   | Man GLG Euro CLO DAC                           |                                            |         |        | 6,875 % fällig am 13.05.2037                       | 1.500                            | 1.568   | 0,06   | 7,300 % fällig am 12.08.2033            | 12.528                                | 3.852   | 0,16   |      |  |  |
| 3,189 % fällig am 15.01.2033                   | 999    | 1.172  | 0,05   | 2,665 % fällig am 15.12.2031                   | 1.913                                      | 2.240   | 0,09   | 7,500 % fällig am 12.08.2039                       | 4.629                            | 1.392   | 0,06   | Bundesrepublik Deutschland              |                                       |         |        |      |  |  |
| BNPP AM Euro CLO DAC                           |        |        |        | Marzio Finance SRL                             |                                            |         |        | 7,600 % fällig am 12.08.2039                       |                                  |         |        | 2,300 % fällig am 15.02.2033            | €                                     | 5.600   | 6.520  | 0,27 |  |  |
| 2,879 % fällig am 15.04.2031                   | 300    | 351    | 0,01   | 2,759 % fällig am 28.09.2049                   | 816                                        | 962     | 0,04   | Republic of Greece Government International Bond   |                                  |         |        | 3,750 % fällig am 30.01.2028            | 58                                    | 71      | 0,00   |      |  |  |
| 2,929 % fällig am 15.10.2031                   | 246    | 288    | 0,01   | Nelnet Student Loan Trust                      |                                            |         |        | 3,900 % fällig am 30.01.2033                       | 61                               | 76      | 0,00   | 4,000 % fällig am 30.01.2037            | 36                                    | 45      | 0,00   |      |  |  |
| Cairn CLO DAC                                  |        |        |        | 4,874 % fällig am 27.09.2066                   | \$                                         | 270     | 270    | 0,01                                               | 4,200 % fällig am 30.01.2042     | 11      | 14     | 0,00                                    | Romania Government International Bond |         |        |      |  |  |
| 2,856 % fällig am 31.01.2030                   | 501    | 586    | 0,02   | Oak Hill European Credit Partners DAC          |                                            |         |        | 2,124 % fällig am 16.07.2031                       | 3.400                            | 3.325   | 0,14   | 5,125 % fällig am 24.09.2031            | 1.200                                 | 1.392   | 0,06   |      |  |  |
| 3,059 % fällig am 15.10.2031                   | 2.695  | 3.159  | 0,13   | 2,966 % fällig am 20.01.2032                   | €                                          | 300     | 352    | 0,01                                               | 5,250 % fällig am 30.05.2032     | 3.000   | 3.470  | 0,14                                    | 5,250 % fällig am 30.05.2032          | 3.000   | 3.470  | 0,14 |  |  |
| 3,729 % fällig am 15.10.2031                   | 4.000  | 4.704  | 0,19   | 2,976 % fällig am 20.10.2031                   | 4.028                                      | 4.723   | 0,19   | 5,375 % fällig am 22.03.2031                       | 3.400                            | 4.009   | 0,17   | 5,625 % fällig am 30.05.2037 (k)        | 400                                   | 443     | 0,02   |      |  |  |
| Carlyle Euro CLO DAC                           |        |        |        | OCF Euro CLO DAC                               |                                            |         |        | 6,375 % fällig am 18.09.2033                       | 2.500                            | 3.025   | 0,12   | Russia Government International Bond    |                                       |         |        |      |  |  |
| 0,000 % fällig am 15.08.2038 (b)               | 900    | 1.056  | 0,04   | 3,116 % fällig am 22.09.2034                   | 3.851                                      | 4.520   | 0,18   | 5,100 % fällig am 28.03.2035                       | \$                               | 200     | 0      | 0,00                                    | 5,250 % fällig am 23.06.2047          | 4.200   | 0      | 0,00 |  |  |
| 2,200 % fällig am 15.08.2032                   | 1.000  | 1.121  | 0,05   | Palmer Square BDC CLO Ltd.                     |                                            |         |        | Saudi Arabia Government International Bond         |                                  |         |        | 7,000 % fällig am 28.02.2031            | ZAR                                   | 58.300  | 3.018  | 0,12 |  |  |
| 2,979 % fällig am 15.01.2031                   | 2.860  | 3.357  | 0,14   | 5,856 % fällig am 15.07.2037                   | \$                                         | 1.600   | 1.606  | 0,07                                               | 8,000 % fällig am 31.01.2030     | 3.500   | 194    | 0,01                                    | 8,500 % fällig am 31.01.2037          | 10.400  | 509    | 0,02 |  |  |
| 3,033 % fällig am 15.08.2032                   | 1.396  | 1.631  | 0,07   | Palmer Square European Loan Funding DAC        |                                            |         |        | 8,875 % fällig am 28.02.2035                       | 70.400                           | 3.699   | 0,15   | 9,000 % fällig am 31.01.2040            | 2.400                                 | 117     | 0,01   |      |  |  |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC  |        |        |        | 2,999 % fällig am 15.10.2033                   | €                                          | 1.378   | 1.614  | 0,07                                               | 10,500 % fällig am 21.12.2026    | 24.300  | 1.419  | 0,06                                    | Turkey Government International Bond  |         |        |      |  |  |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. |        |        |        | 3,113 % fällig am 15.05.2033                   | 1.168                                      | 1.373   | 0,06   | 7,625 % fällig am 26.04.2029                       | \$                               | 6.400   | 6.709  | 0,28                                    |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,893 % fällig am 15.11.2031                   | 1.839  | 2.160  | 0,09   | 3,133 % fällig am 15.05.2034                   | 1.680                                      | 1.971   | 0,08   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| Castlake Aircraft Securitization Trust         |        |        |        | 3,143 % fällig am 15.05.2034                   | 1.552                                      | 1.821   | 0,07   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 4,125 % fällig am 15.06.2043                   | \$     | 181    | 176    | 0,01                                           | 3,259 % fällig am 15.01.2033               | 9.432   | 11.080 | 0,45                                               |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| Castlake Aircraft Securitization Trust         |        |        |        | 3,870 % fällig am 15.10.2034                   | 5.000                                      | 5.883   | 0,24   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 5,783 % fällig am 15.02.2050                   | 3.991  | 4.053  | 0,17   | 3,993 % fällig am 15.05.2034                   | 1.650                                      | 1.943   | 0,08   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| Contego CLO BV                                 |        |        |        | Segovia European CLO DAC                       |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,049 % fällig am 15.10.2030                   | €      | 172    | 202    | 0,01                                           | 3,116 % fällig am 20.07.2032               | 12.067  | 14.186 | 0,58                                               |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| Contego CLO DAC                                |        |        |        | SLM Student Loan Trust                         |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,823 % fällig am 23.01.2030                   | 2.287  | 2.680  | 0,11   | 5,220 % fällig am 25.03.2026                   | \$                                         | 2.321   | 2.306  | 0,09                                               |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC                     |        |        |        | Taco Bell Funding LLC                          |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,605 % fällig am 15.09.2031                   | 1.814  | 2.129  | 0,09   | 1,946 % fällig am 25.08.2051                   | 8.351                                      | 7.967   | 0,33   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,886 % fällig am 21.07.2030                   | 1.836  | 2.158  | 0,09   | Tikehau CLO DAC                                |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,929 % fällig am 15.10.2031                   | 5.554  | 6.524  | 0,27   | 3,929 % fällig am 15.10.2031                   | €                                          | 1.000   | 1.177  | 0,05                                               |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,074 % fällig am 23.12.2033                   | 3.363  | 3.953  | 0,16   | Toro European CLO DAC                          |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 4,790 % fällig am 23.10.2034                   | 1.000  | 1.180  | 0,05   | 2,953 % fällig am 15.02.2034                   | 5.227                                      | 6.117   | 0,25   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC         |        |        |        | 3,185 % fällig am 12.01.2032                   | 1.618                                      | 1.898   | 0,08   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,683 % fällig am 15.08.2033                   | 6.000  | 7.054  | 0,29   |                                                |                                            | 378.982 | 15,52  |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| DB Master Finance LLC                          |        |        |        | SICHERHEITEN WHOLE LOANS                       |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,045 % fällig am 20.11.2051                   | \$     | 8.203  | 7.903  | 0,32                                           | Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| Dryden Euro CLO DAC                            |        |        |        | 6,384 % fällig am 25.11.2039                   | \$                                         | 161     | 177    | 0,01                                               |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,939 % fällig am 15.04.2033                   | €      | 3.773  | 4.427  | 0,18                                           | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.        |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,003 % fällig am 15.05.2034                   | 4.249  | 4.982  | 0,20   | 7,250 % fällig am 25.05.2036                   | 93                                         | 46      | 0,00   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,986 % fällig am 18.01.2032                   | 1.000  | 1.177  | 0,05   | First Franklin Mortgage Loan Trust             |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| Euro-Galaxy CLO DAC                            |        |        |        | 4,554 % fällig am 25.12.2036                   | 3.490                                      | 3.382   | 0,14   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,811 % fällig am 24.04.2034                   | 3.687  | 4.319  | 0,18   | 4,754 % fällig am 25.06.2036                   | 2.941                                      | 2.913   | 0,12   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| Fair Oaks Loan Funding DAC                     |        |        |        | 5,139 % fällig am 25.11.2036                   | 5.357                                      | 5.226   | 0,22   |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 3,279 % fällig am 15.10.2034                   | 7.800  | 9.142  | 0,37   | Household Capital RMBS                         |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| FTA Santander Consumo                          |        |        |        | 0,000 % fällig am 21.07.2087                   | AUD                                        | 8.600   | 5.638  | 0,23                                               |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,886 % fällig am 21.03.2036                   | 1.018  | 1.199  | 0,05   | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos   |        |        |        | 4,594 % fällig am 25.11.2036                   | \$                                         | 5.301   | 1.474  | 0,06                                               |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |
| 2,949 % fällig am 25.02.2034                   | 18.068 | 21.284 | 0,87   |                                                |                                            |         |        |                                                    |                                  |         |        |                                         |                                       |         |        |      |  |  |

| BESCHREIBUNG                            |     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|-----|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 47,469 % fällig am 06.09.2028           | TRY | 1.200          | \$ 29                    | 0,00                              |
| 49,053 % fällig am 20.05.2026           |     | 100            | 3                        | 0,00                              |
| 49,053 % fällig am 19.08.2026           |     | 100            | 3                        | 0,00                              |
| 49,053 % fällig am 17.05.2028           |     | 25.200         | 614                      | 0,03                              |
| Venezuela Government International Bond |     |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^          | \$  | 289            | 40                       | 0,00                              |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^          |     | 107            | 19                       | 0,00                              |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^          |     | 266            | 43                       | 0,00                              |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^          |     | 269            | 44                       | 0,00                              |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^          |     | 144            | 23                       | 0,00                              |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^          |     | 301            | 61                       | 0,00                              |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^          |     | 256            | 45                       | 0,00                              |
| 11,750 % fällig am 21.10.2026 ^         |     | 40             | 8                        | 0,00                              |
| 11,950 % fällig am 05.08.2031 ^         |     | 400            | 74                       | 0,00                              |
| 12,750 % fällig am 23.08.2022 ^         |     | 180            | 33                       | 0,00                              |
|                                         |     | 105.080        | 4,30                     |                                   |

## AKTIEN

| STAMMAKTION<br>KOMMUNIKATIONSDIENSTE     |           |        |      |  |
|------------------------------------------|-----------|--------|------|--|
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d) | 320.208   | 375    | 0,02 |  |
| Comcast Corp. 'A' (d)                    | 148.576   | 5.303  | 0,22 |  |
| Electronic Arts, Inc.                    | 34.120    | 5.449  | 0,22 |  |
| iHeartMedia, Inc. 'A' (d)                | 75.157    | 132    | 0,01 |  |
| iHeartMedia, Inc. 'B' (d)                | 58.371    | 90     | 0,00 |  |
| Intelsat Emergence S.A. (d)(j)           | 54.916    | 1.894  | 0,08 |  |
| KDDI Corp. (d)                           | 74.000    | 1.267  | 0,05 |  |
| Koninklijke KPN NV                       | 535.921   | 2.605  | 0,11 |  |
| NetEase, Inc.                            | 239.900   | 6.465  | 0,26 |  |
| Telkom Indonesia Persero Tbk PT          | 6.803.200 | 1.164  | 0,05 |  |
| Verizon Communications, Inc. (d)         | 425.952   | 18.431 | 0,75 |  |
| Vodafone Group PLC                       | 1.177.688 | 1.259  | 0,05 |  |
| Windstream Holdings, Inc. (d)            | 2.586     | 51     | 0,00 |  |
|                                          | 44.485    | 1,82   |      |  |

## LUXUSGÜTER

|                                                 |         |       |      |  |
|-------------------------------------------------|---------|-------|------|--|
| Alibaba Group Holding Ltd.                      | 63.800  | 903   | 0,04 |  |
| Best Buy Co., Inc.                              | 27.511  | 1.847 | 0,07 |  |
| Booking Holdings, Inc.                          | 344     | 1.992 | 0,08 |  |
| Canadian Tire Corp. Ltd. 'A' (d)                | 7.027   | 955   | 0,04 |  |
| Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A. | 92.490  | 3.428 | 0,14 |  |
| Denso Corp. (d)                                 | 64.600  | 869   | 0,04 |  |
| eBay, Inc.                                      | 35.063  | 2.611 | 0,11 |  |
| Evolution AB                                    | 20.172  | 1.590 | 0,06 |  |
| Expedia Group, Inc.                             | 16.996  | 2.867 | 0,12 |  |
| Haier Smart Home Co. Ltd. 'H'                   | 305.000 | 876   | 0,04 |  |
| Home Depot, Inc.                                | 9.526   | 3.493 | 0,14 |  |
| Industria de Diseno Textil S.A. (d)             | 110.940 | 5.767 | 0,24 |  |
| Isuzu Motors Ltd. (d)                           | 57.700  | 729   | 0,03 |  |
| JD.com, Inc. 'A'                                | 336.100 | 5.489 | 0,22 |  |
| Kia Corp.                                       | 33.421  | 2.391 | 0,10 |  |
| Kingfisher PLC                                  | 245.612 | 979   | 0,04 |  |
| Subaru Corp. (d)                                | 77.800  | 1.345 | 0,05 |  |
| Williams-Sonoma, Inc. (d)                       | 9.301   | 1.520 | 0,06 |  |
| Yamaha Motor Co. Ltd. (d)                       | 125.300 | 935   | 0,04 |  |
|                                                 | 40.586  | 1,66  |      |  |

## BASISKONSUMGÜTER

|                                  |         |        |      |  |
|----------------------------------|---------|--------|------|--|
| Altria Group, Inc.               | 232.394 | 13.625 | 0,56 |  |
| Ambev S.A.                       | 657.200 | 1.604  | 0,06 |  |
| Associated British Foods PLC     | 43.127  | 1.216  | 0,05 |  |
| British American Tobacco PLC (d) | 273.248 | 12.970 | 0,53 |  |
| Carrefour S.A.                   | 74.182  | 1.043  | 0,04 |  |
| Colgate-Palmolive Co. (d)        | 23.519  | 2.138  | 0,09 |  |

| BESCHREIBUNG                      | AKTIEN    | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------|-----------|--------------------------|-----------------------------------|
| Imperial Brands PLC (d)           | 107.903   | \$ 4.256                 | 0,17                              |
| ITC Ltd.                          | 206.350   | 1.002                    | 0,04                              |
| J Sainsbury PLC                   | 229.083   | 910                      | 0,04                              |
| Japan Tobacco, Inc. (d)           | 81.300    | 2.388                    | 0,10                              |
| Kimberly-Clark Corp.              | 44.976    | 5.798                    | 0,24                              |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV     | 101.387   | 4.220                    | 0,17                              |
| KT&G Corp.                        | 12.394    | 1.170                    | 0,05                              |
| Nestle S.A.                       | 28.560    | 2.830                    | 0,12                              |
| Philip Morris International, Inc. | 96.375    | 17.553                   | 0,72                              |
| Target Corp. (d)                  | 62.783    | 6.194                    | 0,25                              |
| WH Group Ltd.                     | 1.140.000 | 1.099                    | 0,04                              |
|                                   | 80.016    | 3,27                     |                                   |

## ENERGIE

|                                   |         |       |      |  |
|-----------------------------------|---------|-------|------|--|
| Aker BP ASA                       | 43.172  | 1.099 | 0,04 |  |
| Antero Midstream Corp.            | 18.893  | 358   | 0,01 |  |
| ARC Resources Ltd.                | 53.425  | 1.124 | 0,05 |  |
| Cheniere Energy, Inc. (d)         | 5.624   | 1.370 | 0,06 |  |
| China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H' | 464.000 | 1.803 | 0,07 |  |
| ConocoPhillips Co.                | 21.832  | 1.959 | 0,08 |  |
| Devon Energy Corp.                | 84.966  | 2.703 | 0,11 |  |
| DTE Midstream LLC (d)             | 17.429  | 1.916 | 0,08 |  |
| Enbridge, Inc.                    | 58.191  | 2.633 | 0,11 |  |
| EOG Resources, Inc. (d)           | 52.044  | 6.225 | 0,25 |  |
| Equinor ASA (d)                   | 115.633 | 2.909 | 0,12 |  |
| Hess Midstream LP 'A'             | 27.407  | 1.056 | 0,04 |  |
| Kinder Morgan, Inc.               | 106.738 | 3.138 | 0,13 |  |
| Kinetik Holdings, Inc.            | 8.290   | 365   | 0,01 |  |
| OMV AG                            | 20.816  | 1.128 | 0,05 |  |
| ONEOK, Inc.                       | 28.914  | 2.360 | 0,10 |  |
| ORLEN S.A. (d)                    | 80.676  | 1.834 | 0,07 |  |
| Pembina Pipeline Corp.            | 39.366  | 1.475 | 0,06 |  |
| Petroleo Brasileiro S.A.          | 421.600 | 2.633 | 0,11 |  |
| Plains GP Holdings LP 'A'         | 86.777  | 1.686 | 0,07 |  |
| Repsol S.A. (d)                   | 160.527 | 2.340 | 0,10 |  |
| Shell PLC                         | 105.224 | 3.665 | 0,15 |  |
| South Bow Corp.                   | 26.410  | 684   | 0,03 |  |
| Suncor Energy, Inc.               | 169.464 | 6.335 | 0,26 |  |
| Targa Resources Corp.             | 8.055   | 1.402 | 0,06 |  |
| TC Energy Corp.                   | 54.180  | 2.640 | 0,11 |  |
| Tenaris S.A.                      | 53.124  | 992   | 0,04 |  |
| WhiteCap Resources, Inc. (j)      | 174.257 | 1.169 | 0,05 |  |
| Williams Cos., Inc.               | 43.088  | 2.706 | 0,11 |  |
|                                   | 61.707  | 2,53  |      |  |

## FINANZWERTE

|                                      |           |        |      |  |
|--------------------------------------|-----------|--------|------|--|
| 3i Group PLC                         | 40.926    | 2.312  | 0,09 |  |
| Absa Group Ltd.                      | 116.670   | 1.157  | 0,05 |  |
| Ageas S.A.                           | 19.654    | 1.325  | 0,05 |  |
| AIB Group PLC                        | 294.551   | 2.422  | 0,10 |  |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 758.585   | 11.640 | 0,48 |  |
| Banco BPM SpA                        | 160.624   | 1.868  | 0,08 |  |
| Banco de Sabadell S.A.               | 734.200   | 2.329  | 0,10 |  |
| Banco do Brasil S.A. (d)             | 232.500   | 941    | 0,04 |  |
| Banco Santander S.A.                 | 120.841   | 997    | 0,04 |  |
| Bank Hapoalim B.M.                   | 172.911   | 3.322  | 0,14 |  |
| Bank Leumi Le-Israel B.M.            | 202.231   | 3.764  | 0,15 |  |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT          | 5.249.900 | 1.577  | 0,06 |  |
| Bank of New York Mellon Corp.        | 52.158    | 4.752  | 0,19 |  |
| Bank Polska Kasa Opieki S.A.         | 25.209    | 1.295  | 0,05 |  |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 9.594.300 | 2.212  | 0,09 |  |
| BB Seguridade Participacoes S.A.     | 100.700   | 661    | 0,03 |  |

| BESCHREIBUNG                                      | AKTIEN    | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------|-----------|--------------------------|-----------------------------------|
| BPER Banca SpA                                    | 136.887   | \$ 1.238                 | 0,05                              |
| Cairo Mezz PLC (d)                                | 59.349    | 30                       | 0,00                              |
| China Merchants Bank Co. Ltd. 'H' (d)             | 195.500   | 1.371                    | 0,06                              |
| China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'        | 345.200   | 1.188                    | 0,05                              |
| CME Group, Inc.                                   | 32.064    | 8.838                    | 0,36                              |
| FirstRand Ltd.                                    | 713.353   | 3.038                    | 0,12                              |
| Hartford Insurance Group, Inc.                    | 17.154    | 2.176                    | 0,09                              |
| Intesa Sanpaolo SpA                               | 1.111.316 | 6.379                    | 0,26                              |
| Meritz Financial Group, Inc.                      | 8.167     | 679                      | 0,03                              |
| Mizrahi Tefahot Bank Ltd.                         | 20.768    | 1.355                    | 0,06                              |
| MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. (d)          | 173.600   | 3.869                    | 0,16                              |
| Nedbank Group Ltd.                                | 62.712    | 858                      | 0,04                              |
| Northern Trust Corp.                              | 26.869    | 3.407                    | 0,14                              |
| PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H' (d)         | 864.000   | 1.679                    | 0,07                              |
| Power Finance Corp. Ltd.                          | 193.955   | 968                      | 0,04                              |
| Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. (d) | 122.908   | 2.561                    | 0,11                              |
| Powszechny Zaklad Ubezpieczen S.A. (d)            | 83.505    | 1.456                    | 0,06                              |
| REC Ltd. (d)                                      | 171.895   | 808                      | 0,03                              |
| Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.          | 4.110     | 1.318                    | 0,05                              |
| Sanlam Ltd.                                       | 247.766   | 1.236                    | 0,05                              |
| Singapore Exchange Ltd.                           | 111.200   | 1.300                    | 0,05                              |
| Sompo Holdings, Inc. (d)                          | 96.100    | 2.887                    | 0,12                              |
| SpareBank Sor-Norge ASA                           | 1.345     | 25                       | 0,00                              |
| Standard Bank Group Ltd.                          | 186.404   | 2.384                    | 0,10                              |
| State Street Corp. (d)                            | 39.250    | 4.174                    | 0,17                              |
| Swiss Re AG                                       | 16.164    | 2.787                    | 0,11                              |
| Synchrony Financial                               | 52.509    | 3.504                    | 0,14                              |
| T. Rowe Price Group, Inc.                         | 30.627    | 2.956                    | 0,12                              |
| Tokio Marine Holdings, Inc. (d)                   | 171.200   | 7.234                    | 0,30                              |
| Zurich Insurance Group AG                         | 5.651     | 3.942                    | 0,16                              |
|                                                   | 118.219   | 4,84                     |                                   |

## GESUNDHEITSWESEN

|                                 |           |        |      |  |
|---------------------------------|-----------|--------|------|--|
| AbbVie, Inc. (d)                | 34.768    | 6.454  | 0,26 |  |
| AMSURG Corp. (d)(j)             | 52.753    | 2.382  | 0,10 |  |
| CSPC Pharmaceutical Group Ltd.  | 1.064.000 | 1.047  | 0,04 |  |
| Johnson & Johnson               | 114.804   | 17.536 | 0,72 |  |
| Medtronic PLC                   | 105.855   | 9.227  | 0,38 |  |
| Merck & Co., Inc.               | 114.768   | 9.085  | 0,37 |  |
| Novartis AG                     | 83.738    | 10.131 | 0,42 |  |
| Ono Pharmaceutical Co. Ltd. (d) | 11.200    | 121    | 0,01 |  |
| Pfizer, Inc. (d)                | 656.420   | 15.912 | 0,65 |  |
| Roche Holding AG                | 21.575    | 7.020  | 0,29 |  |
| Royalty Pharma PLC 'A'          | 8.502     | 306    | 0,01 |  |
| Shionogi & Co. Ltd. (d)         | 100.600   | 1.805  | 0,07 |  |
|                                 | 81.026    | 3,32   |      |  |

## INDUSTRIEWERTE

|                                                      |           |       |      |  |
|------------------------------------------------------|-----------|-------|------|--|
| ACS Actividades de Construcción y Servicios S.A. (d) | 23.914    | 1.656 | 0,07 |  |
| AP Moller - Maersk A/S 'B'                           | 570       | 1.056 | 0,04 |  |
| Astra International Tbk PT                           | 2.915.700 | 809   | 0,03 |  |
| BAE Systems PLC                                      | 150.132   | 3.890 | 0,16 |  |
| Bouygues S.A.                                        | 25.948    | 1.169 | 0,05 |  |
| Brambles Ltd.                                        | 189.364   | 2.912 | 0,12 |  |
| COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. 'H'                 | 385.500   | 671   | 0,03 |  |
| EMCOR Group, Inc.                                    | 6.046     | 3.234 | 0,13 |  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                            | AKTIEN  | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                | AKTIEN  | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN              | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|---------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------|---------|---------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| Intertek Group PLC                      | 21.467  | \$ 1.396                  | 0,06                              | <b>IMMOBILIEN</b>                           |         |                           |                                   | Kite Realty Group Trust                                                   | 151.265             | \$ 3.426                  | 0,14                              |
| Makita Corp. (d)                        | 24.600  | 755                       | 0,03                              | China Resources Land Ltd.                   | 428.500 | \$ 1.459                  | 0,06                              | Klepierre S.A.                                                            | 27.549              | 1.086                     | 0,05                              |
| Nippon Yusen KK (d)                     | 56.900  | 2.041                     | 0,08                              | Daito Trust Construction Co. Ltd. (d)       | 7.900   | 858                       | 0,04                              | Link REIT                                                                 | 363.700             | 1.948                     | 0,08                              |
| Ryanair Holdings PLC                    | 41.393  | 1.170                     | 0,05                              | Sun Hung Kai Properties Ltd.                | 198.000 | 2.281                     | 0,09                              | National Health Investors, Inc.                                           | 38.719              | 2.715                     | 0,11                              |
| SGS S.A.                                | 7.497   | 759                       | 0,03                              |                                             |         | 4.598                     | 0,19                              | Nippon Building Fund, Inc.                                                | 1.039               | 956                       | 0,04                              |
| Singapore Airlines Ltd. (d)             | 203.900 | 1.117                     | 0,05                              | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>               |         |                           |                                   | NNN REIT, Inc.                                                            | 81.198              | 3.506                     | 0,14                              |
| Skanska AB 'B'                          | 46.612  | 1.078                     | 0,04                              | CLP Holdings Ltd.                           | 222.500 | 1.879                     | 0,08                              | Omega Healthcare Investors, Inc.                                          | 168.709             | 6.183                     | 0,25                              |
| Vinci S.A.                              | 68.293  | 10.036                    | 0,41                              | DTE Energy Co. (d)                          | 22.520  | 2.983                     | 0,12                              | Realty Income Corp.                                                       | 48.067              | 2.769                     | 0,11                              |
| ZTO Express Cayman, Inc. (j)            | 56.600  | 1.002                     | 0,04                              | Edison International (d)                    | 53.060  | 2.738                     | 0,11                              | Sabra Health Care REIT, Inc.                                              | 318.415             | 5.872                     | 0,24                              |
|                                         |         | 34.751                    | 1,42                              | Endesa S.A.                                 | 39.183  | 1.237                     | 0,05                              | Sila Realty Trust, Inc.                                                   | 243.621             | 5.767                     | 0,24                              |
| <b>INFORMATIONSTECHNOLOGIE</b>          |         |                           |                                   | Enel SpA (d)                                | 313.831 | 2.968                     | 0,12                              | Simon Property Group, Inc.                                                | 41.383              | 6.652                     | 0,27                              |
| Apple, Inc.                             | 19.948  | 4.093                     | 0,17                              | Engie S.A.                                  | 251.962 | 5.901                     | 0,24                              | UDR, Inc.                                                                 | 67.999              | 2.776                     | 0,11                              |
| Cisco Systems, Inc. (d)                 | 271.057 | 18.806                    | 0,77                              | National Grid PLC                           | 131.348 | 1.925                     | 0,08                              | Uniti Group, Inc.                                                         | 1.773               | 8                         | 0,00                              |
| Computershare Ltd.                      | 71.555  | 1.869                     | 0,08                              | Osaka Gas Co. Ltd. (d)                      | 50.100  | 1.281                     | 0,05                              | VICI Properties, Inc.                                                     | 104.878             | 3.419                     | 0,14                              |
| HCL Technologies Ltd.                   | 122.944 | 2.479                     | 0,10                              | Power Grid Corp. of India Ltd. (d)          | 492.807 | 1.722                     | 0,07                              | Welltower, Inc.                                                           | 9.035               | 1.389                     | 0,06                              |
| Infosys Ltd.                            | 102.746 | 1.920                     | 0,08                              | Tenaga Nasional Bhd.                        | 241.600 | 826                       | 0,04                              | WP Carey, Inc.                                                            | 46.033              | 2.872                     | 0,12                              |
| Lite-On Technology Corp.                | 287.000 | 1.088                     | 0,05                              |                                             |         | 23.460                    | 0,96                              |                                                                           |                     | 84.914                    | 3,48                              |
| MediaTek, Inc. (d)                      | 210.000 | 8.998                     | 0,37                              |                                             |         | 583.722                   | 23,90                             |                                                                           |                     |                           |                                   |
| Microsoft Corp. (d)                     | 13.168  | 6.550                     | 0,27                              | <b>OPTIONSSCHEINE</b>                       |         |                           |                                   | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                                           |                     |                           |                                   |
| Murata Manufacturing Co. Ltd. (d)       | 230.200 | 3.392                     | 0,14                              | Intelsat Emergency S.A. - Exp. 17.02.2027   | 1.128   | 2                         | 0,00                              | <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>                                             |                     |                           |                                   |
| Nokia Oyj (d)                           | 443.053 | 2.291                     | 0,09                              | Windstream Holdings, Inc. - Exp. 08.04.2060 | 514     | 10                        | 0,00                              | 30,612 % fällig am 29.06.2026 (e)(f)                                      | NGN 2.710.834       | 1.423                     | 0,06                              |
| Novatek Microelectronics Corp. (d)      | 79.000  | 1.473                     | 0,06                              |                                             |         | 12                        | 0,00                              | 30,864 % fällig am 26.06.2026 (e)(f)                                      | 2.508.911           | 1.319                     | 0,05                              |
| NVIDIA Corp.                            | 50.650  | 8.002                     | 0,33                              | <b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>                   |         |                           |                                   | 33,126 % fällig am 12.06.2026 (e)(f)                                      | 1.331.700           | 705                       | 0,03                              |
| QUALCOMM, Inc.                          | 37.027  | 5.897                     | 0,24                              | Nationwide Building Society 10,250 %        | 1.210   | 216                       | 0,01                              | 33,156 % fällig am 11.06.2026 (e)(f)                                      | 1.333.000           | 707                       | 0,03                              |
| Realtek Semiconductor Corp. (d)         | 67.000  | 1.301                     | 0,05                              | Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %            | 645.000 | 3.708                     | 0,15                              |                                                                           |                     | 4.154                     | 0,17                              |
| Samsung Electronics Co. Ltd.            | 106.668 | 4.717                     | 0,19                              |                                             |         | 3.924                     | 0,16                              | <b>U.S. TREASURY BILLS</b>                                                |                     |                           |                                   |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' (d) | 383.537 | 3.254                     | 0,13                              |                                             |         |                           |                                   | 4,322 % fällig am 16.09.2025 (b)(e)(f)(l)                                 | \$ 2.000            | 1.982                     | 0,08                              |
|                                         |         | 76.130                    | 3,12                              | <b>REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS</b>        |         |                           |                                   | Summe kurzfristige Instrumente                                            |                     | 6.136                     | 0,25                              |
| <b>BAUSTOFFE</b>                        |         |                           |                                   | Broadstone Net Lease, Inc.                  | 381.634 | 6.125                     | 0,25                              | <b>Summe Übertragbare Wertpapiere</b>                                     | <b>\$ 3.336.621</b> | <b>136,64</b>             |                                   |
| Barrick Mining Corp.                    | 114.184 | 2.372                     | 0,10                              | CapitaLand Ascendas REIT                    | 434.200 | 915                       | 0,04                              |                                                                           |                     |                           |                                   |
| CF Industries Holdings, Inc.            | 22.718  | 2.090                     | 0,09                              | Digital Realty Trust, Inc.                  | 7.835   | 1.366                     | 0,06                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                                                    |                     |                           |                                   |
| China Hongqiao Group Ltd.               | 380.500 | 876                       | 0,04                              | EPR Properties                              | 83.341  | 4.855                     | 0,20                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                  |                     |                           |                                   |
| Evrax PLC (d)                           | 72.869  | 0                         | 0,00                              | Equinix, Inc.                               | 2.318   | 1.844                     | 0,08                              | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) | 13.509.042          | 134.709                   | 5,52                              |
| Fortescue Ltd.                          | 217.559 | 2.178                     | 0,09                              | Equity Residential                          | 41.019  | 2.768                     | 0,11                              | <b>Summe Investmentfonds</b>                                              | <b>\$ 134.709</b>   | <b>5,52</b>               |                                   |
| Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B'         | 89.500  | 538                       | 0,02                              | Federal Realty Investment Trust             | 28.929  | 2.748                     | 0,11                              |                                                                           |                     |                           |                                   |
| Heidelberg Materials AG                 | 4.729   | 1.110                     | 0,04                              | Gaming and Leisure Properties, Inc.         | 29.492  | 1.377                     | 0,06                              |                                                                           |                     |                           |                                   |
| Holcim AG                               | 34.538  | 2.557                     | 0,10                              | Healthpeak Properties, Inc.                 | 97.400  | 1.706                     | 0,07                              |                                                                           |                     |                           |                                   |
| Kinross Gold Corp.                      | 153.656 | 2.396                     | 0,10                              | Host Hotels & Resorts, Inc.                 | 286.967 | 4.408                     | 0,18                              |                                                                           |                     |                           |                                   |
| Rio Tinto PLC                           | 79.623  | 4.627                     | 0,19                              | Invitation Homes, Inc.                      | 61.566  | 2.019                     | 0,08                              |                                                                           |                     |                           |                                   |
|                                         |         | 18.744                    | 0,77                              | Kimco Realty Corp.                          | 163.624 | 3.439                     | 0,14                              |                                                                           |                     |                           |                                   |

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                        | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                       | Short | 03.2026          | 8                       | \$ 30                                           | 0,00                         |
| 3-Month SOFR December Futures                       | Long  | 03.2027          | 462                     | 15                                              | 0,00                         |
| 3-Month SOFR December Futures                       | Long  | 03.2028          | 124                     | 5                                               | 0,00                         |
| 3-Month SOFR June Futures                           | Short | 09.2025          | 41                      | 115                                             | 0,00                         |
| 3-Month SOFR June Futures                           | Long  | 09.2026          | 462                     | (133)                                           | (0,01)                       |
| 3-Month SOFR June Futures                           | Long  | 09.2027          | 124                     | 0                                               | 0,00                         |
| 3-Month SOFR March Futures                          | Long  | 06.2026          | 453                     | (239)                                           | (0,01)                       |
| 3-Month SOFR March Futures                          | Long  | 06.2027          | 124                     | (9)                                             | 0,00                         |
| 3-Month SOFR September Futures                      | Short | 12.2025          | 6                       | 28                                              | 0,00                         |
| 3-Month SOFR September Futures                      | Long  | 12.2026          | 462                     | (42)                                            | 0,00                         |
| 3-Month SOFR September Futures                      | Long  | 12.2027          | 124                     | 3                                               | 0,00                         |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long  | 09.2025          | 41                      | 25                                              | 0,00                         |
| Euro-Bobl September Futures                         | Short | 09.2025          | 41                      | 26                                              | 0,00                         |

| Beschreibung                                         | Art   | Ablauf-<br>monat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------------|-------|------------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Euro-Bund September Futures                          | Short | 09.2025          | 111                     | \$ 128                                          | 0,01                         |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 1.378                   | 1.072                                           | 0,04                         |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025          | 356                     | 470                                             | 0,02                         |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025          | 126                     | 181                                             | 0,01                         |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Long  | 09.2025          | 11                      | 25                                              | 0,00                         |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures       | Short | 09.2025          | 102                     | (505)                                           | (0,02)                       |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025          | 455                     | 1.844                                           | 0,08                         |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025          | 597                     | 1.756                                           | 0,07                         |
|                                                      |       |                  |                         | <b>\$ 4.795</b>                                 | <b>0,19</b>                  |

## VERKAUFSOPTIONEN

## FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Anzahl der<br>Kontrakte | Aufgeld        | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|----------------|----------------|------------------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500         | 25.07.2025         | 19                      | \$ (6)         | \$ (1)         | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000            | 25.07.2025         | 70                      | (31)           | (2)            | 0,00                         |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500            | 25.07.2025         | 19                      | (6)            | (1)            | 0,00                         |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000            | 25.07.2025         | 19                      | (7)            | (14)           | 0,00                         |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500            | 25.07.2025         | 89                      | (35)           | (47)           | 0,00                         |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250          | 25.07.2025         | 7                       | (2)            | (2)            | 0,00                         |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500            | 25.07.2025         | 7                       | (1)            | (1)            | 0,00                         |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | 129,000            | 25.07.2025         | 5                       | (2)            | (2)            | 0,00                         |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500            | 25.07.2025         | 5                       | (3)            | (1)            | 0,00                         |
|                                                                |                    |                    |                         | <b>\$ (93)</b> | <b>\$ (71)</b> | <b>0,00</b>                  |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |                    |                    |                         |                |                | <b>\$ 4.724 0,19</b>         |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-----------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| AT&T, Inc.            | 1,000 %                        | 20.06.2028            | \$ 1.700                       | \$ 46                                           | 0,00                         |
| Bank of America Corp. | 1,000                          | 20.12.2026            | 1.200                          | (3)                                             | 0,00                         |
| Citigroup, Inc.       | 1,000                          | 20.12.2025            | 4.500                          | (12)                                            | 0,00                         |
|                       |                                |                       |                                | <b>\$ 31</b>                                    | <b>0,00</b>                  |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.EM-34 5-Year Index             | 1,000 %                        | 20.12.2025            | \$ 2.208                       | \$ 92                                           | 0,00                         |
| CDX.EM-36 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2026            | 4.508                          | 219                                             | 0,01                         |
| CDX.EM-38 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2027            | 600                            | 52                                              | 0,00                         |
| CDX.EM-39 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2028            | 100                            | 7                                               | 0,00                         |
| CDX.EM-40 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2028            | 1.500                          | 64                                              | 0,00                         |
| CDX.EM-41 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2029            | 500                            | 14                                              | 0,00                         |
| CDX.EM-42 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2029            | 600                            | 9                                               | 0,00                         |
| CDX.EM-43 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2030            | 600                            | 7                                               | 0,00                         |
| CDX.HY-36 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2026            | 1.824                          | (104)                                           | 0,00                         |
| CDX.HY-37 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2026            | 864                            | (3)                                             | 0,00                         |
| CDX.HY-43 5-Year Index             | 5,000                          | 20.12.2029            | 23.100                         | (220)                                           | (0,01)                       |
| CDX.HY-44 5-Year Index             | 5,000                          | 20.06.2030            | 48.300                         | 1.377                                           | 0,06                         |
| CDX.IG-43 5-Year Index             | 1,000                          | 20.12.2029            | 5.300                          | (4)                                             | 0,00                         |
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000                          | 20.06.2030            | 39.600                         | 196                                             | 0,01                         |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                          | 20.06.2030            | € 16.800                       | 59                                              | 0,00                         |
|                                    |                                |                       |                                | <b>\$ 1.765</b>                                 | <b>0,07</b>                  |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 25.000        | \$ (96)                                         | 0,00                         |
| Erhalt             | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,500              | 19.03.2035            | 6.200           | (37)                                            | 0,00                         |
| Erhalt             | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS    | 3,700              | 28.03.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt             | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,000              | 15.03.2029            | ¥ 2.430.000     | 552                                             | 0,02                         |
| Erhalt             | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,020              | 20.09.2028            | 2.950.000       | 566                                             | 0,02                         |
| Zahlung            | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,176              | 27.04.2027            | 160.000         | (11)                                            | 0,00                         |
| Erhalt             | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,400              | 15.06.2032            | 248.400         | 67                                              | 0,00                         |
| Erhalt             | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,500              | 15.03.2042            | 121.000         | 118                                             | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex            | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|-----------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 0,711 %            | 27.04.2042            | ¥ 37.000        | \$ 39                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS | 1,250              | 18.06.2035            | 382.000         | 71                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,500              | 16.06.2026            | \$ 32.900       | 552                                             | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,500              | 16.06.2028            | 26.200          | (926)                                           | (0,04)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,750              | 16.06.2031            | 13.442          | (918)                                           | (0,04)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,750              | 16.06.2031            | 16.200          | 1.224                                           | 0,05                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 0,940              | 08.06.2026            | 2.000           | 64                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000              | 15.06.2027            | 15.700          | (497)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000              | 15.06.2027            | 1.200           | 10                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000              | 15.06.2029            | 2.770           | (159)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,000              | 16.12.2030            | 1.766           | 234                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,235              | 12.05.2028            | 700             | 51                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 15.12.2026            | 34.300          | 1.927                                           | 0,08                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 17.06.2027            | 12.000          | (1.064)                                         | (0,04)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 15.12.2028            | 3.900           | (358)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 17.06.2030            | 47.620          | 3.276                                           | 0,13                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 15.06.2032            | 5.950           | (425)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,250              | 16.06.2051            | 4.300           | (1.325)                                         | (0,05)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,350              | 20.01.2027            | 3.400           | 141                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,360              | 20.07.2031            | 800             | 109                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,370              | 19.07.2031            | 500             | 68                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,380              | 04.01.2027            | 1.400           | (55)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,405              | 07.09.2031            | 1.300           | 175                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,425              | 18.01.2027            | 1.000           | (37)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,443              | 18.01.2027            | 1.100           | (40)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450              | 17.02.2027            | 2.400           | 92                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,450              | 16.07.2031            | 1.200           | 160                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,491              | 21.01.2051            | 900             | (391)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500              | 15.12.2028            | 7.130           | (656)                                           | (0,03)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500              | 12.01.2029            | 578             | 43                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,500              | 05.10.2031            | 600             | (79)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,535              | 15.10.2031            | 600             | (78)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,535              | 22.10.2031            | 400             | (50)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,545              | 26.10.2031            | 400             | (50)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,550              | 20.01.2027            | 15.100          | (514)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,570              | 11.01.2027            | 800             | (28)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,580              | 16.02.2027            | 900             | (30)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,590              | 09.02.2051            | 7.200           | (3.028)                                         | (0,12)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,600              | 16.01.2026            | 6.600           | 92                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,625              | 16.01.2050            | 3.100           | 1.294                                           | 0,05                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,625              | 03.02.2050            | 3.900           | 1.630                                           | 0,07                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,700              | 17.02.2027            | 9.600           | (286)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,700              | 12.01.2029            | 2.100           | (134)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,740              | 16.12.2026            | 1.100           | 42                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.06.2027            | 26.000          | (508)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.06.2029            | 1.209           | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.06.2032            | 1.878           | 48                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 15.06.2032            | 1.840           | (120)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,750              | 22.01.2050            | 7.600           | 3.050                                           | 0,12                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,768              | 02.02.2032            | 300             | (35)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,785              | 12.08.2051            | 700             | 290                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,817              | 05.04.2032            | 2.200           | (227)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,872              | 06.04.2032            | 1.100           | (109)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,875              | 07.02.2050            | 400             | 151                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,895              | 18.10.2049            | 700             | 279                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,910              | 17.10.2049            | 700             | 277                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 1,928              | 25.03.2027            | 1.100           | (35)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2027            | 1.250           | (32)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2029            | 5.740           | (108)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 18.02.2032            | 900             | (87)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 21.12.2032            | 9.130           | (7)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 15.01.2050            | 1.400           | 507                                             | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,000              | 15.12.2051            | 6.500           | (2.872)                                         | (0,12)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,250              | 11.12.2049            | 7.100           | 2.271                                           | 0,09                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,250              | 12.03.2050            | 3.400           | 1.070                                           | 0,04                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,300              | 17.01.2026            | 4.600           | 90                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,850              | 30.08.2027            | 1.000           | (23)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 2,955              | 04.10.2027            | 1.000           | (15)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 19.06.2026            | 32.300          | 1.378                                           | 0,06                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 19.03.2030            | 133.600         | (3.486)                                         | (0,14)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2030            | 2.090           | (21)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2033            | 2.800           | 81                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,000              | 21.06.2033            | 160             | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,050              | 07.09.2027            | 500             | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,050              | 08.09.2029            | 500             | (10)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,050              | 06.09.2032            | 700             | (25)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,080              | 23.02.2053            | 200             | (28)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,100              | 09.09.2029            | 500             | (9)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,231              | 18.09.2034            | 200             | 9                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,232              | 10.09.2034            | 100             | 5                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,240              | 16.09.2034            | 100             | 5                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS     | 3,248              | 18.09.2034            | 200             | 9                                               | 0,00                         |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250 %            | 21.06.2028            | \$ 1.280        | \$ (24)                                         | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,278              | 16.09.2034            | 100             | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,280              | 16.09.2034            | 400             | 17                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300              | 06.03.2033            | 300             | (5)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,300              | 14.06.2033            | 1.000           | (15)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,340              | 23.02.2030            | 600             | (2)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,350              | 14.12.2032            | 200             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,370              | 01.03.2033            | 400             | (5)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,370              | 12.07.2053            | 200             | (20)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,375              | 15.10.2034            | 200             | (5)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,400              | 23.02.2033            | 200             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,405              | 01.03.2033            | 300             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,408              | 05.09.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,410              | 05.09.2034            | 200             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,425              | 01.03.2033            | 300             | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,430              | 27.02.2033            | 300             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,435              | 05.11.2034            | 400             | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,450              | 07.03.2033            | 600             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,450              | 11.10.2034            | 200             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,455              | 01.11.2034            | 400             | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,465              | 30.10.2034            | 500             | (9)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,470              | 22.02.2030            | 600             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,470              | 04.09.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,470              | 01.11.2034            | 400             | (7)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,485              | 30.10.2034            | 400             | (7)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,495              | 30.10.2034            | 200             | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 22.06.2030            | 900             | 6                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 20.12.2030            | 1.190           | (57)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 22.05.2033            | 29.660          | (102)                                           | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 21.06.2033            | 600             | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 20.12.2033            | 860             | 12                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,500              | 18.12.2054            | 29.500          | 1.767                                           | 0,07                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,514              | 04.09.2034            | 200             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,525              | 02.03.2030            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,525              | 04.09.2034            | 200             | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,527              | 15.11.2049            | 140             | 11                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,532              | 20.08.2034            | 200             | 4                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,535              | 06.11.2034            | 800             | (9)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,550              | 21.08.2034            | 300             | 6                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,555              | 28.08.2034            | 200             | 4                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,555              | 05.03.2054            | 100             | (6)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,558              | 21.08.2034            | 200             | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,565              | 28.08.2034            | 200             | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,569              | 14.08.2034            | 200             | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,594              | 09.01.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,595              | 19.08.2034            | 400             | 7                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,599              | 28.08.2034            | 200             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,600              | 17.01.2034            | 200             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,600              | 28.08.2034            | 400             | 6                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,605              | 28.08.2034            | 100             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,610              | 12.12.2032            | 400             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,611              | 28.08.2034            | 500             | 8                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,613              | 22.08.2034            | 200             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620              | 30.11.2029            | 4.872           | (45)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620              | 31.01.2034            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,643              | 28.08.2034            | 200             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,645              | 07.08.2034            | 200             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,648              | 08.01.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650              | 10.07.2033            | 400             | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,650              | 05.03.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,655              | 24.01.2034            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,665              | 24.01.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,670              | 08.01.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,679              | 13.08.2034            | 200             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,684              | 03.01.2034            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,685              | 24.01.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700              | 06.06.2033            | 16.970          | 3                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,700              | 05.03.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,710              | 05.03.2034            | 200             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,715              | 07.08.2034            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,725              | 07.02.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,730              | 03.08.2033            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735              | 07.08.2033            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,735              | 23.01.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,738              | 23.01.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 13.12.2027            | 900             | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2028            | 1.080           | (47)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2029            | 14.200          | 70                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2029            | 4.380           | 62                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2029            | 4.540           | (37)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2031            | 16.910          | (577)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2031            | 1.900           | (13)                                            | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex        | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750 %            | 12.07.2033            | \$ 400          | \$ 2                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 02.01.2034            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 20.06.2034            | 4.200           | 142                                             | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2034            | 70.880          | (711)                                           | (0,03)                       |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 07.05.2035            | 2.100           | 21                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,760              | 23.08.2033            | 500             | 4                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,783              | 07.02.2034            | 100             | 2                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,793              | 19.11.2034            | 400             | 5                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,795              | 06.08.2034            | 200             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800              | 10.03.2028            | 600             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800              | 05.09.2028            | 800             | 10                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800              | 22.08.2030            | 100             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,800              | 30.08.2033            | 200             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,810              | 02.01.2034            | 100             | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,830              | 12.10.2053            | 100             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,840              | 08.01.2035            | 1.200           | 17                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,842              | 04.03.2030            | 2.800           | (42)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,842              | 26.12.2033            | 100             | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,850              | 05.08.2034            | 200             | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,850              | 08.01.2035            | 600             | 9                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,854              | 29.12.2033            | 200             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,855              | 19.11.2034            | 100             | 2                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,860              | 21.02.2034            | 400             | 8                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,860              | 14.11.2034            | 300             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,866              | 14.11.2034            | 700             | 12                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870              | 05.03.2035            | 600             | (7)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,870              | 17.10.2053            | 100             | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,874              | 05.03.2035            | 1.100           | (13)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880              | 10.07.2034            | 500             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,880              | 16.10.2053            | 100             | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,884              | 25.03.2035            | 1.100           | (14)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,885              | 12.07.2034            | 400             | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,890              | 08.01.2035            | 600             | 11                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,890              | 03.03.2035            | 600             | (7)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,896              | 08.01.2035            | 1.200           | 23                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 30.08.2033            | 600             | 12                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 10.04.2034            | 200             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 15.04.2034            | 100             | 2                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,900              | 08.01.2035            | 1.200           | 23                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,905              | 12.03.2035            | 1.100           | (16)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,908              | 04.03.2035            | 1.100           | (16)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,930              | 24.03.2035            | 2.200           | (37)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,933              | 06.01.2035            | 1.300           | 29                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,940              | 22.02.2029            | 700             | 14                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950              | 13.09.2033            | 600             | 14                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950              | 19.12.2033            | 200             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,950              | 16.04.2034            | 200             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970              | 27.02.2029            | 200             | 4                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,970              | 15.01.2035            | 600             | 15                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,975              | 21.03.2035            | 1.800           | (37)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,994              | 02.07.2034            | 300             | (5)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,000              | 26.02.2035            | 1.700           | (38)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,015              | 30.12.2034            | 1.300           | 39                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030              | 04.10.2033            | 500             | 15                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,030              | 15.12.2033            | 200             | (5)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,060              | 02.07.2034            | 200             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,078              | 29.04.2034            | 200             | 7                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,080              | 17.04.2034            | 200             | 7                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,080              | 05.06.2034            | 200             | (6)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,085              | 22.04.2034            | 200             | 8                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,090              | 30.04.2034            | 700             | 26                                              | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,100              | 15.11.2052            | 1.260           | (31)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,105              | 24.04.2034            | 400             | 16                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,130              | 03.05.2034            | 200             | 8                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150              | 12.10.2033            | 200             | 8                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,150              | 22.04.2034            | 200             | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,155              | 02.10.2033            | 400             | 16                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,165              | 27.09.2033            | 600             | 25                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,170              | 03.10.2033            | 400             | 17                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,175              | 10.10.2033            | 200             | 8                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,200              | 18.10.2033            | 200             | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,220              | 20.10.2033            | 200             | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,230              | 23.10.2033            | 100             | 5                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 20.03.2029            | 620             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,250              | 22.11.2033            | 200             | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,255              | 23.10.2033            | 100             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,393              | 25.10.2033            | 100             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,435              | 01.11.2033            | 100             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,450              | 31.10.2033            | 100             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 4,450              | 01.11.2033            | 300             | 20                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                | 9,874              | 02.01.2026            | BRL 1.200       | (12)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                | 9,899              | 02.01.2026            | 600             | (6)                                             | 0,00                         |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 9,939 %            | 02.01.2026            | BRL 1.100       | \$ (11)                                         | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 9,998              | 04.01.2027            | 1.900           | (26)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,037             | 04.01.2027            | 500             | (7)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,041             | 04.01.2027            | 1.500           | (21)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,052             | 02.01.2026            | 1.800           | (17)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,072             | 04.01.2027            | 1.490           | (17)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,085             | 02.01.2026            | 1.800           | (17)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,090             | 04.01.2027            | 2.800           | (38)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,098             | 04.01.2027            | 4.490           | (52)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,105             | 02.01.2026            | 1.800           | (17)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,138             | 04.01.2027            | 700             | (9)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,165             | 04.01.2027            | 2.280           | (26)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,170             | 04.01.2027            | 3.800           | (43)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,183             | 04.01.2027            | 6.830           | (76)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,203             | 04.01.2027            | 5.320           | (59)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,210             | 04.01.2027            | 770             | (9)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,256             | 04.01.2027            | 5.310           | (58)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 10,328             | 04.01.2027            | 3.980           | (42)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,250             | 04.01.2027            | 1.500           | (18)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,275             | 04.01.2027            | 700             | (8)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,290             | 04.01.2027            | 800             | (9)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,731             | 04.01.2027            | 400             | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,746             | 04.01.2027            | 1.700           | (14)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,901             | 04.01.2027            | 4.000           | (29)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2025            | CAD 5.300       | 112                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month NZD-BBR                     | 4,750              | 19.06.2029            | NZD 2.000       | 47                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,000              | 03.01.2031            | ZAR 5.700       | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,001              | 06.01.2031            | 5.700           | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,010              | 07.01.2031            | 5.600           | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,030              | 07.01.2031            | 5.600           | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,053              | 07.01.2031            | 5.600           | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,058              | 07.01.2031            | 5.600           | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,063              | 08.01.2031            | 16.900          | 28                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,080              | 08.01.2031            | 7.900           | 14                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,203              | 10.01.2031            | 28.200          | 58                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,360              | 07.08.2028            | 500             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,380              | 04.08.2028            | 400             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,400              | 07.08.2028            | 500             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410              | 31.07.2028            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410              | 04.08.2028            | 1.100           | 2                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,410              | 07.08.2028            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,415              | 31.07.2028            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,415              | 04.08.2028            | 400             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,420              | 31.07.2028            | 300             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,421              | 04.08.2028            | 500             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,426              | 01.08.2028            | 100             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,428              | 31.07.2028            | 200             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,460              | 01.08.2028            | 200             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,460              | 02.08.2028            | 200             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,464              | 02.08.2028            | 200             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,543              | 04.08.2028            | 500             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR                   | 8,550              | 03.08.2028            | 800             | 2                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 2,750              | 17.06.2026            | AUD 460         | (6)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 3,000              | 21.03.2027            | 18.640          | (509)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,000              | 18.09.2029            | 9.400           | 11                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500              | 20.09.2033            | 300             | 9                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500              | 20.03.2034            | 2.600           | 77                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500              | 18.09.2034            | 3.300           | 39                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500              | 18.06.2035            | 69.450          | 808                                             | 0,03                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,250              | 18.03.2050            | € 2.300         | 1.124                                           | 0,05                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,329              | 30.12.2025            | 100             | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 0,830              | 09.12.2052            | 6.800           | 751                                             | 0,03                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,000              | 21.09.2032            | 11.880          | (461)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,220              | 08.01.2035            | 700             | (25)                                            | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250              | 17.09.2030            | 18.250          | 222                                             | 0,01                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250              | 17.09.2035            | 2.500           | (23)                                            | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250              | 17.09.2055            | 45.300          | 2.094                                           | 0,09                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,280              | 04.03.2030            | 700             | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,300              | 25.09.2029            | 200             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,350              | 29.04.2030            | 800             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,360              | 07.10.2029            | 700             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,380              | 31.12.2034            | 200             | (2)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,390              | 01.10.2034            | 100             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,400              | 09.04.2030            | 1.000           | (6)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,400              | 12.02.2035            | 700             | 15                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,420              | 07.03.2035            | 700             | (10)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,450              | 05.05.2035            | 600             | 10                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,460              | 01.04.2035            | 700             | (7)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,510              | 09.04.2035            | 600             | 7                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520              | 27.03.2035            | 700             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,520              | 09.04.2035            | 600             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,547              | 09.03.2033            | 800             | 23                                              | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,550 %            | 16.04.2035            | € 600           | \$ 4                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,580              | 29.08.2034            | 100             | (2)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,590              | 19.08.2034            | 100             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,610              | 24.03.2035            | 700             | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,650              | 14.08.2029            | 200             | (7)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,700              | 13.08.2029            | 100             | (4)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,750              | 05.03.2034            | 200             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,760              | 04.03.2034            | 200             | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,770              | 16.04.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,770              | 29.04.2034            | 100             | 3                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,780              | 02.05.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,827              | 06.05.2029            | 200             | 6                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,860              | 24.04.2029            | 200             | 7                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 2,950              | 12.06.2029            | 200             | 7                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,270              | 21.08.2033            | 200             | 19                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,300              | 03.10.2033            | 500             | 48                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,370              | 09.10.2028            | 300             | 21                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR    | 3,450              | 20.10.2028            | 300             | 22                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 8,990              | 18.12.2029            | MXN 8.500       | 23                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,020              | 17.12.2029            | 11.300          | 32                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,108              | 13.03.2030            | 44.600          | 137                                             | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,135              | 27.12.2029            | 10.400          | 32                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE        | 9,150              | 31.12.2029            | 10.600          | 33                                              | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,000              | 15.09.2031            | £ 300           | (41)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,020              | 15.10.2031            | 400             | (51)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,055              | 15.09.2031            | 400             | (53)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,066              | 15.09.2031            | 600             | (69)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,140              | 15.10.2031            | 1.000           | (111)                                           | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,250              | 15.11.2031            | 900             | (73)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | UKRPI                  | 4,400              | 15.10.2031            | 400             | (33)                                            | 0,00                         |
|                                                |                        |                    |                       |                 | \$ 7.566                                        | 0,31                         |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                        |                    |                       |                 | \$ 9.362                                        | 0,38                         |

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung             | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Put - OTC USD versus USD | \$ 1,150           | 27.08.2025         | 8.700                          | \$ 54  | \$ 44          | 0,00                         |
|            | Put - OTC EUR versus USD | 1,150              | 29.08.2025         | 34.800                         | 218    | 182            | 0,01                         |
|            |                          |                    |                    |                                | \$ 272 | \$ 226         | 0,01                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| UAG        | Put - OTC USD versus TRY  | TRY 40,575         | 19.08.2025         | 100                            | \$ (3)  | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 52,725             | 19.08.2025         | 100                            | (2)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC USD versus TRY  | 41,600             | 12.11.2025         | 100                            | (4)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC USD versus TRY | 56,900             | 12.11.2025         | 100                            | (3)     | 0              | 0,00                         |
|            |                           |                    |                    |                                | \$ (12) | \$ (3)         | 0,00                         |

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,555 %            | 24.07.2025         | 1.200                          | \$ (4)  | \$ (4)         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,637              | 18.07.2025         | 1.100                          | (3)     | (6)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,700              | 21.07.2025         | 1.100                          | (4)     | (9)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,770              | 09.07.2025         | 1.200                          | (4)     | (11)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,905              | 24.07.2025         | 1.200                          | (4)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,037              | 18.07.2025         | 1.100                          | (3)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                        |                                             |                    |                    |                                |         |                |                              |

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld  | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050 %            | 21.07.2025         | 1.100                          | \$ (4)   | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120              | 09.07.2025         | 1.200                          | (4)      | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564              | 24.07.2025         | 1.200                          | (4)      | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605              | 23.07.2025         | 1.100                          | (4)      | (5)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914              | 24.07.2025         | 1.200                          | (4)      | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955              | 23.07.2025         | 1.100                          | (4)      | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380              | 03.07.2025         | 500                            | (1)      | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 700                            | (2)      | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640              | 03.07.2025         | 500                            | (1)      | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 700                            | (2)      | (1)            | 0,00                         |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,750              | 03.07.2025         | 2.000                          | (7)      | (14)           | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,790              | 09.07.2025         | 1.300                          | (4)      | (14)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,100              | 03.07.2025         | 2.000                          | (7)      | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,140              | 09.07.2025         | 1.300                          | (4)      | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525              | 28.07.2025         | 1.100                          | (4)      | (4)            | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583              | 23.07.2025         | 600                            | (2)      | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,653              | 14.07.2025         | 1.100                          | (3)      | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680              | 07.07.2025         | 600                            | (2)      | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695              | 17.07.2025         | 1.100                          | (3)      | (8)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775              | 07.07.2025         | 1.200                          | (4)      | (11)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875              | 28.07.2025         | 1.100                          | (4)      | (3)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933              | 23.07.2025         | 600                            | (2)      | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030              | 07.07.2025         | 600                            | (2)      | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,053              | 14.07.2025         | 1.100                          | (3)      | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095              | 17.07.2025         | 1.100                          | (3)      | 0              | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125              | 07.07.2025         | 1.200                          | (4)      | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772              | 10.07.2025         | 1.100                          | (4)      | (10)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122              | 10.07.2025         | 1.100                          | (4)      | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,664              | 14.07.2025         | 1.100                          | (3)      | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669              | 07.07.2025         | 1.200                          | (5)      | (4)            | 0,00                         |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697              | 16.07.2025         | 1.100                          | (3)      | (7)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715              | 02.07.2025         | 1.200                          | (4)      | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725              | 03.07.2025         | 1.200                          | (5)      | (6)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019              | 07.07.2025         | 1.200                          | (5)      | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,064              | 14.07.2025         | 1.100                          | (3)      | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065              | 02.07.2025         | 1.200                          | (4)      | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075              | 03.07.2025         | 1.200                          | (5)      | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097              | 16.07.2025         | 1.100                          | (3)      | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ (158) | \$ (150)       | (0,01)                       |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | \$ 92,469          | 07.07.2025         | 500                            | \$ (3)  | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469             | 07.07.2025         | 500                            | (2)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                                                               |                    |                    |                                | \$ (5)  | \$ 0           | 0,00                         |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                        | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Colombia Government International Bond | 1,000 %                        | 20.12.2027            | \$ 200                         | \$ (18)                                      | \$ 17                                           | \$ (1)         | 0,00                         |
| BRC        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026            | 300                            | (14)                                         | 14                                              | 0              | 0,00                         |
| CBK        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2027            | 100                            | (3)                                          | 3                                               | 0              | 0,00                         |
| GST        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2027            | 100                            | (4)                                          | 4                                               | 0              | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2027            | 100                            | (9)                                          | 8                                               | (1)            | 0,00                         |
| JPM        | Mexico Government International Bond   | 1,000                          | 20.12.2028            | 300                            | (3)                                          | 5                                               | 2              | 0,00                         |
|            | Petroleos Mexicanos                    | 3,750                          | 24.12.2025            | 700                            | 0                                            | 1                                               | 1              | 0,00                         |
|            | Petroleos Mexicanos                    | 4,850                          | 07.05.2026            | 15.552                         | 0                                            | 191                                             | 191            | 0,01                         |
|            | SoftBank Group Corp.                   | 1,000                          | 20.06.2026            | 700                            | (6)                                          | 3                                               | (3)            | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond   | 1,000                          | 20.06.2026            | 300                            | (2)                                          | 4                                               | 2              | 0,00                         |
| MYC        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2027            | 200                            | (7)                                          | 6                                               | (1)            | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2027            | 200                            | (18)                                         | 16                                              | (2)            | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond   | 1,000                          | 20.12.2025            | 100                            | (1)                                          | 1                                               | 0              | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond   | 1,000                          | 20.12.2026            | 1.100                          | 3                                            | 5                                               | 8              | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond   | 1,000                          | 20.06.2027            | 400                            | (1)                                          | 5                                               | 4              | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond   | 1,000                          | 20.06.2028            | 300                            | (6)                                          | 9                                               | 3              | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond   | 1,000                          | 20.12.2028            | 1.300                          | (14)                                         | 24                                              | 10             | 0,00                         |
|            |                                        |                                |                       |                                | \$ (103)                                     | \$ 316                                          | \$ 213         | 0,01                         |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BOA        | ABX.HE.AAA.6-2 Index             | 0,110 %                        | 25.05.2046            | \$ 254                         | \$ (62)                                      | \$ 42                                           | \$ (20)        | 0,00                         |
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000                          | 20.12.2029            | € 984                          | 193                                          | 20                                              | 213            | 0,01                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Index/Tranchen       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| DUB        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 %                        | 17.11.2059            | \$ 400                         | \$ (6)                                       | \$ 8                                            | \$ 2           | 0,00                         |
| GST        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                          | 17.11.2059            | 6.850                          | 14                                           | 15                                              | 29             | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500                          | 18.11.2054            | 7.300                          | (38)                                         | 82                                              | 44             | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.6 Index  | 0,500                          | 11.05.2063            | 1                              | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500                          | 17.10.2057            | 158                            | (2)                                          | 2                                               | 0              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.9 Index  | 0,500                          | 17.09.2058            | 214                            | (9)                                          | 9                                               | 0              | 0,00                         |
| MEI        | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                          | 17.08.2061            | 500                            | (4)                                          | 7                                               | 3              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500                          | 17.10.2057            | 4                              | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.9 Index  | 0,500                          | 17.09.2058            | 428                            | (34)                                         | 34                                              | 0              | 0,00                         |
| MYC        | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110                          | 25.05.2046            | 402                            | (98)                                         | 66                                              | (32)           | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                          | 17.08.2061            | 500                            | (4)                                          | 7                                               | 3              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.6 Index  | 0,500                          | 11.05.2063            | 1                              | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500                          | 17.10.2057            | 2                              | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
| SAL        | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500                          | 17.11.2059            | 2.075                          | 17                                           | (8)                                             | 9              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500                          | 18.11.2054            | 1.200                          | 6                                            | 1                                               | 7              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500                          | 17.08.2061            | 325                            | 0                                            | 2                                               | 2              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.6 Index  | 0,500                          | 11.05.2063            | 1                              | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
|            | CMBX.NA.AAA.9 Index  | 0,500                          | 17.09.2058            | 11.052                         | 11                                           | (3)                                             | 8              | 0,00                         |
| UAG        | CMBX.NA.AAA.8 Index  | 0,500                          | 17.10.2057            | 2                              | 0                                            | 0                                               | 0              | 0,00                         |
|            |                      |                                |                       |                                | \$ (16)                                      | \$ 284                                          | \$ 268         | 0,01                         |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CNH                    | 25.178                   | \$ 3.495                         | \$ 0                               | \$ (24)                                              | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | 790                      | 925                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 40.818                   | AUD 62.835                       | 361                                | 361                                                  | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 505                      | € 444                            | 17                                 | 17                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.227                    | £ 894                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.037                    | NZD 1.724                        | 9                                  | 9                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | AUD                    | 62.835                   | \$ 40.842                        | 0                                  | (363)                                                | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | CNH                    | 33.620                   | 4.674                            | 0                                  | (37)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | £                      | 894                      | 1.227                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | NZD                    | 1.724                    | 1.038                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 927                      | € 790                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025               | AUD                    | 22.602                   | \$ 14.638                        | 0                                  | (174)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | €                      | 442.214                  | 502.819                          | 0                                  | (16.274)                                             | (0,67)                       |
|            | 07.2025               | PEN                    | 1.300                    | 358                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 609                      | IDR 9.942.040                    | 3                                  | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.253                    | KRW 1.707.508                    | 10                                 | 10                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 293                      | SGD 375                          | 2                                  | 2                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 5.809                    | \$ 812                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 374                      | 293                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 456                      | 14                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025               | NOK                    | 1.815                    | 179                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 730                      | 22                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TRY                    | 62.562                   | 1.553                            | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 96.393                   | 2.966                            | 0                                  | (352)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 3.928                    | BRL 22.280                       | 154                                | 154                                                  | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 39                       | € 34                             | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.488                    | IDR 24.280.247                   | 7                                  | 7                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 100                      | THB 3.275                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 426                      | TWD 12.676                       | 10                                 | 10                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 7.472                    | \$ 1.046                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TRY                    | 3.875                    | 93                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 80.607                   | 2.473                            | 0                                  | (329)                                                | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 883                      | INR 76.735                       | 10                                 | 10                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 99                       | TWD 3.237                        | 14                                 | 14                                                   | 0,00                         |
|            | 05.2026               |                        | 62                       | KWD 19                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 06.2026               |                        | 44                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 06.2027               |                        | 22                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 05.2029               | KWD                    | 93                       | \$ 320                           | 14                                 | 14                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2029               |                        | 12                       | 40                               | 2                                  | 2                                                    | 0,00                         |
|            | 05.2030               |                        | 69                       | 237                              | 9                                  | 9                                                    | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               | CAD                    | 47                       | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 894                      | 1.229                            | 4                                  | 4                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                    | 6.031                    | 1.732                            | 0                                  | (59)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 151.227                  | 111                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | PLN                    | 69                       | 18                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SEK                    | 1.245                    | 130                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TRY                    | 78.549                   | 1.934                            | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                         |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|--------|
| BSH        | 07.2025               | \$                     | 2.331                    | €                                | 2.036                              | \$                                                   | 59                        | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 95.320                   | £                                | 70.070                             |                                                      | 700                       | 0,03   |
|            | 07.2025               |                        | 859                      | ILS                              | 2.900                              |                                                      | 2                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 6.000                    | ¥                                | 862.880                            |                                                      | (26)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 16                       | KRW                              | 21.603                             |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 109                      | PLN                              | 407                                |                                                      | 4                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 15.860                   | TRY                              | 645.163                            |                                                      | 255                       | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 4.513                    | ZAR                              | 81.518                             |                                                      | 67                        | 0,00   |
|            | 08.2025               | £                      | 68.794                   | \$                               | 93.615                             |                                                      | (671)                     | (0,03) |
|            | 08.2025               | \$                     | 231                      | TRY                              | 9.590                              |                                                      | 3                         | 0,00   |
|            | 07.2025               | PEN                    | 380                      | \$                               | 102                                |                                                      | (5)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 756                      | PEN                              | 2.713                              |                                                      | 9                         | 0,00   |
| CBK        | 09.2025               | PEN                    | 1.302                    | \$                               | 364                                |                                                      | (2)                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | \$                     | 99                       | PEN                              | 358                                |                                                      | 2                         | 0,00   |
|            | 12.2025               | PEN                    | 1.419                    | \$                               | 392                                |                                                      | (6)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | AUD                    | 790                      |                                  | 514                                |                                                      | (4)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | CAD                    | 666                      |                                  | 482                                |                                                      | (6)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | €                      | 2.432                    |                                  | 2.848                              |                                                      | (6)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | KRW                    | 12.608.003               |                                  | 9.188                              |                                                      | (134)                     | (0,01) |
|            | 07.2025               | PEN                    | 1.034                    |                                  | 280                                |                                                      | (12)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | THB                    | 38.213                   |                                  | 1.149                              |                                                      | (28)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | TWD                    | 165.823                  |                                  | 5.097                              |                                                      | (612)                     | (0,03) |
|            | 07.2025               | \$                     | 37.907                   | BRL                              | 221.656                            |                                                      | 2.706                     | 0,11   |
|            | 07.2025               |                        | 2.356                    | CNY                              | 16.888                             |                                                      | 2                         | 0,00   |
| DUB        | 07.2025               |                        | 18.820                   | £                                | 13.886                             |                                                      | 209                       | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 1.285                    | IDR                              | 20.917.799                         |                                                      | 4                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 109                      | PEN                              | 394                                |                                                      | 2                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 7.345                    | TWD                              | 218.373                            |                                                      | 172                       | 0,01   |
|            | 08.2025               | CNH                    | 8.016                    | \$                               | 1.115                              |                                                      | (8)                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | PEN                    | 55                       |                                  | 15                                 |                                                      | (1)                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | TWD                    | 181.288                  |                                  | 5.562                              |                                                      | (739)                     | (0,03) |
|            | 08.2025               | \$                     | 6.610                    | INR                              | 569.766                            |                                                      | (4)                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | MXN                    | 3.234                    | \$                               | 169                                |                                                      | (1)                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | PEN                    | 19.006                   |                                  | 5.142                              |                                                      | (203)                     | (0,01) |
|            | 12.2025               |                        | 2.827                    |                                  | 764                                |                                                      | (30)                      | 0,00   |
|            | 02.2026               |                        | 3.461                    |                                  | 942                                |                                                      | (27)                      | 0,00   |
| FAR        | 07.2025               | ILS                    | 2.929                    |                                  | 845                                |                                                      | (25)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | KRW                    | 136.362                  |                                  | 100                                |                                                      | (1)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 493.868                  | €                                | 425.712                            |                                                      | 5.854                     | 0,24   |
|            | 07.2025               |                        | 95                       | IDR                              | 1.539.127                          |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 370                      | TWD                              | 10.997                             |                                                      | 9                         | 0,00   |
|            | 08.2025               | €                      | 424.779                  | \$                               | 493.868                            |                                                      | (5.846)                   | (0,24) |
|            | 08.2025               | \$                     | 3.064                    | INR                              | 264.399                            |                                                      | (1)                       | 0,00   |
|            | 09.2025               | MXN                    | 0                        | \$                               | 0                                  |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 07.2025               | AUD                    | 31.484                   |                                  | 20.314                             |                                                      | (320)                     | (0,01) |
|            | 07.2025               | BRL                    | 82.720                   |                                  | 14.468                             |                                                      | (688)                     | (0,03) |
|            | 07.2025               | CHF                    | 4.429                    |                                  | 5.378                              |                                                      | (186)                     | (0,01) |
|            | 07.2025               | CNH                    | 12.808                   |                                  | 1.782                              |                                                      | (8)                       | 0,00   |
| GLM        | 07.2025               | ¥                      | 3.388.358                |                                  | 23.278                             |                                                      | (180)                     | (0,01) |
|            | 07.2025               | SGD                    | 136                      |                                  | 106                                |                                                      | (1)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 5.525                    | CHF                              | 4.423                              |                                                      | 32                        | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 36.763                   | ¥                                | 5.273.967                          |                                                      | (251)                     | (0,01) |
|            | 07.2025               |                        | 1.373                    | PLN                              | 5.063                              |                                                      | 28                        | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 236                      | SGD                              | 300                                |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 08.2025               | CHF                    | 4.405                    | \$                               | 5.525                              |                                                      | (32)                      | 0,00   |
|            | 08.2025               | CNH                    | 7.886                    |                                  | 1.102                              |                                                      | (3)                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | SGD                    | 300                      |                                  | 236                                |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.464                    | INR                              | 126.631                            |                                                      | 9                         | 0,00   |
|            | 08.2025               |                        | 23.278                   | ¥                                | 3.375.897                          |                                                      | 180                       | 0,01   |
|            | 09.2025               |                        | 11.666                   | MXN                              | 227.154                            |                                                      | 261                       | 0,01   |
| JPM        | 09.2025               |                        | 0                        | PEN                              | 1                                  |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 11.2025               | PEN                    | 14.538                   | \$                               | 3.971                              |                                                      | (110)                     | 0,00   |
|            | 07.2025               | BRL                    | 154.016                  |                                  | 27.931                             |                                                      | (288)                     | (0,01) |
|            | 07.2025               | TWD                    | 15.569                   |                                  | 479                                |                                                      | (57)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 304                      | IDR                              | 4.961.795                          |                                                      | 1                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 91                       | SGD                              | 117                                |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 75                       | TWD                              | 2.434                              |                                                      | 9                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 24                       | ZAR                              | 429                                |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 08.2025               | SGD                    | 116                      | \$                               | 91                                 |                                                      | 0                         | 0,00   |
|            | 09.2025               | \$                     | 27.931                   | BRL                              | 156.397                            |                                                      | 293                       | 0,01   |
|            | 07.2025               |                        | 132                      | SEK                              | 1.247                              |                                                      | (1)                       | 0,00   |
|            | 08.2025               | SEK                    | 1.244                    | \$                               | 132                                |                                                      | 1                         | 0,00   |
| IND        | 07.2025               | BRL                    | 7.490                    |                                  | 1.361                              |                                                      | (11)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | CNH                    | 24.266                   |                                  | 3.362                              |                                                      | (29)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | KRW                    | 649.175                  |                                  | 474                                |                                                      | (6)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | NZD                    | 1.548                    |                                  | 923                                |                                                      | (17)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | PLN                    | 741                      |                                  | 197                                |                                                      | (8)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               | SGD                    | 2.586                    |                                  | 2.013                              |                                                      | (17)                      | 0,00   |
|            | 07.2025               | TWD                    | 97.567                   |                                  | 3.000                              |                                                      | (359)                     | (0,01) |
|            | 07.2025               | \$                     | 8.698                    | AUD                              | 13.271                             |                                                      | (1)                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 3.635                    | PLN                              | 13.504                             |                                                      | 101                       | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 192                      | SGD                              | 246                                |                                                      | 1                         | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 494                      | TWD                              | 14.677                             |                                                      | 11                        | 0,00   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |           |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|-----------|--------|
| MBC        | 07.2025               | \$                     | 727                      | ZAR                              | 12.995                             | \$                                                   | 3                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | AUD                    | 13.271                   | \$                               | 8.703                              |                                                      | 1                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | CNH                    | 30.969                   |                                  | 4.303                              | (37)                                                 | (37)                         | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | SGD                    | 245                      |                                  | 192                                | (1)                                                  | (1)                          | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | TWD                    | 91.989                   |                                  | 2.822                              | (375)                                                | (375)                        | (0,02)    |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 987                      | INR                              | 85.583                             |                                                      | 8                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               |                        | 88                       | TWD                              | 2.891                              |                                                      | 12                           | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | AUD                    | 21.230                   | \$                               | 13.776                             | (137)                                                | (137)                        | (0,01)    |        |
|            | 07.2025               | CAD                    | 31.252                   |                                  | 22.754                             | (149)                                                | (149)                        | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | CNH                    | 11.633                   |                                  | 1.614                              | (12)                                                 | (12)                         | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | ¥                      | 323.600                  |                                  | 2.223                              | (18)                                                 | (18)                         | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | PLN                    | 529                      |                                  | 141                                | (5)                                                  | (5)                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | SGD                    | 6.212                    |                                  | 4.843                              | (35)                                                 | (35)                         | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | THB                    | 19.182                   |                                  | 580                                | (11)                                                 | (11)                         | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | TWD                    | 47.139                   |                                  | 1.446                              | (176)                                                | (176)                        | (0,01)    |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 24.256                   | CAD                              | 33.343                             |                                                      | 179                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               |                        | 17.131                   | €                                | 14.809                             |                                                      | 252                          | 0,01      |        |
|            | 07.2025               |                        | 2.369                    | £                                | 1.749                              |                                                      | 27                           | 0,00      |        |
|            | 07.2025               |                        | 310                      | IDR                              | 5.034.129                          |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | MYI                   | 07.2025                |                          | 1.181                            | ¥                                  | 169.635                                              | (7)                          | (7)       | 0,00   |
| 07.2025    |                       |                        | 835                      | PLN                              | 3.125                              |                                                      | 30                           | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       |                        | 5.062                    | SGD                              | 6.547                              |                                                      | 78                           | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       |                        | 1.183                    | TWD                              | 37.433                             |                                                      | 105                          | 0,00      |        |
| 08.2025    |                       | CAD                    | 33.287                   | \$                               | 24.256                             | (179)                                                | (179)                        | 0,00      |        |
| 08.2025    |                       | CNH                    | 18.903                   |                                  | 2.624                              | (25)                                                 | (25)                         | 0,00      |        |
| 08.2025    |                       | SGD                    | 6.532                    |                                  | 5.062                              | (79)                                                 | (79)                         | 0,00      |        |
| 08.2025    |                       | TWD                    | 70.149                   |                                  | 2.164                              | (275)                                                | (275)                        | (0,01)    |        |
| 07.2025    |                       | €                      | 209                      |                                  | 245                                |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       | £                      | 128                      |                                  | 175                                |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       | ¥                      | 1.078.330                |                                  | 7.394                              | (71)                                                 | (71)                         | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       | \$                     | 166                      | €                                | 142                                |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       |                        | 14                       | £                                | 10                                 |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       |                        | 825                      | ¥                                | 119.137                            |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       |                        | 272                      | NOK                              | 2.744                              | (1)                                                  | (1)                          | 0,00      |        |
| 07.2025    |                       |                        | 7                        | PLN                              | 26                                 |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
| 08.2025    |                       | CNH                    | 8.038                    | \$                               | 1.123                              | (4)                                                  | (4)                          | 0,00      |        |
| 08.2025    |                       | NOK                    | 2.744                    |                                  | 272                                |                                                      | 1                            | 0,00      |        |
| 08.2025    |                       | \$                     | 7.394                    | ¥                                | 1.074.366                          |                                                      | 71                           | 0,00      |        |
| RYL<br>SCX |                       | 08.2025                |                          | 1.475                            | TWD                                | 47.804                                               |                              | 187       | 0,01   |
|            | 08.2025               |                        | 2.001                    | CNH                              | 14.495                             |                                                      | 30                           | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | CAD                    | 1.365                    | \$                               | 991                                | (9)                                                  | (9)                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | CNY                    | 16.927                   |                                  | 2.363                              |                                                      | 1                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | ILS                    | 45                       |                                  | 13                                 |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | ¥                      | 1.119                    |                                  | 8                                  |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | NZD                    | 176                      |                                  | 106                                | (1)                                                  | (1)                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | TWD                    | 2.664                    |                                  | 91                                 |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.416                    | IDR                              | 23.075.717                         |                                                      | 5                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               |                        | 1.011                    | SGD                              | 1.304                              |                                                      | 13                           | 0,00      |        |
|            | 07.2025               |                        | 3.704                    | TWD                              | 108.486                            |                                                      | 30                           | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | CNH                    | 13.848                   | \$                               | 1.939                              | (2)                                                  | (2)                          | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | SGD                    | 1.301                    |                                  | 1.011                              | (13)                                                 | (13)                         | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | TWD                    | 26.477                   |                                  | 811                                | (109)                                                | (109)                        | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 8.723                    | CNH                              | 63.170                             |                                                      | 129                          | 0,01      |        |
|            | 08.2025               |                        | 2.363                    | CNY                              | 16.881                             |                                                      | 1                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               |                        | 1.033                    | INR                              | 88.713                             | (1)                                                  | (1)                          | 0,00      |        |
|            | 08.2025               |                        | 8                        | ¥                                | 1.115                              |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | ¥                      | 130.806                  | \$                               | 906                                |                                                      | 1                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 104                      | €                                | 91                                 |                                                      | 2                            | 0,00      |        |
| SOG        | 07.2025               |                        | 28                       | NOK                              | 286                                |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | NOK                    | 286                      | \$                               | 28                                 |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 6                        | INR                              | 511                                |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               |                        | 906                      | ¥                                | 130.326                            | (1)                                                  | (1)                          | 0,00      |        |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    | (1.400 )                                             | (1.400 )                     | (0,06)    |        |
|            | 07.2025               | £                      | 85.705                   | \$                               | 116.046                            |                                                      |                              | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 4.029                    | €                                | 3.474                              |                                                      | 49                           | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | TWD                    | 51.593                   | \$                               | 1.764                              | (30)                                                 | (30)                         | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | CLP                    | 807.904                  |                                  | 863                                | (2)                                                  | (2)                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | ILS                    | 443                      |                                  | 124                                | (8)                                                  | (8)                          | 0,00      |        |
| UAG        | 07.2025               | KRW                    | 104.813                  |                                  | 77                                 |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | THB                    | 3.046                    |                                  | 92                                 | (2)                                                  | (2)                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 865                      | CLP                              | 812.313                            |                                                      | 5                            | 0,00      |        |
|            | 07.2025               |                        | 77                       | KRW                              | 104.864                            |                                                      | 0                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               |                        | 20                       | TRY                              | 893                                |                                                      | 2                            | 0,00      |        |
|            | 09.2025               |                        | 171                      | MXN                              | 3.309                              |                                                      | 3                            | 0,00      |        |
|            | 11.2025               |                        | 17                       | TRY                              | 801                                |                                                      | 1                            | 0,00      |        |
|            | 12.2025               | MXN                    | 27.264                   | \$                               | 1.408                              | (9)                                                  | (9)                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | €                      | 3.471                    |                                  | 4.071                              | (4)                                                  | (4)                          | 0,00      |        |
|            | 07.2025               | ¥                      | 1.503.007                |                                  | 10.437                             |                                                      | 31                           | 0,00      |        |
| WST        | 07.2025               | NOK                    | 1.215                    |                                  | 119                                | (1)                                                  | (1)                          | 0,00      |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 4.080                    | €                                | 3.471                              |                                                      | 4                            | 0,00      |        |
|            | 08.2025               |                        | 10.437                   | ¥                                | 1.497.476                          | (31)                                                 | (31)                         | 0,00      |        |
|            |                       |                        |                          |                                  | \$                                 | 12.913                                               | \$                           | (31.878 ) | (0,77) |
|            |                       |                        |                          |                                  |                                    |                                                      | \$                           | (18.965 ) |        |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend und Class Z EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

|            | Abrechnungs- | Zu zahlende | Zu erhaltende | Nicht realisierte | Nicht realisierte | Nicht realisierte               | % des               |
|------------|--------------|-------------|---------------|-------------------|-------------------|---------------------------------|---------------------|
| Kontrahent | monat        | Währung     | Währung       | Wertzunahme       | (Wertabnahme)     | Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | Netto-<br>vermögens |
| AZD        | 07.2025      | €           | 442.035       | \$                | 517.570           | \$ 0                            | (0,05)              |
|            | 07.2025      |             | 9.617         | AUD               | 14.804            | 85                              | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 36            | CHF               | 29                | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 44.283        | €                 | 38.974            | 1.467                           | 0,06                |
|            | 08.2025      | AUD         | 14.804        | \$                | 9.622             | 0                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | CHF         | 29            |                   | 36                | 0                               | 0,00                |
| BOA        | 08.2025      | \$          | 518.704       | €                 | 442.035           | 1.311                           | 0,05                |
|            | 07.2025      |             | 532.557       |                   | 468.368           | 17.237                          | 0,71                |
|            | 07.2025      |             | 188           | SGD               | 240               | 1                               | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 780           | ZAR               | 13.916            | 3                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | SGD         | 240           | \$                | 188               | 0                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | ZAR         | 13.950        |                   | 780               | 0                               | 0,00                |
| BPS        | 07.2025      | CAD         | 1.850         |                   | 1.343             | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | €           | 995           |                   | 1.142             | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | \$          | 15            | KRW               | 20.758            | 0                               | 0,00                |
| BRC        | 07.2025      | CHF         | 2.758         | \$                | 3.338             | 0                               | (0,01)              |
|            | 07.2025      | £           | 1.910         |                   | 2.579             | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | INR         | 163.443       |                   | 1.889             | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | MYR         | 7.738         |                   | 1.835             | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | NOK         | 1.550         |                   | 152               | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | \$          | 8             | BRL               | 47                | 0                               | 0,00                |
| BSH        | 07.2025      |             | 578.147       | €                 | 508.912           | 19.240                          | 0,79                |
|            | 07.2025      |             | 25.262        | £                 | 18.566            | 182                             | 0,01                |
|            | 07.2025      |             | 2.325         | ZAR               | 41.412            | 6                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | £           | 18.566        | \$                | 25.265            | 0                               | (0,01)              |
|            | 08.2025      | ZAR         | 41.514        |                   | 2.325             | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | DKK         | 5.041         |                   | 768               | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | CNY         | 11.876        |                   | 1.656             | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | DKK         | 2             |                   | 0                 | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | €           | 4.318         |                   | 4.965             | 0                               | (0,00)              |
|            | 07.2025      | HKD         | 12.741        |                   | 1.629             | 6                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | IDR         | 37.133.781    |                   | 2.276             | 0                               | (0,00)              |
|            | 07.2025      | SEK         | 113           |                   | 12                | 0                               | 0,00                |
| CBK        | 07.2025      | \$          | 3.880         | CHF               | 3.157             | 87                              | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 12.221        | €                 | 10.549            | 163                             | 0,01                |
|            | 07.2025      |             | 1.127         | £                 | 828               | 8                               | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 0             | ¥                 | 37                | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 0             | NOK               | 1                 | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 4.415         | SEK               | 41.840            | 0                               | (0,00)              |
|            | 08.2025      | HKD         | 70.901        | \$                | 9.063             | 1                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | SEK         | 41.750        |                   | 4.415             | 24                              | 0,00                |
|            | 07.2025      | AUD         | 1.527         |                   | 983               | 0                               | (0,00)              |
|            | 07.2025      | €           | 528.163       |                   | 612.722           | 0                               | (0,30)              |
|            | 07.2025      | SGD         | 25            |                   | 19                | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | \$          | 596           | DKK               | 3.795             | 1                               | 0,00                |
| DUB        | 08.2025      | DKK         | 3.786         | \$                | 596               | 0                               | (0,00)              |
|            | 08.2025      | \$          | 612.722       | €                 | 527.005           | 7.254                           | 0,30                |
|            | 07.2025      | AUD         | 13.277        | \$                | 8.566             | 0                               | (0,01)              |
|            | 07.2025      | BRL         | 21.628        |                   | 3.783             | 0                               | (0,01)              |
|            | 07.2025      | CHF         | 23.802        |                   | 28.904            | 0                               | (0,04)              |
|            | 07.2025      | ¥           | 3.907.318     |                   | 27.237            | 187                             | 0,01                |
| FAR        | 07.2025      | SEK         | 41.701        |                   | 4.354             | 0                               | (0,00)              |
|            | 07.2025      | SGD         | 63            |                   | 49                | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | \$          | 1.932         | BRL               | 10.647            | 19                              | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 27.931        | CHF               | 22.361            | 161                             | 0,01                |
|            | 07.2025      |             | 811           | DKK               | 5.158             | 1                               | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 17.100        | ¥                 | 2.489.142         | 132                             | 0,01                |
|            | 07.2025      |             | 151           | SGD               | 193               | 0                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | BRL         | 10.727        | \$                | 1.932             | 0                               | (0,00)              |
|            | 08.2025      | CHF         | 22.269        |                   | 27.931            | 0                               | (0,01)              |
|            | 08.2025      | DKK         | 5.146         |                   | 811               | 0                               | (0,00)              |
|            | 08.2025      | ¥           | 2.479.988     |                   | 17.100            | 0                               | (0,01)              |
|            | 08.2025      | SGD         | 192           |                   | 151               | 0                               | 0,00                |
| GLM        | 07.2025      | BRL         | 16            |                   | 3                 | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | \$          | 1.899         | BRL               | 10.951            | 107                             | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 1.946         | INR               | 166.476           | 0                               | (0,00)              |
|            | 07.2025      |             | 59            | SGD               | 75                | 0                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | INR         | 166.707       | \$                | 1.946             | 5                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | SGD         | 75            |                   | 59                | 0                               | 0,00                |
| JPM        | 08.2025      | \$          | 3             | BRL               | 16                | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      | DKK         | 3.907         | \$                | 592               | 0                               | (0,00)              |
|            | 07.2025      | SGD         | 1.658         |                   | 1.291             | 0                               | (0,00)              |
|            | 07.2025      | \$          | 2.307         | CAD               | 3.169             | 16                              | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 3             | IDR               | 54.147            | 0                               | 0,00                |
|            | 07.2025      |             | 123           | SGD               | 157               | 1                               | 0,00                |
|            | 08.2025      | SGD         | 157           | \$                | 123               | 0                               | (0,00)              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| MBC        | 07.2025               | CAD                    | 16.028                   | \$ 11.670                        | \$ 0                               | \$ (77)                                              | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CHF                    | 34                       | 41                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | €                      | 73.612                   | 85.429                           | 0                                  | (981)                                                | (0,04)                    |
|            | 07.2025               | HKD                    | 13.188                   | 1.688                            | 8                                  | 8                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ILS                    | 2.970                    | 845                              | 0                                  | (37)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 412.216                  | 2.867                            | 14                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | KRW                    | 12.225.501               | 8.909                            | 0                                  | (134)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 3.982                    | 3.104                            | 0                                  | (23)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 10.704                   | CAD 14.714                       | 79                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.297                    | CHF 1.047                        | 19                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.864                    | € 1.623                          | 41                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.446                    | ¥ 210.521                        | 11                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 3.245                    | SGD 4.197                        | 50                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 345                      | ZAR 6.123                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CAD                    | 14.688                   | \$ 10.703                        | 0                                  | (79)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD                    | 4.187                    | 3.245                            | 0                                  | (50)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | ZAR                    | 6.138                    | 345                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | INR                    | 272.329                  | 3.145                            | 0                                  | (30)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 88.265                   | 611                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | MXN                    | 33.951                   | 1.744                            | 0                                  | (53)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 384.740                  | 13.031                           | 0                                  | (188)                                                | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 5.433                    | ¥ 792.256                        | 52                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.454                    | NOK 14.671                       | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | ¥                      | 789.344                  | \$ 5.433                         | 0                                  | (52)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | NOK                    | 14.668                   | 1.454                            | 5                                  | 5                                                    | 0,00                      |
| RBC        | 07.2025               | \$                     | 6.517                    | HKD 51.142                       | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.827                    | MYR 7.738                        | 11                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | HKD                    | 50.977                   | \$ 6.517                         | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | MYR                    | 7.738                    | 1.830                            | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                      |
| SCX        | 07.2025               | HKD                    | 23.831                   | 3.051                            | 15                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.662                    | CNY 11.903                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 6                        | ¥ 840                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.766                    | MXN 33.951                       | 31                                 | 0                                                    | 0,00                      |
| SOG        | 07.2025               |                        | 648                      | SGD 836                          | 8                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNY                    | 11.871                   | \$ 1.662                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | ¥                      | 837                      | 6                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | MXN                    | 33.951                   | 1.759                            | 0                                  | (31)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD                    | 834                      | 648                              | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | HKD                    | 72.530                   | 9.286                            | 46                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 681                      | ¥ 98.260                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 152                      | NOK 1.527                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 8.470                    | \$ 472                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | ¥                      | 97.899                   | 681                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | NOK                    | 1.527                    | 152                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | £                      | 17.484                   | 23.688                           | 1                                  | (273)                                                | (0,01)                    |
| SSB        | 08.2025               | \$                     | 1.135                    | £ 828                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 312.602                  | \$ 2.160                         | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                      |
| UAG        | 07.2025               | NOK                    | 14.648                   | 1.442                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 898                      | 31                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.276                    | IDR 37.079.635                   | 8                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 3.141                    | INR 269.424                      | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
| WST        | 07.2025               |                        | 8.954                    | KRW 12.204.743                   | 73                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 53.148                   | \$ 2.961                         | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | IDR                    | 37.079.635               | 2.274                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | INR                    | 269.795                  | 3.141                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | KRW                    | 12.204.743               | 8.970                            | 0                                  | (64)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | €                      | 523.755                  | 614.181                          | 0                                  | (629)                                                | (0,03)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 614.889                  | € 544.284                        | 24.019                             | 0                                                    | 0,98                      |
|            | 07.2025               |                        | 7.840                    | ¥ 1.129.043                      | 0                                  | (24)                                                 | 0,00                      |
|            | 08.2025               | ¥                      | 1.124.888                | \$ 7.840                         | 24                                 | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 615.522                  | € 523.755                        | 630                                | 0                                                    | 0,03                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 72.853                        | \$ (13.762)                        | \$ 59.091                                            | 2,42                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BOA        | 07.2025               | €                      | 6.418                    | \$ 7.298                         | \$ 0                               | \$ (236)                                             | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | £                      | 80                       | 108                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 26                       | SGD 33                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SGD                    | 33                       | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TRY                    | 449                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | £                      | 74.852                   | 101.828                          | 0                                  | (747)                                                | (0,03)                    |
|            | 07.2025               | INR                    | 24.762                   | 286                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | MYR                    | 1.397                    | 331                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | NOK                    | 296                      | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 1                        | BRL 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 87.270                   | £ 64.634                         | 1.301                              | 0                                                    | 0,05                      |
| BSH        | 08.2025               |                        | 97.169                   | 71.406                           | 696                                | 0                                                    | 0,03                      |
|            | 07.2025               | DKK                    | 1.129                    | \$ 172                           | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025               | CNH                    | 196                      | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
|            | 07.2025               | CNY                    | 188                      | \$ 26                            | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | DKK                    | 1                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | IDR                    | 6.981.801                | 428                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SEK                    | 21                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 348                      | CHF 283                          | 8                                  | 8                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 782                      | £ 577                            | 8                                  | 8                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | NOK 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 813                      | SEK 7.708                        | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | HKD                    | 12.038                   | \$ 1.539                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SEK                    | 7.691                    | 813                              | 5                                  | 5                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 07.2025               | \$                     | 133                      | DKK 850                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 7.785                    | € 6.710                          | 92                                 | 92                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025               | DKK                    | 848                      | \$ 133                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | €                      | 6.696                    | 7.785                            | 0                                  | (92)                                                 | 0,00                         |
| FAR        | 07.2025               | AUD                    | 1.800                    | 1.161                            | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | BRL                    | 2.918                    | 510                              | 0                                  | (24)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CHF                    | 3.931                    | 4.774                            | 0                                  | (165)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | ¥                      | 663.493                  | 4.625                            | 32                                 | 32                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SEK                    | 7.682                    | 802                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.177                    | AUD 1.800                        | 3                                  | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 528                      | BRL 2.912                        | 5                                  | 5                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 4.551                    | CHF 3.643                        | 26                                 | 26                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 182                      | DKK 1.155                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 2.603                    | ¥ 378.914                        | 20                                 | 20                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 27                       | SGD 34                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | AUD                    | 1.800                    | \$ 1.178                         | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | BRL                    | 2.934                    | 528                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CHF                    | 3.628                    | 4.551                            | 0                                  | (26)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | DKK                    | 1.153                    | 182                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ¥                      | 377.520                  | 2.603                            | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 34                       | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 1                        | BRL 4                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | DKK                    | 875                      | \$ 133                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 228                      | 178                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 95.442                   | £ 70.846                         | 1.642                              | 1.642                                                | 0,07                         |
|            | 07.2025               |                        | 17                       | SGD 22                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| MBC        | 08.2025               | SGD                    | 22                       | \$ 17                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CAD                    | 2.242                    | 1.632                            | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CNH                    | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | 292                      | 331                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 46                       | 62                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | HKD                    | 2.199                    | 282                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                    | 867                      | 247                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 30.305                   | 211                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 1.515.910                | 1.105                            | 0                                  | (17)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 549                      | 428                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.631                    | CAD 2.242                        | 12                                 | 12                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 4.466                    | £ 3.297                          | 51                                 | 51                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 256                      | PLN 924                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 447                      | SGD 578                          | 7                                  | 7                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 402                      | ZAR 7.151                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CAD                    | 2.239                    | \$ 1.631                         | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | PLN                    | 925                      | 256                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 577                      | 447                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ZAR                    | 7.168                    | 402                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| MYI        | 07.2025               | INR                    | 41.259                   | 476                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 14.988                   | 104                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | MXN                    | 6.204                    | 319                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 12                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 52.189                   | 1.768                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 874                      | ¥ 127.421                        | 8                                  | 8                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 277                      | NOK 2.796                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ¥                      | 126.952                  | \$ 874                           | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | NOK                    | 2.796                    | 277                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
| RBC        | 08.2025               | TRY                    | 339                      | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.107                    | HKD 8.683                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 330                      | MYR 1.397                        | 2                                  | 2                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | HKD                    | 8.655                    | \$ 1.107                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | MYR                    | 1.397                    | 330                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
| SCX        | 07.2025               | CNH                    | 2.776                    | 387                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | HKD                    | 3.974                    | 509                              | 3                                  | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 26                       | CNY 188                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 10                       | ¥ 1.419                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 323                      | MXN 6.204                        | 6                                  | 6                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 89                       | SGD 115                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNY                    | 188                      | \$ 26                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ¥                      | 1.414                    | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | MXN                    | 6.204                    | 322                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 115                      | 89                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
| SOG        | 07.2025               | HKD                    | 12.095                   | 1.549                            | 8                                  | 8                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.457                    | ¥ 210.304                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 29                       | NOK 291                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 7.177                    | \$ 400                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| SSB        | 08.2025               | ¥                      | 209.532                  | \$ 1.457                         | \$ 1                               | \$ 1                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | NOK                    | 291                      | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 71.248                   | 97.695                           | 60                                 | 60                                                   | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 21                       | CNH 151                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 95.719                   | £ 70.693                         | 1.155                              | 1.155                                                | 0,05                         |
| UAG        | 08.2025               | CNH                    | 151                      | \$ 21                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 97.708                   | £ 71.248                         | 0                                  | (59)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | HKD                    | 2.495                    | \$ 319                           | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 9.780                    | 68                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | NOK                    | 2.792                    | 275                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | PLN                    | 926                      | 247                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 394                      | CNH 2.821                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 63                       | £ 46                             | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 429                      | IDR 6.981.801                    | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 770                      | INR 66.054                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.112                    | KRW 1.515.910                    | 9                                  | 9                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 4                        | \$ 0                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 2.814                    | 394                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | IDR                    | 6.981.801                | 428                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | INR                    | 66.145                   | 770                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | KRW                    | 1.515.910                | 1.114                            | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 5.167                         | \$ (1.577)                         | \$ 3.590                                             | 0,15                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOA        | 07.2025               | CAD                    | 3                        | \$ 2                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | 155                      | 176                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 3                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 1                        | SGD 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 1                        | \$ 1                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               | AUD                    | 44                       | 28                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | HKD                    | 22                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | INR                    | 1.438                    | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | MYR                    | 18                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 0                        | BRL 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 14                       | CHF 12                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 18                       | € 16                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 78                       | £ 57                             | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 3                        | TWD 95                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | £                      | 55                       | \$ 75                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
| CBK        | 09.2025               | MYR                    | 4                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | BRL                    | 52                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CNY                    | 48                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | DKK                    | 28                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | IDR                    | 138.118                  | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | NOK                    | 4                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 9                        | BRL 52                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 7                        | CHF 6                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 7                        | CNY 48                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 15                       | SEK 146                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 08.2025               | BRL                    | 52                       | \$ 9                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNY                    | 48                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | HKD                    | 249                      | 32                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SEK                    | 146                      | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 95                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 3                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 4                        | DKK 28                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 151                      | € 130                            | 2                                  | 2                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 2.104                    | ILS 7.399                        | 93                                 | 93                                                   | 0,01                         |
|            | 08.2025               | DKK                    | 28                       | \$ 4                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| MBC        | 08.2025               | €                      | 130                      | 151                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CAD                    | 54                       | 39                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CHF                    | 93                       | 113                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | HKD                    | 388                      | 50                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                    | 3.017                    | 861                              | 0                                  | (36)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 9.151                    | 64                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 34.829                   | 25                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 14                       | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 41                       | CAD 57                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 10                       | € 9                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 179                      | ILS 617                          | 4                                  | 4                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 15                       | ¥ 2.244                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | PLN 13                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 14                       | SGD 18                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 11                       | ZAR 201                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CAD                    | 53                       | \$ 39                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | PLN                    | 13                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 18                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 36                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |      |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|------|
| MYI        | 08.2025               | ZAR                    | 201                      | \$ 11                            | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 4.356                    | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | MXN                    | 87                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 1.009                    | 34                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 4                        | CHF 3                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               |                        | 2.101                    | ILS 7.391                        | 93                                 | 93                                                   | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               |                        | 84                       | ¥ 12.239                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               |                        | 5                        | MXN 87                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | NOK 35                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | ¥                      | 12.194                   | \$ 84                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| RBC        | 08.2025               | MXN                    | 87                       | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | NOK                    | 35                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | CHF                    | 1                        | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 23                       | HKD 179                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               |                        | 4                        | MYR 18                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | HKD                    | 179                      | \$ 23                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | MYR                    | 18                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | £                      | 62                       | 84                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.101                    | ILS 7.391                        | 95                                 | 95                                                   | 0,00                      |      |
|            | SSB                   | 07.2025                | HKD                      | 55                               | \$ 7                               | 0                                                    | 0                         | 0,00 |
| 07.2025    |                       | ILS                    | 736                      | 212                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       | ¥                      | 2.842                    | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       | NOK                    | 35                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       | PLN                    | 13                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       | SEK                    | 146                      | 15                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       | \$                     | 7                        | £ 5                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       |                        | 5                        | HKD 36                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       |                        | 8                        | IDR 138.118                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| 07.2025    |                       |                        | 17                       | INR 1.439                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
| UAG        | 07.2025               |                        | 26                       | KRW 34.829                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 201                      | \$ 11                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | IDR                    | 138.118                  | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | INR                    | 1.441                    | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | KRW                    | 34.829                   | 26                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            | 08.2025               | TWD                    | 74                       | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |      |
|            |                       |                        |                          |                                  | \$ 288                             | \$ (57)                                              | \$ 231                    | 0,01 |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| BOA        | 07.2025               | €                      | 1.812                    | \$ 2.061                         | \$ 0                               | \$ (66)                                              | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | SGD                    | 11.269                   | 8.800                            | 0                                  | (47)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 0                        | DKK 0                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 22.325                   | SGD 28.776                       | 269                                | 269                                                  | 0,01                      |
|            | 08.2025               |                        | 8.800                    | 11.243                           | 49                                 | 49                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               | AUD                    | 501                      | \$ 323                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | INR                    | 6.929                    | 80                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | MYR                    | 264                      | 63                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 0                        | BRL 2                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 155                      | CHF 126                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               |                        | 988                      | £ 726                            | 7                                  | 7                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 0                        | SEK 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 639                      | SGD 823                          | 7                                  | 7                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | £                      | 726                      | \$ 989                           | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | BRL                    | 664                      | 116                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CNY                    | 437                      | 61                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | DKK                    | 412                      | 63                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | IDR                    | 1.755.162                | 108                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | NOK                    | 45                       | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SEK                    | 271                      | 28                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025               | \$                     | 120                      | BRL 664                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 61                       | CNY 438                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 173                      | SEK 1.644                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | BRL                    | 669                      | \$ 120                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNY                    | 437                      | 61                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | HKD                    | 3.154                    | 403                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | SEK                    | 1.641                    | 173                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 65                       | DKK 412                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 2.102                    | € 1.812                          | 25                                 | 25                                                   | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 12.295                   | SGD 15.839                       | 141                                | 141                                                  | 0,01                      |
| DUB        | 08.2025               | DKK                    | 411                      | \$ 65                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | €                      | 1.808                    | 2.102                            | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CAD                    | 628                      | 457                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CHF                    | 1.075                    | 1.308                            | 0                                  | (42)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | HKD                    | 4.828                    | 618                              | 3                                  | 3                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ILS                    | 148                      | 42                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ¥                      | 103.945                  | 723                              | 4                                  | 4                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | KRW                    | 424.437                  | 309                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | 28.026                   | 21.672                           | 0                                  | (333)                                                | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 457                      | CAD 628                          | 3                                  | 3                                                    | 0,00                      |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Strategic Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat            | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |      |
|------------|----------------------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|------|
| MYI        | 07.2025                          | \$                     | 45                       | PLN                              | 161                                | \$ 0                                                 | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 17.345                   | SGD                              | 22.251                             | 126                                                  | 0,01                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 138                      | ZAR                              | 2.461                              | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | CAD                    | 627                      | \$                               | 457                                | (3)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | PLN                    | 161                      |                                  | 45                                 | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | \$                     | 21.444                   | SGD                              | 27.668                             | 334                                                  | 0,01                         |      |
|            | 08.2025                          | ZAR                    | 2.467                    | \$                               | 138                                | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | INR                    | 11.545                   |                                  | 133                                | (1)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | ¥                      | 51.409                   |                                  | 356                                | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | MXN                    | 1.083                    |                                  | 56                                 | (2)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | TWD                    | 14.215                   |                                  | 481                                | (7)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | \$                     | 1.131                    | ¥                                | 163.907                            | 4                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 56                       | MXN                              | 1.083                              | 1                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 43                       | NOK                              | 430                                | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | ¥                      | 163.300                  | \$                               | 1.131                              | (4)                                                  | 0,00                         |      |
| RBC        | 08.2025                          | MXN                    | 1.083                    |                                  | 56                                 | (1)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | NOK                    | 430                      |                                  | 43                                 | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | CHF                    | 7                        |                                  | 9                                  | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | \$                     | 290                      | HKD                              | 2.275                              | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 62                       | MYR                              | 264                                | 0                                                    | 0,00                         |      |
| SSB        | 08.2025                          | HKD                    | 2.267                    | \$                               | 290                                | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | MYR                    | 264                      |                                  | 62                                 | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | £                      | 726                      |                                  | 984                                | (12)                                                 | 0,00                         |      |
| UAG        | 07.2025                          | HKD                    | 611                      |                                  | 78                                 | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | ¥                      | 33.543                   |                                  | 232                                | (1)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | NOK                    | 429                      |                                  | 42                                 | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | PLN                    | 162                      |                                  | 43                                 | (2)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | SEK                    | 1.373                    |                                  | 143                                | (1)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          | \$                     | 108                      | IDR                              | 1.755.162                          | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 215                      | INR                              | 18.484                             | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 311                      | KRW                              | 424.437                            | 3                                                    | 0,00                         |      |
|            | 07.2025                          |                        | 21.602                   | SGD                              | 27.727                             | 167                                                  | 0,01                         |      |
|            | 07.2025                          | ZAR                    | 2.471                    | \$                               | 138                                | (1)                                                  | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | IDR                    | 1.755.162                |                                  | 108                                | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | INR                    | 18.509                   |                                  | 215                                | 0                                                    | 0,00                         |      |
|            | 08.2025                          | KRW                    | 424.437                  |                                  | 312                                | (2)                                                  | 0,00                         |      |
|            |                                  |                        |                          |                                  | \$ 1.148                           | \$ (584)                                             | \$ 564                       | 0,02 |
|            | Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                        |                          |                                  |                                    |                                                      | \$ 45.065                    | 1,85 |

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖGENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                          |                              |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 4.000       | \$ 480                   | 0,02                         |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | \$ 480                   | 0,02                         |

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

#### US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

|                                       |        |          |        |
|---------------------------------------|--------|----------|--------|
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA | 10.600 | (8.393)  | (0,34) |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055          | 63.600 | (55.043) | (2,26) |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055 (i)      |        |          |        |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere       | \$     | (63.436) | (2,60) |

|                             |    |             |         |
|-----------------------------|----|-------------|---------|
| Summe Anlagen               | \$ | 3.467.525   | 142,00  |
| Sonstige Aktiva und Passiva | \$ | (1.025.544) | (42,00) |
| Nettovermögen               | \$ | 2.441.981   | 100,00  |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

(f) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(h) Mit dem Fonds verbunden.

(i) Ein zum 30. Juni 2025 leerverkauftes Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(j) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,23 %):

| Emittentenbeschreibung                      | Kaufdatum               | Kosten    | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------|-----------|-----------|----------------------|
| AMSURG Corp.                                | 02.11.2023 - 06.11.2023 | \$ 2.204  | \$ 2.382  | 0,10                 |
| Intelsat Emergence S.A.                     | 19.06.2017 - 23.02.2022 | 5.147     | 1.894     | 0,08                 |
| Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032 | 11.02.2020              | 627       | 486       | 0,02                 |
| Whitecap Resources, Inc.                    | 10.06.2025              | 1.128     | 1.169     | 0,05                 |
| ZTO Express Cayman, Inc.                    | 22.11.2024 - 14.03.2025 | 1.110     | 1.002     | 0,04                 |
|                                             |                         | \$ 10.216 | \$ 6.933  | 0,29                 |

(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 4.614 USD (31. Dezember 2024: 136.452 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 650 USD) als Sicherheiten verpfändet.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 332 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 4.044 USD (31. Dezember 2024: 23.064 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 132.453 USD) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 33.921 USD (31. Dezember 2024: 24.245 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 374.528                                                                  | \$ 2.955.156                                                    | \$ 6.937                                                     | \$ 3.336.621        |
| Investmentfonds                     | 134.709                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 134.709             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 1.929                                                                       | 57.222                                                          | 0                                                            | 59.151              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 480                                                             | 0                                                            | 480                 |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (63.436)                                                        | 0                                                            | (63.436)            |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 511.166</b>                                                           | <b>\$ 2.949.422</b>                                             | <b>\$ 6.937</b>                                              | <b>\$ 3.467.525</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | \$ 336.234                                                                  | \$ 2.807.268                                                    | \$ 4.755                                                     | \$ 3.148.257        |
| Investmentfonds                     | 4.484                                                                       | 0                                                               | 0                                                            | 4.484               |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (1.354)                                                                     | (4.665)                                                         | (53)                                                         | (6.072)             |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 75                                                              | 0                                                            | 75                  |
| Leerverkaufte Wertpapiere           | 0                                                                           | (8.253)                                                         | 0                                                            | (8.253)             |
| <b>Summen</b>                       | <b>\$ 339.364</b>                                                           | <b>\$ 2.794.425</b>                                             | <b>\$ 4.702</b>                                              | <b>\$ 3.138.491</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus Pensions-<br>geschäften | % des Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|--------------------------------------------------|---------------------------|
| BRC                                       | 1,500 %         | 11.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | € (286)           | \$ (335)                                         | (0,01)                    |
| MEI                                       | 4,300           | 26.03.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (4.027)        | (4.074)                                          | (0,17)                    |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |                   | <b>\$ (4.409)</b>                                | <b>(0,18)</b>             |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für Derivative OTC-Finanzinstrumente

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der Derivative OTC-Finanzinstrumente und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.417                            | \$ (1.280)                            | \$ 137                              | \$ (92)                             | \$ 0                                  | \$ (92)                             |
| BOA        | 699                                 | (550)                                 | 149                                 | (646)                               | 540                                   | (106)                               |
| BPS        | (300)                               | 200                                   | (100)                               | (165)                               | 370                                   | 205                                 |
| BRC        | 20.609                              | (19.240)                              | 1.369                               | 1.554                               | (1.390)                               | 164                                 |

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| BSH        | \$ (33)                             | \$ 0                                  | \$ (33)                             | \$ 12                               | \$ 0                                  | \$ 12                               |
| CBK        | 1.440                               | (1.230)                               | 210                                 | 893                                 | (670)                                 | 223                                 |
| DUB        | 213                                 | 0                                     | 213                                 | (11.947)                            | 10.530                                | (1.417)                             |
| FAR        | (2.627)                             | 2.370                                 | (257)                               | 1.508                               | (1.290)                               | 218                                 |
| GLM        | 255                                 | 0                                     | 255                                 | (777)                               | 870                                   | 93                                  |
| GST        | 263                                 | (130)                                 | 133                                 | 14                                  | 0                                     | 14                                  |
| IND        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 1.441                               | (1.330)                               | 111                                 |
| JPM        | 885                                 | (1.110)                               | (225)                               | (145)                               | 0                                     | (145)                               |
| MBC        | (1.552)                             | 1.380                                 | (172)                               | (11.222)                            | 8.910                                 | (2.312)                             |
| MEI        | 3                                   | 0                                     | 3                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MYC        | (34)                                | 94                                    | 60                                  | (34)                                | 94                                    | 60                                  |
| MYI        | (45)                                | 0                                     | (45)                                | (87)                                | 0                                     | (87)                                |
| RBC        | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 | (6)                                 | 0                                     | (6)                                 |
| RYL        | 30                                  | 0                                     | 30                                  | (64)                                | 0                                     | (64)                                |
| SAL        | 26                                  | 0                                     | 26                                  | 13                                  | 0                                     | 13                                  |
| SCX        | 62                                  | 0                                     | 62                                  | (1.605)                             | 1.750                                 | 145                                 |
| SOG        | 48                                  | 0                                     | 48                                  | (147)                               | 0                                     | (147)                               |
| SSB        | (416)                               | 332                                   | (84)                                | 47                                  | 0                                     | 47                                  |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 642                                 | (580)                                 | 62                                  |
| UAG        | 106                                 | 0                                     | 106                                 | 1.003                               | (820)                                 | 183                                 |
| WST        | 24.019                              | 0                                     | 24.019                              | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 30,54             | 34,42             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 37,57             | 44,42             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,14              | 0,06              |
| Investmentfonds                                                        | 2,76              | 0,12              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,12              | 0,04              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,67              | 0,94              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,91              | 0,66              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,01              | 0,00              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 26,28             | 19,34             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,39              | 0,20              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 12,04             | 11,08             |
| Kommunalanleihen und Wechsel                                                           | 0,03              | 0,01              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 49,09             | 40,85             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 7,74              | 11,45             |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 10,80             | 13,29             |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 24,46             | 28,22             |
| Staatsemissionen                                                                       | 4,30              | 4,03              |
| Stammaktien                                                                            | 23,90             | 24,11             |
| Optionsscheine                                                                         | 0,00              | 0,00              |
| Vorzugswertpapiere                                                                     | 0,16              | 0,21              |
| Real Estate Investment Trusts                                                          | 3,48              | 2,36              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,25              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                                        | 5,52              | 0,19              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,19              | (0,03)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | 0,00              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,07              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,31              | 0,62              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,00              | (0,01)            |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,01              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,77)            | 0,54              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 2,60              | (1,37)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,02              | 0,00              |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (2,60)            | (0,36)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (42,00)           | (35,38)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>           |                |                          |                                   |                                                      |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b> |                |                          |                                   |                                                      |                |                          |                                   |                                       |                |                          |                                   |
| Pantheon Senior Debt Secondaries          |                |                          |                                   | 6,684 % fällig am 13.09.2027                         | \$ 6.900       | \$ 7.068                 | 0,17                              | 5,300 % fällig am 15.01.2029          | \$ 2.000       | \$ 2.024                 | 0,05                              |
| 6,317 % fällig am 26.03.2026 (i)          | \$ 1.400       | \$ 1.400                 | 0,03                              | Capital One Financial Corp.                          |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.             |                |                          |                                   |
| Project Alfa                              |                |                          |                                   | 5,700 % fällig am 01.02.2030                         | 2.300          | 2.380                    | 0,06                              | 1,948 % fällig am 21.10.2027          | 4.800          | 4.649                    | 0,11                              |
| 4,256 % fällig am 27.02.2026 (i)          | € 851          | 998                      | 0,03                              | CBRE Global Investors Open-Ended Funds S.C.A. SICAV- |                |                          |                                   | 3,615 % fällig am 15.03.2028          | 400            | 395                      | 0,01                              |
| Project Hudson                            |                |                          |                                   | SIF-Pan European Core Fund                           |                |                          |                                   | 4,692 % fällig am 23.10.2030          | 8.600          | 8.628                    | 0,21                              |
| 7,730 % fällig am 29.05.2026              | \$ 2.100       | 2.130                    | 0,05                              | 0,500 % fällig am 27.01.2028                         | € 13.300       | 14.669                   | 0,36                              | Golub Capital BDC, Inc.               |                |                          |                                   |
| Stepstone Group Midco GmbH                |                |                          |                                   | 0,900 % fällig am 12.10.2029                         | 7.600          | 8.138                    | 0,20                              | 7,050 % fällig am 05.12.2028          | 5.800          | 6.092                    | 0,15                              |
| 6,673 % fällig am 26.04.2032              | € 3.800        | 4.383                    | 0,11                              | CIF Capital Markets Mechanism PLC                    |                |                          |                                   | Goodman Australia Finance Pty. Ltd.   |                |                          |                                   |
|                                           |                | 8.911                    | 0,22                              | 4,750 % fällig am 22.01.2028                         | \$ 3.000       | 3.058                    | 0,07                              | 4,250 % fällig am 03.05.2030          | € 5.000        | 6.128                    | 0,15                              |
|                                           |                |                          |                                   | Citibank N.A.                                        |                |                          |                                   | GSPA Monetization Trust               |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,803 % fällig am 29.09.2028                         | 2.800          | 2.928                    | 0,07                              | 6,422 % fällig am 09.10.2029          | \$ 7.465       | 7.507                    | 0,18                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,864 % fällig am 29.09.2025                         | 3.200          | 3.206                    | 0,08                              | GTA Finance Co. Pty. Ltd.             |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Citigroup, Inc.                                      |                |                          |                                   | 5,400 % fällig am 04.12.2029          | AUD 3.000      | 2.018                    | 0,05                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,250 % fällig am 06.07.2026                         | € 5.000        | 5.870                    | 0,14                              | HAT Holdings LLC                      |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 3,070 % fällig am 24.02.2028                         | \$ 7.400       | 7.238                    | 0,18                              | 3,750 % fällig am 15.09.2030          | \$ 2.150       | 1.974                    | 0,05                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,174 % fällig am 13.02.2030                         | 8.700          | 8.878                    | 0,22                              | 8,000 % fällig am 15.06.2027          | 3.800          | 3.964                    | 0,10                              |
|                                           |                |                          |                                   | Citycon Treasury BV                                  |                |                          |                                   | Host Hotels & Resorts LP              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 12.03.2028                         | € 15.000       | 16.591                   | 0,40                              | 4,500 % fällig am 01.02.2026          | 7.800          | 7.784                    | 0,19                              |
|                                           |                |                          |                                   | Clifford Capital Pte Ltd.                            |                |                          |                                   | HSBC Holdings PLC                     |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 4,781 % fällig am 14.01.2030                         | \$ 900         | 927                      | 0,02                              | 5,130 % fällig am 03.03.2031          | 2.400          | 2.433                    | 0,06                              |
|                                           |                |                          |                                   | Cooperative Rabobank UA                              |                |                          |                                   | 5,290 % fällig am 16.09.2032          | £ 9.200        | 12.683                   | 0,31                              |
|                                           |                |                          |                                   | 4,655 % fällig am 22.08.2028                         | 10.500         | 10.563                   | 0,26                              | 7,390 % fällig am 03.11.2028          | \$ 6.300       | 6.692                    | 0,16                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,447 % fällig am 05.03.2030                         | 8.400          | 8.665                    | 0,21                              | Indian Railway Finance Corp. Ltd.     |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 18.07.2025                         | 2.200          | 2.201                    | 0,05                              | 3,835 % fällig am 13.12.2027          | 3.300          | 3.244                    | 0,08                              |
|                                           |                |                          |                                   | Corebridge Global Funding                            |                |                          |                                   | ING Groep NV                          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 02.07.2026                         | 2.500          | 2.532                    | 0,06                              | 1,125 % fällig am 07.12.2028          | £ 9.100        | 11.527                   | 0,28                              |
|                                           |                |                          |                                   | Cousins Properties LP                                |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 12.08.2029          | € 2.000        | 2.421                    | 0,06                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.07.2030                         | 1.200          | 1.223                    | 0,03                              | International Development Association |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | CPI Property Group S.A.                              |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 05.05.2037          | 11.100         | 11.139                   | 0,27                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 14.01.2030                         | € 6.100        | 6.290                    | 0,15                              | Intesa Sanpaolo SpA                   |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 22.01.2028                         | £ 400          | 523                      | 0,01                              | 0,750 % fällig am 16.03.2028          | 10.200         | 11.438                   | 0,28                              |
|                                           |                |                          |                                   | Credit Agricole S.A.                                 |                |                          |                                   | Iridium Capital PLC                   |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,606 % fällig am 11.09.2028                         | \$ 3.300       | 3.320                    | 0,08                              | 9,250 % fällig am 18.06.2029          | 6.000          | 7.642                    | 0,19                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,316 % fällig am 03.10.2029                         | 7.500          | 7.884                    | 0,19                              | JAB Holdings BV                       |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Crown Castle, Inc.                                   |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 25.04.2034          | 700            | 837                      | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | 4,800 % fällig am 01.09.2028                         | 5.000          | 5.032                    | 0,12                              | JPMorgan Chase & Co.                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | CTP NV                                               |                |                          |                                   | 4,323 % fällig am 26.04.2028          | \$ 4.333       | 4.330                    | 0,11                              |
|                                           |                |                          |                                   | 0,875 % fällig am 20.01.2026                         | € 1.270        | 1.477                    | 0,04                              | 4,851 % fällig am 25.07.2028          | 16.300         | 16.473                   | 0,40                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 27.09.2031                         | 4.700          | 4.820                    | 0,12                              | 5,280 % fällig am 22.07.2028          | 3.500          | 3.515                    | 0,09                              |
|                                           |                |                          |                                   | Danske Bank A/S                                      |                |                          |                                   | 5,299 % fällig am 24.07.2029          | 8.600          | 8.831                    | 0,21                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 23.08.2028                         | £ 5.000        | 7.132                    | 0,17                              | 5,581 % fällig am 22.04.2030          | 1.600          | 1.662                    | 0,04                              |
|                                           |                |                          |                                   | Deutsche Bank AG                                     |                |                          |                                   | 6,070 % fällig am 22.10.2027          | 8.200          | 8.380                    | 0,20                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 20.01.2027                         | € 7.400        | 8.589                    | 0,21                              | KBC Group NV                          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 19.11.2030                         | 14.200         | 15.643                   | 0,38                              | 0,250 % fällig am 01.03.2027          | € 3.000        | 3.474                    | 0,08                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,875 % fällig am 23.02.2028                         | 4.000          | 4.644                    | 0,11                              | 0,375 % fällig am 16.06.2027          | 3.200          | 3.689                    | 0,09                              |
|                                           |                |                          |                                   | Digital Dutch Finco BV                               |                |                          |                                   | Kookmin Bank                          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.07.2025                         | 4.600          | 5.396                    | 0,13                              | 4,500 % fällig am 01.02.2029 (h)      | \$ 7.400       | 7.346                    | 0,18                              |
|                                           |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 15.01.2032                         | 1.000          | 1.001                    | 0,02                              | Lendlease Finance Ltd.                |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Digital Euro Finco LLC                               |                |                          |                                   | 3,400 % fällig am 27.10.2027          | AUD 24.900     | 15.770                   | 0,38                              |
|                                           |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 16.01.2026                         | 6.100          | 7.165                    | 0,17                              | 3,700 % fällig am 31.03.2031          | 4.800          | 2.756                    | 0,07                              |
|                                           |                |                          |                                   | DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank,     |                |                          |                                   | Lloyds Banking Group PLC              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | Frankfurt am Main                                    |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 22.03.2028          | \$ 1.200       | 1.199                    | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | 2,782 % fällig am 16.11.2026                         | 5.600          | 6.631                    | 0,16                              | 5,462 % fällig am 05.01.2028          | 6.600          | 6.691                    | 0,16                              |
|                                           |                |                          |                                   | EQT AB                                               |                |                          |                                   | Logicor Financing SARL                |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 06.04.2028                         | 10.000         | 11.653                   | 0,28                              | 1,625 % fällig am 15.07.2027          | € 1.100        | 1.260                    | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 06.04.2032                         | 7.400          | 8.289                    | 0,20                              | 3,250 % fällig am 13.11.2028          | 12.600         | 14.814                   | 0,36                              |
|                                           |                |                          |                                   | Equitable Financial Life Global Funding              |                |                          |                                   | Lseg Netherlands BV                   |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,450 % fällig am 03.03.2028                         | \$ 4.900       | 5.044                    | 0,12                              | 2,750 % fällig am 20.09.2027          | 6.300          | 7.435                    | 0,18                              |
|                                           |                |                          |                                   | Federation des Caisses Desjardins du Quebec          |                |                          |                                   | Marsh & McLennan Cos., Inc.           |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 4,400 % fällig am 23.08.2025                         | 11.000         | 10.991                   | 0,27                              | 4,550 % fällig am 08.11.2027          | \$ 700         | 705                      | 0,02                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,700 % fällig am 14.03.2028                         | 6.600          | 6.835                    | 0,17                              | 5,061 % fällig am 08.11.2027          | 3.500          | 3.509                    | 0,09                              |
|                                           |                |                          |                                   | First Abu Dhabi Bank PJSC                            |                |                          |                                   | MassMutual Global Funding             |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 28.02.2029                         | 5.000          | 5.087                    | 0,12                              | 4,450 % fällig am 27.03.2028          | 4.100          | 4.127                    | 0,10                              |
|                                           |                |                          |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC                            |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 07.12.2027          | 7.100          | 7.246                    | 0,18                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,800 % fällig am 05.03.2027                         | 7.200          | 7.259                    | 0,18                              | Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,918 % fällig am 20.03.2028                         | 1.200          | 1.212                    | 0,03                              | 1,412 % fällig am 17.07.2025          | 11.200         | 11.185                   | 0,27                              |
|                                           |                |                          |                                   | 7,350 % fällig am 04.11.2027                         | 1.000          | 1.039                    | 0,03                              | 4,636 % fällig am 07.06.2031          | € 1.000        | 1.257                    | 0,03                              |
|                                           |                |                          |                                   | Gaci First Investment Co.                            |                |                          |                                   | Mizuho Financial Group, Inc.          |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 14.02.2053                         | 9.600          | 8.233                    | 0,20                              | 5,414 % fällig am 13.09.2028          | \$ 8.800       | 8.999                    | 0,22                              |
|                                           |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 29.01.2030                         | 5.000          | 5.109                    | 0,12                              | Moere Boligkreditt A/S                |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 29.01.2054 (j)                     | 8.100          | 7.178                    | 0,17                              | 2,625 % fällig am 25.09.2029          | € 2.900        | 3.412                    | 0,08                              |
|                                           |                |                          |                                   | Generali                                             |                |                          |                                   | Morgan Stanley                        |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | 2,429 % fällig am 14.07.2031                         | € 1.800        | 2.009                    | 0,05                              | 4,654 % fällig am 18.10.2030          | \$ 8.600       | 8.618                    | 0,21                              |
|                                           |                |                          |                                   | Globalworth Real Estate Investments Ltd.             |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 28.01.2027          | 6.000          | 6.019                    | 0,15                              |
|                                           |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 31.03.2030                         | 3.184          | 3.806                    | 0,09                              | Morgan Stanley Bank N.A.              |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   | GLP Capital LP                                       |                |                          |                                   | 4,968 % fällig am 14.07.2028          | 9.100          | 9.211                    | 0,22                              |
|                                           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.01.2030                         | \$ 2.600       | 2.501                    | 0,06                              | 5,427 % fällig am 14.01.2028          | 8.800          | 8.854                    | 0,21                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,882 % fällig am 30.10.2026                   | \$ 5.300       | \$ 5.413                 | 0,13                              | Vonovia SE                           | € 2.100        | \$ 2.307                 | 0,06                              | 5,606 % fällig am 30.03.2047            | CAD 1.700      | \$ 1.367                 | 0,03                              |
| Nationwide Building Society                    | 8.200          | 8.409                    | 0,20                              | 2,375 % fällig am 25.03.2032         | € 2.100        | \$ 2.307                 | 0,06                              | 5,607 % fällig am 30.06.2044            | 1.700          | 1.360                    | 0,03                              |
| 6,557 % fällig am 18.10.2027                   | 8.200          | 8.409                    | 0,20                              | Wells Fargo & Co.                    | \$ 2.550       | 2.507                    | 0,06                              | 5,857 % fällig am 30.03.2049 (i)        | 1.400          | 1.160                    | 0,03                              |
| NatWest Group PLC                              | € 10.000       | 10.886                   | 0,26                              | 3,000 % fällig am 23.10.2026         | \$ 2.550       | 2.507                    | 0,06                              | 5,857 % fällig am 30.06.2049            | 6.600          | 5.474                    | 0,13                              |
| 0,780 % fällig am 26.02.2030                   | 2.900          | 3.447                    | 0,08                              | 3,196 % fällig am 17.06.2027         | 2.800          | 2.767                    | 0,07                              | Constellation Brands, Inc.              | \$ 6.950       | 7.024                    | 0,17                              |
| 3,575 % fällig am 12.09.2032                   | 2.900          | 3.447                    | 0,08                              | 3,584 % fällig am 22.05.2028         | 1.600          | 1.576                    | 0,04                              | 4,800 % fällig am 15.01.2029            | 6.000          | 6.093                    | 0,15                              |
| NE Property BV                                 | 10.700         | 12.431                   | 0,30                              | 4,808 % fällig am 25.07.2028         | 9.600          | 9.683                    | 0,23                              | CVS Health Corp.                        | 5.000          | 5.000                    | 0,15                              |
| 1,875 % fällig am 09.10.2026                   | 5.800          | 6.870                    | 0,17                              | 5,420 % fällig am 22.04.2028         | 1.200          | 1.208                    | 0,03                              | 5,000 % fällig am 30.01.2029            | 6.000          | 6.093                    | 0,15                              |
| 3,375 % fällig am 14.07.2027                   | 5.800          | 6.870                    | 0,17                              | 5,707 % fällig am 22.04.2028         | 2.900          | 2.964                    | 0,07                              | Daimler Truck Finance North America LLC | 5.000          | 5.000                    | 0,15                              |
| New Immo Holding S.A.                          | 8.800          | 10.192                   | 0,25                              | 6,303 % fällig am 23.10.2029         | 8.100          | 8.562                    | 0,21                              | 5,000 % fällig am 15.01.2027            | 3.300          | 3.333                    | 0,08                              |
| 2,750 % fällig am 26.11.2026                   | 8.800          | 10.192                   | 0,25                              | Wells Fargo Bank N.A.                | 8.500          | 8.568                    | 0,21                              | Delta Air Lines Pass-Through Trust      | 2.594          | 2.442                    | 0,06                              |
| Nexi SpA                                       | 2.600          | 3.079                    | 0,07                              | 5,466 % fällig am 11.12.2026         | 8.500          | 8.568                    | 0,21                              | 2,000 % fällig am 10.12.2029            | 2.594          | 2.442                    | 0,06                              |
| 3,875 % fällig am 21.05.2031                   | 2.600          | 3.079                    | 0,07                              | Workspace Group PLC                  | £ 7.600        | 9.619                    | 0,23                              | DSV Finance BV                          | € 4.300        | 5.112                    | 0,12                              |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC                | \$ 7.400       | 7.301                    | 0,18                              | 2,250 % fällig am 11.03.2028         | £ 7.600        | 9.619                    | 0,23                              | 3,125 % fällig am 06.11.2028            | 3.200          | 3.786                    | 0,09                              |
| 5,300 % fällig am 13.09.2027                   | \$ 7.400       | 7.301                    | 0,18                              | Yorkshire Building Society           | 2.400          | 3.125                    | 0,08                              | 3,250 % fällig am 06.11.2030            | 2.900          | 3.412                    | 0,08                              |
| Nomura Holdings, Inc.                          | 800            | 747                      | 0,02                              | 3,511 % fällig am 11.10.2030         | 2.400          | 3.125                    | 0,08                              | 3,375 % fällig am 06.11.2032            | 3.200          | 3.678                    | 0,09                              |
| 2,172 % fällig am 14.07.2028                   | 800            | 747                      | 0,02                              |                                      | 1.211.131      | 29,36                    |                                   | 3,375 % fällig am 06.11.2034            | 3.200          | 3.678                    | 0,09                              |
| 2,679 % fällig am 16.07.2030                   | 7.300          | 6.626                    | 0,16                              |                                      |                |                          |                                   | eBay, Inc.                              | \$ 7.700       | 7.731                    | 0,19                              |
| 5,709 % fällig am 09.01.2026                   | 8.300          | 8.344                    | 0,20                              | INDUSTRIEWERTE                       |                |                          |                                   | 5,900 % fällig am 22.11.2025            | 7.700          | 7.731                    | 0,19                              |
| 5,842 % fällig am 18.01.2028                   | 7.500          | 7.736                    | 0,19                              | Abu Dhabi National Energy Co. PJSC   | \$ 7.000       | 6.896                    | 0,17                              | Emory University                        | 10.400         | 9.350                    | 0,23                              |
| Pacific Life Global Funding                    | 6.000          | 6.214                    | 0,15                              | 4,375 % fällig am 09.10.2031         | \$ 7.000       | 6.896                    | 0,17                              | 2,143 % fällig am 01.09.2030            | 10.400         | 9.350                    | 0,23                              |
| 5,500 % fällig am 18.07.2028                   | 6.000          | 6.214                    | 0,15                              | Adnoc Murban Rsc Ltd.                | 4.300          | 4.283                    | 0,10                              | Energy Transfer LP                      | 4.100          | 4.188                    | 0,10                              |
| Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC | 3.300          | 2.348                    | 0,06                              | 4,250 % fällig am 11.09.2029         | 4.300          | 4.283                    | 0,10                              | 6,050 % fällig am 01.12.2026            | 4.100          | 4.188                    | 0,10                              |
| 0,000 % fällig am 05.04.2032 (c)               | 3.300          | 2.348                    | 0,06                              | Air Canada Pass-Through Trust        | 385            | 376                      | 0,01                              | Entergy Louisiana LLC                   | 14.000         | 12.107                   | 0,29                              |
| Prologis International Funding S.A.            | € 1.000        | 1.038                    | 0,03                              | 3,600 % fällig am 15.09.2028         | 385            | 376                      | 0,01                              | 2,350 % fällig am 15.06.2032            | 14.000         | 12.107                   | 0,29                              |
| 1,625 % fällig am 17.06.2032                   | € 1.000        | 1.038                    | 0,03                              | Amdocs Ltd.                          | 5.800          | 5.257                    | 0,13                              | Equifax, Inc.                           | 5.000          | 5.044                    | 0,12                              |
| Royal Bank of Canada                           | \$ 7.500       | 7.576                    | 0,18                              | 2,538 % fällig am 15.06.2030         | 5.800          | 5.257                    | 0,13                              | 4,800 % fällig am 15.09.2029            | 7.800          | 7.927                    | 0,19                              |
| 4,875 % fällig am 19.01.2027                   | \$ 7.500       | 7.576                    | 0,18                              | Amprion GmbH                         | € 4.600        | 5.412                    | 0,13                              | 5,100 % fällig am 15.12.2027            | 7.800          | 7.927                    | 0,19                              |
| 4,900 % fällig am 12.01.2028                   | 4.700          | 4.789                    | 0,12                              | 3,000 % fällig am 05.12.2029         | € 4.600        | 5.412                    | 0,13                              | Expedia Group, Inc.                     | 3.790          | 3.735                    | 0,09                              |
| Sagax AB                                       | € 11.700       | 13.387                   | 0,32                              | Amrize Finance U.S. LLC              | \$ 3.000       | 3.028                    | 0,07                              | 3,800 % fällig am 15.02.2028            | 3.790          | 3.735                    | 0,09                              |
| 1,125 % fällig am 30.01.2027                   | € 11.700       | 13.387                   | 0,32                              | 4,700 % fällig am 07.04.2028         | \$ 3.000       | 3.028                    | 0,07                              | Global Payments, Inc.                   | 7.300          | 7.388                    | 0,18                              |
| Santander UK Group Holdings PLC                | £ 800          | 1.033                    | 0,03                              | 4,950 % fällig am 07.04.2030         | 4.900          | 4.968                    | 0,12                              | 4,950 % fällig am 15.08.2027            | 7.300          | 7.388                    | 0,18                              |
| 2,421 % fällig am 17.01.2029                   | £ 800          | 1.033                    | 0,03                              | Aurizon Network Pty. Ltd.            | AUD 3.000      | 2.028                    | 0,05                              | Gray Oak Pipeline LLC                   | 12.600         | 12.336                   | 0,30                              |
| 4,858 % fällig am 11.09.2030                   | \$ 6.250       | 6.244                    | 0,15                              | 6,200 % fällig am 05.12.2033         | AUD 3.000      | 2.028                    | 0,05                              | 3,450 % fällig am 15.10.2027            | 12.600         | 12.336                   | 0,30                              |
| 7,482 % fällig am 29.08.2029                   | £ 1.500        | 2.210                    | 0,05                              | Babcock International Group PLC      | € 8.300        | 9.506                    | 0,23                              | Greensaf Pipelines Bidco SARRL          | 3.700          | 3.746                    | 0,09                              |
| Sirius Real Estate Ltd.                        | € 500          | 582                      | 0,01                              | 1,375 % fällig am 13.09.2027         | € 8.300        | 9.506                    | 0,23                              | 5,853 % fällig am 23.02.2036            | 3.775          | 3.781                    | 0,09                              |
| 4,000 % fällig am 22.01.2032                   | € 500          | 582                      | 0,01                              | Barry Callebaut Services NV          | 4.100          | 4.860                    | 0,12                              | 6,103 % fällig am 23.08.2042            | 3.775          | 3.781                    | 0,09                              |
| Societe Generale S.A.                          | \$ 14.100      | 13.896                   | 0,34                              | 3,750 % fällig am 19.02.2028         | 4.100          | 4.860                    | 0,12                              | HCA, Inc.                               | 9.200          | 9.012                    | 0,22                              |
| 1,488 % fällig am 14.12.2026                   | \$ 14.100      | 13.896                   | 0,34                              | Bayer U.S. Finance LLC               | \$ 1.200       | 1.260                    | 0,03                              | 3,125 % fällig am 15.03.2027            | 9.200          | 9.012                    | 0,22                              |
| 4,677 % fällig am 15.06.2027                   | 6.700          | 6.757                    | 0,16                              | 6,250 % fällig am 21.01.2029         | \$ 1.200       | 1.260                    | 0,03                              | Hyundai Capital America                 | 5.900          | 5.928                    | 0,14                              |
| 6,446 % fällig am 10.01.2029                   | 700            | 728                      | 0,02                              | 6,375 % fällig am 21.11.2030         | 6.900          | 7.335                    | 0,18                              | 4,850 % fällig am 25.03.2027            | 5.900          | 5.928                    | 0,14                              |
| Standard Chartered PLC                         | € 3.600        | 3.938                    | 0,10                              | BMW U.S. Capital LLC                 | 8.300          | 8.397                    | 0,20                              | 5,250 % fällig am 08.01.2027            | 6.000          | 6.058                    | 0,15                              |
| 0,800 % fällig am 17.11.2029                   | € 3.600        | 3.938                    | 0,10                              | 4,750 % fällig am 21.03.2028         | 8.300          | 8.397                    | 0,20                              | 5,500 % fällig am 30.03.2026            | 6.500          | 6.541                    | 0,16                              |
| 1,456 % fällig am 14.01.2027                   | \$ 15.800      | 15.537                   | 0,38                              | Boeing Co.                           | 6.400          | 6.328                    | 0,15                              | 5,950 % fällig am 21.09.2026            | 3.600          | 3.657                    | 0,09                              |
| Starwood Property Trust, Inc.                  | 800            | 793                      | 0,02                              | 2,750 % fällig am 01.02.2026         | 6.400          | 6.328                    | 0,15                              | 6,000 % fällig am 11.07.2025            | 5.500          | 5.502                    | 0,13                              |
| 4,375 % fällig am 15.01.2027                   | 800            | 793                      | 0,02                              | 3,450 % fällig am 01.11.2028         | 4.200          | 4.052                    | 0,10                              | 6,500 % fällig am 16.01.2029            | 1.100          | 1.161                    | 0,03                              |
| Stellantis Finance U.S., Inc.                  | 4.600          | 4.639                    | 0,11                              | British Airways Pass-Through Trust   | 2.001          | 1.924                    | 0,05                              | Imperial Brands Finance PLC             | 5.000          | 5.163                    | 0,13                              |
| 5,350 % fällig am 17.03.2028                   | 4.600          | 4.639                    | 0,11                              | 4,250 % fällig am 15.05.2034         | 2.001          | 1.924                    | 0,05                              | 6,125 % fällig am 27.07.2027            | 5.000          | 5.163                    | 0,13                              |
| Stifel Financial Corp.                         | 12.900         | 12.407                   | 0,30                              | Broadcom, Inc.                       | 2.173          | 2.139                    | 0,05                              | Informa PLC                             | € 15.300       | 17.948                   | 0,44                              |
| 4,000 % fällig am 15.05.2030                   | 12.900         | 12.407                   | 0,30                              | 4,150 % fällig am 15.11.2030         | 2.173          | 2.139                    | 0,05                              | 2,125 % fällig am 06.10.2025            | 500            | 592                      | 0,01                              |
| Stockland Trust                                | AUD 3.200      | 2.148                    | 0,05                              | 4,300 % fällig am 15.11.2032 (j)     | 4.800          | 4.658                    | 0,11                              | 3,000 % fällig am 23.10.2027            | 500            | 592                      | 0,01                              |
| 5,420 % fällig am 25.03.2032                   | AUD 3.200      | 2.148                    | 0,05                              | 5,050 % fällig am 12.07.2027         | 8.600          | 8.726                    | 0,21                              | Intel Corp.                             | \$ 6.900       | 7.058                    | 0,17                              |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.          | \$ 2.500       | 2.321                    | 0,06                              | Burberry Group PLC                   | £ 10.000       | 13.719                   | 0,33                              | 5,125 % fällig am 10.02.2030            | \$ 6.900       | 7.058                    | 0,17                              |
| 1,902 % fällig am 17.09.2028                   | \$ 2.500       | 2.321                    | 0,06                              | 5,750 % fällig am 20.06.2030         | £ 10.000       | 13.719                   | 0,33                              | International Business Machines Corp.   | 5.000          | 4.998                    | 0,12                              |
| 5,513 % fällig am 09.07.2029                   | 8.600          | 8.689                    | 0,21                              | Canadian Pacific Railway Co.         | \$ 7.050       | 6.947                    | 0,17                              | 4,000 % fällig am 27.07.2025            | 5.000          | 4.998                    | 0,12                              |
| 5,520 % fällig am 13.01.2028                   | 5.200          | 5.356                    | 0,13                              | 3,125 % fällig am 01.06.2026         | \$ 7.050       | 6.947                    | 0,17                              | JDE Peet's NV                           | € 12.500       | 15.282                   | 0,37                              |
| 5,880 % fällig am 13.07.2026                   | 6.600          | 6.701                    | 0,16                              | Centene Corp.                        | 5.000          | 4.866                    | 0,12                              | 4,125 % fällig am 23.01.2030            | € 12.500       | 15.282                   | 0,37                              |
| Toronto-Dominion Bank                          | € 5.600        | 6.655                    | 0,16                              | 4,625 % fällig am 15.12.2029         | 5.000          | 4.866                    | 0,12                              | JSW Hydro Energy Ltd.                   | \$ 1.917       | 1.766                    | 0,04                              |
| 3,879 % fällig am 13.03.2026                   | € 5.600        | 6.655                    | 0,16                              | CenterPoint Energy Resources Corp.   | 6.100          | 6.250                    | 0,15                              | 4,125 % fällig am 18.05.2031            | \$ 1.917       | 1.766                    | 0,04                              |
| TP ICAP Finance PLC                            | £ 9.800        | 14.603                   | 0,35                              | 5,250 % fällig am 01.03.2028         | 6.100          | 6.250                    | 0,15                              | Lonsdale Finance Pty. Ltd.              | AUD 2.800      | 1.886                    | 0,05                              |
| 7,875 % fällig am 17.04.2030                   | £ 9.800        | 14.603                   | 0,35                              | Chanel Ceres PLC                     | € 10.400       | 11.964                   | 0,29                              | 5,500 % fällig am 19.11.2031            | AUD 2.800      | 1.886                    | 0,05                              |
| UBS Group AG                                   | \$ 12.000      | 11.817                   | 0,29                              | 0,500 % fällig am 31.07.2026         | € 10.400       | 11.964                   | 0,29                              | Marriott International, Inc.            | \$ 7.300       | 7.575                    | 0,18                              |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029                   | € 8.300        | 10.147                   | 0,25                              | Charter Communications Operating LLC | \$ 4.126       | 4.126                    | 0,10                              | 5,550 % fällig am 15.10.2028            | \$ 7.300       | 7.575                    | 0,18                              |
| 4,125 % fällig am 09.06.2033                   | \$ 1.300       | 1.293                    | 0,03                              | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC | 8.700          | 8.785                    | 0,21                              | Mars, Inc.                              | 8.100          | 8.210                    | 0,20                              |
| 5,125 % fällig am 29.07.2026 (f)(h)            | 6.500          | 6.540                    | 0,16                              | 5,125 % fällig am 30.06.2027         | 8.700          | 8.785                    | 0,21                              | 4,800 % fällig am 01.03.2030            | 8.100          | 8.210                    | 0,20                              |
| 5,711 % fällig am 12.01.2027                   | 5.650          | 5.872                    | 0,14                              | Choice Hotels International, Inc.    | 1.500          | 1.418                    | 0,03                              | Mercedes-Benz Finance North America LLC | 9.300          | 9.417                    | 0,23                              |
| 6,442 % fällig am 11.08.2028                   | £ 8.800        | 12.390                   | 0,30                              | 3,700 % fällig am 01.12.2029         | 1.500          | 1.418                    | 0,03                              | 4,800 % fällig am 30.03.2028            | 5.500          | 5.512                    | 0,13                              |
| 7,000 % fällig am 30.09.2027                   | £ 8.800        | 12.390                   | 0,30                              | Coastal Gaslink Pipeline LP          | CAD 800        | 613                      | 0,02                              | 4,900 % fällig am 09.01.2026            | 5.500          | 5.512                    | 0,13                              |
| UniCredit SpA                                  | € 5.450        | 6.388                    | 0,15                              | 4,691 % fällig am 30.09.2029         | CAD 800        | 613                      | 0,02                              | Motorola Solutions, Inc.                | 12.400         | 11.011                   | 0,27                              |
| 2,200 % fällig am 22.07.2027                   | € 5.450        | 6.388                    | 0,15                              | 4,907 % fällig am 30.06.2031         | 800            | 620                      | 0,02                              | 2,300 % fällig am 15.11.2030            | 12.400         | 11.011                   | 0,27                              |
| Volkswagen Financial Services AG               | 1.800          | 2.118                    | 0,05                              | 5,187 % fällig am 30.09.2034         | 800            | 627                      | 0,02                              | Mundys SpA                              | € 26.700       | 30.313                   | 0,73                              |
| 2,739 % fällig am 10.06.2027                   | 3.000          | 3.574                    | 0,09                              | 5,395 % fällig am 30.09.2036         | 2.000          | 1.588                    | 0,04                              | 1,875 % fällig am 12.02.2028            | \$ 2.500       | 2.402                    | 0,06                              |
| 3,750 % fällig am 10.09.2026                   | 800            | 962                      | 0,02                              | 5,538 % fällig am 30.06.2039         | 2.400          | 1.916                    | 0,05                              | Nissan Motor Co. Ltd.                   | \$ 2.500       | 2.402                    | 0,06                              |
| 3,875 % fällig am 10.09.2030                   | 800            | 962                      | 0,02                              | 5,606 % fällig am 30.09.2042         | 1.700          | 1.353                    | 0,03                              | 4,345 % fällig am 17.09.2027            | \$ 2.500       | 2.402                    | 0,06                              |
| Volkswagen Leasing GmbH                        | 4.600          | 5.479                    | 0,13                              |                                      |                |                          |                                   | NSW Ports Finance Co. Pty. Ltd.         | AUD 2.400      | 1.564                    | 0,04                              |
| 3,625 % fällig am 11.10.2026                   | 4.600          | 5.479                    | 0,13                              |                                      |                |                          |                                   | 5,432 % fällig am 19.09.2034            | AUD 2.400      | 1.564                    | 0,04                              |



|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,052 % fällig am 20.10.2072                 | \$ 2.994       | \$ 2.999                 | 0,07                              | 3,125 % fällig am 15.05.2048                            | \$ 2.500       | \$ 1.898                 | 0,05                              | BPCE Home Loans FCT                                                      |                |                          |                                   |
| 5,102 % fällig am 20.01.2073                 | 7.486          | 7.502                    | 0,18                              | 3,250 % fällig am 15.05.2042                            | 1.100          | 910                      | 0,02                              | 2,786 % fällig am 31.10.2058                                             | 2.046          | \$ 2.409                 | 0,06                              |
| 5,172 % fällig am 20.01.2073 -<br>20.02.2073 | 13.089         | 13.145                   | 0,32                              | 3,375 % fällig am 15.08.2042                            | 24.600         | 20.655                   | 0,50                              | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.                                      |                |                          |                                   |
| 5,182 % fällig am 20.02.2073 -<br>20.03.2073 | 16.942         | 17.041                   | 0,41                              | 3,375 % fällig am 15.05.2044                            | 30.300         | 24.932                   | 0,61                              | 4,783 % fällig am 25.09.2037                                             | \$ 75          | 69                       | 0,00                              |
| 5,202 % fällig am 20.01.2073                 | 26.093         | 26.112                   | 0,63                              | 3,375 % fällig am 15.11.2048                            | 28.400         | 22.475                   | 0,55                              | 6,080 % fällig am 25.09.2035                                             | 520            | 524                      | 0,01                              |
| 5,227 % fällig am 20.06.2067                 | 2.082          | 2.109                    | 0,05                              | 3,625 % fällig am 15.02.2044                            | 24.700         | 21.154                   | 0,51                              | 7,230 % fällig am 25.10.2035                                             | 24             | 25                       | 0,00                              |
| 5,246 % fällig am 20.01.2066                 | 4.163          | 4.174                    | 0,10                              | 3,750 % fällig am 15.08.2041                            | 18.600         | 16.670                   | 0,40                              | Commercial Mortgage Trust                                                |                |                          |                                   |
| 5,322 % fällig am 20.12.2072                 | 5.160          | 5.221                    | 0,13                              | 3,750 % fällig am 15.11.2043                            | 5.000          | 4.370                    | 0,11                              | 3,545 % fällig am 10.02.2036                                             | 11.300         | 11.105                   | 0,27                              |
| 5,442 % fällig am 20.11.2072                 | 9.838          | 9.993                    | 0,24                              | 3,875 % fällig am 15.05.2043                            | 16.800         | 15.011                   | 0,36                              | Countrywide Alternative Loan Trust                                       |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 20.02.2028 -<br>20.01.2032 | 15             | 15                       | 0,00                              | 4,000 % fällig am 15.11.2042                            | 13.425         | 12.252                   | 0,30                              | 5,500 % fällig am 25.02.2036                                             | 2.443          | 1.954                    | 0,05                              |
| 5,656 % fällig am 20.11.2067                 | 4.316          | 4.381                    | 0,11                              | 4,000 % fällig am 15.11.2052                            | 24.500         | 21.435                   | 0,52                              | 5,500 % fällig am 25.05.2036                                             | 1.589          | 1.297                    | 0,03                              |
| 6,000 % fällig am 20.09.2038                 | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,375 % fällig am 15.11.2039                            | 10.100         | 9.904                    | 0,24                              | 5,750 % fällig am 25.02.2037                                             | 3.093          | 1.517                    | 0,04                              |
| 8,000 % fällig am 20.05.2031                 | 2              | 2                        | 0,00                              | 4,500 % fällig am 15.11.2054                            | 5.500          | 5.243                    | 0,13                              | 5,894 % fällig am 25.11.2035                                             | 5.822          | 5.415                    | 0,13                              |
| Ginnie Mae, TBA                              |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.05.2044                            | 13.800         | 13.538                   | 0,33                              | 6,000 % fällig am 25.02.2036                                             | 4.514          | 2.468                    | 0,06                              |
| 2,000 % fällig am 01.07.2055                 | 15.100         | 12.301                   | 0,30                              | 4,625 % fällig am 15.05.2054                            | 18.400         | 17.877                   | 0,43                              | 6,000 % fällig am 25.08.2036                                             | 5.473          | 3.373                    | 0,08                              |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055                 | 44.674         | 40.621                   | 0,99                              | 4,625 % fällig am 15.02.2055 (j)                        | 23.400         | 22.786                   | 0,55                              | 6,000 % fällig am 25.11.2036                                             | 240            | 124                      | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am 01.07.2055                 | 50.600         | 47.072                   | 1,14                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)        |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.08.2037                                             | 3.511          | 2.070                    | 0,05                              |
| 4,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 37.100         | 35.506                   | 0,86                              | 0,125 % fällig am 15.10.2025                            | 2.349          | 2.341                    | 0,06                              | Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust                        |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 55.100         | 54.121                   | 1,31                              | 0,125 % fällig am 15.07.2031                            | 15.199         | 13.992                   | 0,34                              | 4,834 % fällig am 25.04.2046                                             | 699            | 673                      | 0,02                              |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                 | 66.700         | 67.609                   | 1,64                              | 0,125 % fällig am 15.01.2032                            | 14.696         | 13.325                   | 0,32                              | 4,928 % fällig am 20.10.2035                                             | 688            | 679                      | 0,02                              |
| Small Business Administration                |                |                          |                                   | 0,125 % fällig am 15.02.2051                            | 59.137         | 32.246                   | 0,78                              | 5,138 % fällig am 25.11.2034                                             | 267            | 256                      | 0,01                              |
| 5,870 % fällig am 01.07.2028                 | 4              | 4                        | 0,00                              | 0,125 % fällig am 15.02.2052                            | 4.148          | 2.217                    | 0,05                              | 5,395 % fällig am 20.02.2035                                             | 50             | 50                       | 0,00                              |
| 6,220 % fällig am 01.12.2028                 | 217            | 222                      | 0,01                              | 0,250 % fällig am 15.02.2050                            | 8.848          | 4.933                    | 0,12                              | 6,000 % fällig am 25.07.2037                                             | 249            | 109                      | 0,00                              |
| Uniform Mortgage-Backed Security             |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 15.02.2043                            | 140            | 104                      | 0,00                              | 6,250 % fällig am 19.07.2031                                             | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 2,500 % fällig am 01.12.2032 -<br>01.02.2035 | 6.059          | 5.849                    | 0,14                              | 0,750 % fällig am 15.02.2045                            | 27.107         | 19.808                   | 0,48                              | 6,662 % fällig am 20.02.2036                                             | 37             | 32                       | 0,00                              |
| 3,000 % fällig am 01.03.2028 -<br>01.06.2052 | 30.564         | 26.558                   | 0,64                              | 0,875 % fällig am 15.02.2047                            | 10.763         | 7.805                    | 0,19                              | Countrywide Home Loan Repreforming REMIC Trust                           |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.01.2047 -<br>01.09.2052 | 302            | 274                      | 0,01                              | 1,000 % fällig am 15.02.2046                            | 1.354          | 1.026                    | 0,02                              | 4,744 % fällig am 25.01.2034                                             | 12             | 11                       | 0,00                              |
| 4,000 % fällig am 01.07.2025 -<br>01.10.2052 | 15.461         | 14.607                   | 0,36                              | 1,000 % fällig am 15.02.2049                            | 2.804          | 2.037                    | 0,05                              | 4,774 % fällig am 25.06.2035                                             | 73             | 70                       | 0,00                              |
| 4,500 % fällig am 01.09.2025 -<br>01.05.2053 | 14.721         | 14.146                   | 0,34                              | 1,250 % fällig am 15.04.2028                            | 14.758         | 14.733                   | 0,36                              | 6,500 % fällig am 25.11.2034                                             | 15             | 14                       | 0,00                              |
| 5,000 % fällig am 01.10.2031 -<br>01.09.2053 | 40.281         | 39.732                   | 0,96                              | 1,375 % fällig am 15.02.2044                            | 826            | 694                      | 0,02                              | Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.                     |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 01.02.2032 -<br>01.11.2053 | 2.521          | 2.573                    | 0,06                              | 1,500 % fällig am 15.02.2053                            | 7.014          | 5.561                    | 0,13                              | 5,695 % fällig am 25.06.2033                                             | 3              | 3                        | 0,00                              |
| 6,000 % fällig am 01.07.2029 -<br>01.02.2041 | 1.054          | 1.098                    | 0,03                              | 1,875 % fällig am 15.07.2034 (j)                        | 6.951          | 6.960                    | 0,17                              | Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-<br>Through Certificates |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 01.07.2034 -<br>01.03.2037 | 47             | 50                       | 0,00                              | 2,125 % fällig am 15.02.2054                            | 12.437         | 11.392                   | 0,28                              | 6,000 % fällig am 25.11.2035                                             | 2.311          | 524                      | 0,01                              |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA        |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 15.02.2055 (j)                        | 3.050          | 2.951                    | 0,07                              | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates                              |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 01.08.2055                 | 50.400         | 41.804                   | 1,01                              | U.S. Treasury Notes                                     |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 26.04.2038                                             | 667            | 653                      | 0,02                              |
| 3,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 419.901        | 363.355                  | 8,81                              | 3,875 % fällig am 15.08.2034 (j)                        | 40.000         | 39.067                   | 0,95                              | Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust                     |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 169.700        | 152.767                  | 3,70                              | 4,250 % fällig am 15.11.2034 (j)                        | 1.800          | 1.807                    | 0,04                              | 5,750 % fällig am 25.04.2036                                             | 763            | 391                      | 0,01                              |
| 4,000 % fällig am 01.08.2055                 | 288.100        | 267.866                  | 6,49                              | U.S. Treasury STRIPS                                    |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.05.2036                                             | 1.841          | 981                      | 0,02                              |
| 4,500 % fällig am 01.07.2040 -<br>01.08.2055 | 210.700        | 201.472                  | 4,88                              | 0,000 % fällig am 15.08.2040 (c)                        | 14.400         | 6.925                    | 0,17                              | 6,000 % fällig am 25.04.2037                                             | 558            | 174                      | 0,00                              |
| 5,000 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 420.500        | 411.903                  | 9,99                              | 0,000 % fällig am 15.02.2041 (c)                        | 1.900          | 889                      | 0,02                              | CSAIL Commercial Mortgage Trust                                          |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 01.07.2055 -<br>01.08.2055 | 152.900        | 152.782                  | 3,70                              | 0,000 % fällig am 15.05.2041 (c)                        | 600            | 277                      | 0,01                              | 3,458 % fällig am 15.11.2050                                             | 4.600          | 4.456                    | 0,11                              |
| 6,000 % fällig am 01.08.2055                 | 88.100         | 89.448                   | 2,17                              | 0,000 % fällig am 15.08.2041 (c)                        | 900            | 410                      | 0,01                              | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                            |                |                          |                                   |
|                                              | 2.282.065      | 55,32                    |                                   | 0,000 % fällig am 15.05.2042 (c)                        | 7.900          | 3.434                    | 0,08                              | 5,094 % fällig am 25.08.2037                                             | 2.128          | 1.726                    | 0,04                              |
| US-SCHATZOBIGATIONEN                         |                |                          |                                   |                                                         | 756.366        | 18,33                    |                                   | Downey Savings & Loan Association Mortgage<br>Loan Trust                 |                |                          |                                   |
| U.S. Treasury Bonds                          |                |                          |                                   | NON-AGENCY-MBS                                          |                |                          |                                   | 5,274 % fällig am 19.07.2044                                             | 7              | 7                        | 0,00                              |
| 1,375 % fällig am 15.11.2040 (j)             | 159.300        | 101.535                  | 2,46                              | American Home Mortgage Investment Trust                 |                |                          |                                   | Eurohome UK Mortgages PLC                                                |                |                          |                                   |
| 1,750 % fällig am 15.08.2041                 | 19.500         | 12.952                   | 0,31                              | 4,794 % fällig am 25.12.2046                            | 110            | 93                       | 0,00                              | 4,508 % fällig am 15.06.2044 £                                           | 484            | 662                      | 0,02                              |
| 1,875 % fällig am 15.02.2041                 | 4.600          | 3.165                    | 0,08                              | Angel Oak Mortgage Trust                                |                |                          |                                   | First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust                      |                |                          |                                   |
| 2,000 % fällig am 15.02.2050                 | 900            | 529                      | 0,01                              | 1,469 % fällig am 25.06.2065                            | 565            | 537                      | 0,01                              | 5,226 % fällig am 25.10.2034 \$                                          | 55             | 54                       | 0,00                              |
| 2,250 % fällig am 15.08.2049                 | 52.000         | 32.636                   | 0,79                              | Banc of America Funding Trust                           |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.06.2037                                             | 1.082          | 333                      | 0,01                              |
| 2,375 % fällig am 15.11.2049                 | 3.800          | 2.445                    | 0,06                              | 5,490 % fällig am 25.05.2035                            | 864            | 807                      | 0,02                              | GSR Mortgage Loan Trust                                                  |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045                 | 6.100          | 4.296                    | 0,10                              | 5,760 % fällig am 20.09.2035                            | 558            | 458                      | 0,01                              | 4,729 % fällig am 25.01.2036                                             | 940            | 886                      | 0,02                              |
| 2,750 % fällig am 15.08.2047                 | 8.000          | 5.706                    | 0,14                              | Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. |                |                          |                                   | 4,857 % fällig am 25.06.2034                                             | 39             | 38                       | 0,00                              |
| 2,875 % fällig am 15.05.2049                 | 10.700         | 7.684                    | 0,19                              | 4,231 % fällig am 15.09.2060                            | 10.900         | 10.788                   | 0,26                              | 4,920 % fällig am 25.06.2034                                             | 16             | 16                       | 0,00                              |
| 3,000 % fällig am 15.05.2042                 | 1.600          | 1.278                    | 0,03                              | Banc of America Mortgage Trust                          |                |                          |                                   | 5,293 % fällig am 25.09.2035                                             | 1.147          | 1.103                    | 0,03                              |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 (j)             | 138.800        | 106.925                  | 2,59                              | 5,855 % fällig am 25.07.2034                            | 98             | 94                       | 0,00                              | 5,500 % fällig am 25.01.2037                                             | 4              | 15                       | 0,00                              |
| 3,000 % fällig am 15.02.2048                 | 9.100          | 6.764                    | 0,16                              | 6,107 % fällig am 25.07.2035                            | 142            | 136                      | 0,00                              | HarborView Mortgage Loan Trust                                           |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 15.08.2048                 | 5.100          | 3.773                    | 0,09                              | BankUnited Trust                                        |                |                          |                                   | 4,692 % fällig am 19.03.2037                                             | 2.656          | 2.460                    | 0,06                              |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049                 | 7.600          | 5.602                    | 0,14                              | 5,034 % fällig am 25.09.2045                            | 470            | 440                      | 0,01                              | 4,872 % fällig am 19.05.2035                                             | 133            | 128                      | 0,00                              |
| 3,125 % fällig am 15.11.2041                 | 15.300         | 12.553                   | 0,30                              | Barclays Commercial Mortgage Securities Trust           |                |                          |                                   | IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust                                   |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043                 | 4.900          | 3.942                    | 0,10                              | 4,314 % fällig am 15.12.2051                            | 8.000          | 7.860                    | 0,19                              | 6,636 % fällig am 25.01.2032                                             | 0              | 0                        | 0,00                              |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044                 | 23.500         | 18.537                   | 0,45                              | Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust             |                |                          |                                   | IndyMac Mortgage Loan Trust                                              |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 4,631 % fällig am 25.04.2034                            | 129            | 120                      | 0,00                              | 4,914 % fällig am 25.06.2037                                             | 854            | 795                      | 0,02                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,633 % fällig am 25.04.2034                            | 169            | 146                      | 0,00                              | JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust                               |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 4,811 % fällig am 25.11.2030                            | 1              | 1                        | 0,00                              | 3,358 % fällig am 15.11.2048                                             | 760            | 759                      | 0,02                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,848 % fällig am 25.07.2034                            | 5              | 4                        | 0,00                              | JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust                               |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 4,923 % fällig am 25.04.2034                            | 65             | 63                       | 0,00                              | 2,994 % fällig am 15.12.2049                                             | 3.757          | 3.713                    | 0,09                              |
|                                              |                |                          |                                   | 5,785 % fällig am 25.02.2034                            | 44             | 41                       | 0,00                              | JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust                      |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 6,575 % fällig am 25.04.2033                            | 9              | 9                        | 0,00                              | 4,128 % fällig am 05.07.2031                                             | 4.400          | 4.046                    | 0,10                              |
|                                              |                |                          |                                   | 6,884 % fällig am 25.01.2034                            | 125            | 125                      | 0,00                              | 5,569 % fällig am 15.06.2035                                             | 10.951         | 9.462                    | 0,23                              |
|                                              |                |                          |                                   | 7,362 % fällig am 25.12.2035                            | 59             | 61                       | 0,00                              | JPMorgan Mortgage Trust                                                  |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | Bear Stearns ALT-A Trust                                |                |                          |                                   | 5,479 % fällig am 25.07.2035                                             | 83             | 80                       | 0,00                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,754 % fällig am 25.02.2034                            | 24             | 23                       | 0,00                              | 5,750 % fällig am 25.01.2036                                             | 333            | 143                      | 0,00                              |
|                                              |                |                          |                                   | 4,905 % fällig am 25.09.2035                            | 349            | 200                      | 0,01                              | Landmark Mortgage Securities PLC                                         |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 5,467 % fällig am 25.05.2035                            | 218            | 208                      | 0,01                              | 4,711 % fällig am 17.04.2044 £                                           | 4.756          | 6.326                    | 0,15                              |
|                                              |                |                          |                                   | Benchmark Mortgage Trust                                |                |                          |                                   |                                                                          |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 3,666 % fällig am 15.01.2051                            | 11.100         | 10.862                   | 0,26                              |                                                                          |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 3,965 % fällig am 10.04.2051                            | 3.425          | 3.403                    | 0,08                              |                                                                          |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Lehman XS Trust                                                      |                |                          |                                   | 4,974 % fällig am 25.07.2045                                   | \$ 247         | \$ 242                   | 0,01                              | 4,634 % fällig am 25.09.2036                          | \$ 907         | \$ 312                   | 0,01                              |
| 4,794 % fällig am 25.12.2036                                         | \$ 2.951       | \$ 2.866                 | 0,07                              | 5,001 % fällig am 25.09.2036                                   | 863            | 795                      | 0,02                              | 4,734 % fällig am 25.07.2036                          | 7.249          | 2.639                    | 0,07                              |
| 4,834 % fällig am 25.03.2047                                         | 9.176          | 7.818                    | 0,19                              | 5,014 % fällig am 25.10.2045                                   | 2.240          | 2.250                    | 0,06                              | 4,754 % fällig am 25.09.2036                          | 7.316          | 3.156                    | 0,08                              |
| London Wall Mortgage Capital PLC                                     |                |                          |                                   | 5,054 % fällig am 25.01.2045                                   | 89             | 88                       | 0,00                              | 4,894 % fällig am 25.11.2036                          | 858            | 486                      | 0,01                              |
| 5,037 % fällig am 15.05.2052                                         | £ 903          | 1.238                    | 0,03                              | 5,074 % fällig am 25.01.2045                                   | 1.240          | 1.230                    | 0,03                              | 5,139 % fällig am 25.01.2035                          | 1.476          | 1.465                    | 0,04                              |
| MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust                                |                |                          |                                   | Warwick Finance Residential Mortgages PLC                      |                |                          |                                   | New Century Home Equity Loan Trust                    |                |                          |                                   |
| 6,043 % fällig am 21.11.2034                                         | \$ 1.228       |                          |                                   | 0,000 % fällig am 21.12.2049 (c)                               | £ 0            | 1.849                    | 0,05                              | 4,794 % fällig am 25.05.2036                          | 28             | 28                       | 0,00                              |
| 6,176 % fällig am 25.01.2036                                         | 5              | 5                        | 0,00                              | 5,189 % fällig am 21.12.2049                                   | 4.952          | 6.810                    | 0,17                              | 5,154 % fällig am 25.10.2035                          | 1.708          | 1.679                    | 0,04                              |
| MASTR Reperforming Loan Trust                                        |                |                          |                                   | 5,889 % fällig am 21.12.2049                                   | 2.030          | 2.800                    | 0,07                              | Renaissance Home Equity Loan Trust                    |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 25.05.2035                                         | 469            | 310                      | 0,01                              | 6,389 % fällig am 21.12.2049                                   | 1.015          | 1.390                    | 0,03                              | 5,634 % fällig am 25.11.2034                          | 113            | 98                       | 0,00                              |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust                               |                |                          |                                   | 6,889 % fällig am 21.12.2049                                   | 580            | 791                      | 0,02                              | Structured Asset Investment Loan Trust                |                |                          |                                   |
| 4,744 % fällig am 25.06.2035                                         | 208            | 201                      | 0,01                              | 7,389 % fällig am 21.12.2049                                   | 580            | 784                      | 0,02                              | 5,199 % fällig am 25.08.2035                          | 331            | 324                      | 0,01                              |
| 4,934 % fällig am 25.11.2035                                         | 140            | 134                      | 0,00                              | Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust     |                |                          |                                   | Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust |                |                          |                                   |
| 5,519 % fällig am 25.02.2035                                         | 545            | 518                      | 0,01                              | 4,884 % fällig am 25.05.2035                                   | \$ 449         | 378                      | 0,01                              | 4,589 % fällig am 25.09.2036                          | 6.251          | 3.835                    | 0,09                              |
| Metlife Securitization Trust                                         |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 25.11.2035                                   | 407            | 356                      | 0,01                              | WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust             |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 25.03.2057                                         | 4.974          | 4.834                    | 0,12                              | Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust |                |                          |                                   | 4,794 % fällig am 25.04.2037                          | 4.647          | 1.704                    | 0,04                              |
| Mortgage Equity Conversion Asset Trust                               |                |                          |                                   | 5,895 % fällig am 25.02.2031                                   | 0              | 0                        | 0,00                              | Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                |                          |                                   |
| 10,000 % fällig am 25.05.2042                                        | 1.458          | 1.219                    | 0,03                              |                                                                |                |                          |                                   | 5,434 % fällig am 25.10.2034                          | 765            | 783                      | 0,02                              |
| MortgageIT Trust                                                     |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.10.2035                                         | 336            | 335                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates                      |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.02.2035                                         | 1.507          | 1.307                    | 0,03                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| New Residential Mortgage Loan Trust                                  |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057                                         | 4.125          | 4.001                    | 0,10                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust                 |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,504 % fällig am 25.02.2035                                         | 189            | 186                      | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Nomura Asset Acceptance Corp. Reperforming Loan                      |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| REMIC Trust Certificates                                             |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 25.10.2034                                         | 347            | 319                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 25.03.2034                                         | 459            | 430                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Paragon Mortgages PLC                                                |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 2,383 % fällig am 15.11.2038                                         | € 365          | 424                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Prime Mortgage Trust                                                 |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.02.2034                                         | \$ 38          | 36                       | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Residential Accredited Loans, Inc. Trust                             |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,834 % fällig am 25.05.2037                                         | 2.037          | 1.549                    | 0,04                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036                                         | 2.176          | 1.778                    | 0,04                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Residential Asset Securitization Trust                               |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037                                         | 2.482          | 783                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036                                         | 716            | 217                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust                  |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,097 % fällig am 25.02.2036                                         | 113            | 105                      | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Resloc UK PLC                                                        |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,518 % fällig am 15.12.2043                                         | £ 2.704        | 3.620                    | 0,09                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| RMAC PLC                                                             |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,437 % fällig am 15.02.2047                                         | 7.145          | 9.828                    | 0,24                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| RMAC Securities PLC                                                  |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,788 % fällig am 12.06.2044                                         | 544            | 722                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust                       |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,073 % fällig am 25.02.2036                                         | \$ 701         | 598                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,216 % fällig am 25.04.2034                                         | 860            | 863                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,288 % fällig am 25.09.2034                                         | 91             | 89                       | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust                          |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,874 % fällig am 25.09.2047                                         | 8.904          | 7.896                    | 0,19                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,912 % fällig am 19.04.2035                                         | 163            | 160                      | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,932 % fällig am 19.07.2035                                         | 70             | 70                       | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,994 % fällig am 25.02.2036                                         | 343            | 287                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,012 % fällig am 19.05.2034                                         | 81             | 77                       | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,092 % fällig am 19.09.2032                                         | 8              | 8                        | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,284 % fällig am 25.05.2047                                         | 6.958          | 5.659                    | 0,14                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust                |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 25.10.2036                                         | 615            | 352                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 6,554 % fällig am 25.06.2033                                         | 1              | 1                        | 0,00                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Thornburg Mortgage Securities Trust                                  |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,918 % fällig am 25.09.2037                                         | 755            | 748                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,999 % fällig am 25.06.2047                                         | 843            | 747                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Towd Point Mortgage Funding PLC                                      |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,223 % fällig am 20.07.2053                                         | £ 6.335        | 8.701                    | 0,21                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Tower Bridge Funding PLC                                             |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 5,017 % fällig am 20.11.2063                                         | 2.510          | 3.441                    | 0,08                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| Uropa Securities PLC                                                 |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,649 % fällig am 10.10.2040                                         | 257            | 349                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust                        |                |                          |                                   |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 3,488 % fällig am 25.01.2037                                         | \$ 3.686       | 3.071                    | 0,07                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |
| 4,152 % fällig am 25.02.2037                                         | 551            | 514                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                       |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>WHOLE LOANS SICHERHEITEN</b>                |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 23.01.2029                      | € 400          | \$ 475                   | 0,01                              | 3,750 % fällig am 07.03.2027             | £ 49.800       | \$ 68.166                | 1,65                              |
| First Franklin Mortgage Loan Trust             |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 20.12.2044                      | ¥1.830.000     | 11.997                   | 0,29                              | 4,375 % fällig am 31.07.2054             | 14.019         | 16.652                   | 0,40                              |
| 4,654 % fällig am 25.12.2037                   | \$ 2.874       | \$ 2.770                 | 0,07                              | 2,200 % fällig am 20.03.2064                      | 812.000        | 4.520                    | 0,11                              |                                          |                | 389.248                  | 9,43                              |
| 5,109 % fällig am 25.03.2034                   | 236            | 238                      | 0,01                              | 2,300 % fällig am 20.12.2054                      | 1.400.000      | 8.713                    | 0,21                              | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>          |                |                          |                                   |
| 5,709 % fällig am 25.07.2034                   | 200            | 198                      | 0,00                              | 2,400 % fällig am 20.03.2045                      | 1.117.400      | 7.788                    | 0,19                              | <b>NIGERIA TREASURY BILLS</b>            |                |                          |                                   |
| Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust |                |                          |                                   | 2,400 % fällig am 20.03.2055                      | 1.754.000      | 11.156                   | 0,27                              | 30,612 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 4,674 % fällig am 25.11.2036                   | 5.620          | 1.563                    | 0,04                              | <b>Korea Development Bank</b>                     |                |                          |                                   | 29.06.2026 (c)(d)                        | NGN 1.185.800  | 623                      | 0,01                              |
| 4,714 % fällig am 25.05.2036                   | 396            | 204                      | 0,00                              | 5,051 % fällig am 23.10.2026                      | \$ 1.800       | 1.811                    | 0,04                              | 30,864 % fällig am                       |                |                          |                                   |
|                                                |                | 4.973                    | 0,12                              | <b>Mexico Government International Bond</b>       |                |                          |                                   | 26.06.2026 (c)(d)                        | 1.185.800      | 623                      | 0,01                              |
|                                                |                | 259.737                  | 6,30                              | 4,000 % fällig am 24.08.2034 (e)MXN               | 9.351          | 460                      | 0,01                              | 33,126 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                        |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 07.05.2036                      | \$ 2.900       | 2.869                    | 0,07                              | 12.06.2026 (c)(d)                        | 2.028.600      | 1.075                    | 0,03                              |
| Action Logement Services                       |                |                          |                                   | <b>Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap</b>     |                |                          |                                   | 33,156 % fällig am                       |                |                          |                                   |
| 0,500 % fällig am 30.10.2034                   | € 7.600        | 6.883                    | 0,17                              | 0,875 % fällig am 21.03.2046                      | € 10.000       | 6.704                    | 0,16                              | 11.06.2026 (c)(d)                        | 2.030.500      | 1.076                    | 0,03                              |
| Airport Authority Hong Kong                    |                |                          |                                   | <b>Paraguay Government International Bond</b>     |                |                          |                                   | Summe kurzfristige Instrumente           |                | 3.397                    | 0,08                              |
| 4,875 % fällig am 12.01.2028                   | \$ 1.300       | 1.321                    | 0,03                              | 4,950 % fällig am 28.04.2031                      | \$ 2.300       | 2.290                    | 0,06                              |                                          |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 12.01.2030                   | 5.000          | 5.159                    | 0,13                              | <b>Peru Government International Bond</b>         |                |                          |                                   | Summe Übertragbare Wertpapiere           | \$ 5.933.462   | 143,83                   |                                   |
| Brazil Government International Bond           |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 12.08.2032                      | PEN 17.600     | 5.130                    | 0,12                              | <b>AKTIEN</b>                            |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 15.03.2034                   | 8.700          | 8.635                    | 0,21                              | 6,950 % fällig am 12.08.2031                      | 17.520         | 5.369                    | 0,13                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                   |                |                          |                                   |
| CPPIB Capital, Inc.                            |                |                          |                                   | 7,300 % fällig am 12.08.2033                      | 55.200         | 16.974                   | 0,41                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |                |                          |                                   |
| 4,300 % fällig am 02.06.2034                   | CAD 5.800      | 4.434                    | 0,11                              | <b>Poland Government International Bond</b>       |                |                          |                                   | PIMCO Funds: Global                      |                |                          |                                   |
| Development Bank of Japan, Inc.                |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 18.09.2034                      | \$ 4.200       | 4.226                    | 0,10                              | Investors Series                         |                |                          |                                   |
| 0,875 % fällig am 10.10.2025                   | € 4.300        | 5.031                    | 0,12                              | <b>Province of British Columbia</b>               |                |                          |                                   | plc - PIMCO Emerging                     |                |                          |                                   |
| Egypt Government International Bond            |                |                          |                                   | 4,150 % fällig am 18.06.2034                      | CAD 2.700      | 2.041                    | 0,05                              | Markets Opportunities                    |                |                          |                                   |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028 EGP211.800       |                | 4.217                    | 0,10                              | <b>Province of Ontario</b>                        |                |                          |                                   | Fund (g)                                 | 981.265        | 13.296                   | 0,32                              |
| Europäische Union                              |                |                          |                                   | 3,800 % fällig am 02.12.2034                      | 7.000          | 5.128                    | 0,12                              | PIMCO Funds: Global                      |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 04.10.2028 (c)               | € 1.678        | 1.835                    | 0,05                              | <b>Province of Quebec</b>                         |                |                          |                                   | Investors Series plc -                   |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 05.10.2029                   | 16.300         | 19.523                   | 0,47                              | 4,450 % fällig am 01.09.2034                      | 17.400         | 13.422                   | 0,33                              | US Short-Term                            |                |                          |                                   |
| Hungary Government International Bond          |                |                          |                                   | <b>Romania Government International Bond</b>      |                |                          |                                   | Fund (g)                                 | 10.627.749     | 108.616                  | 2,64                              |
| 1,750 % fällig am 05.06.2035                   | 10.000         | 9.327                    | 0,23                              | 3,000 % fällig am 27.02.2027                      | \$ 12.000      | 11.607                   | 0,28                              | PIMCO Select Funds plc -                 |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 16.06.2034                   | 5.000          | 5.924                    | 0,14                              | <b>Saudi Arabia Government International Bond</b> |                |                          |                                   | PIMCO US Dollar Short-                   |                |                          |                                   |
| Israel Government International Bond           |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 05.03.2032                      | € 9.500        | 11.115                   | 0,27                              | Term Floating NAV                        |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 30.10.2026                   | 4.000          | 4.828                    | 0,12                              | <b>South Africa Government International Bond</b> |                |                          |                                   | Fund (g)                                 | 10.977         | 109                      | 0,00                              |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro              |                |                          |                                   | 7,100 % fällig am 19.11.2036                      | \$ 8.200       | 8.144                    | 0,20                              | Summe Investmentfonds                    | \$ 122.021     | 2,96                     |                                   |
| 1,300 % fällig am 15.05.2028 (e)               | 45.978         | 54.788                   | 1,33                              | 8,500 % fällig am 31.01.2037                      | ZAR 112.700    | 5.521                    | 0,13                              |                                          |                |                          |                                   |
| Japan Finance Organization for Municipalities  |                |                          |                                   | 8,875 % fällig am 28.02.2035                      | 242.700        | 12.753                   | 0,31                              |                                          |                |                          |                                   |
| 0,010 % fällig am 02.02.2028                   | 9.900          | 10.944                   | 0,27                              | <b>United Kingdom Gilt</b>                        |                |                          |                                   |                                          |                |                          |                                   |
|                                                |                |                          |                                   | 0,875 % fällig am 31.07.2033                      | £ 1.300        | 1.368                    | 0,03                              |                                          |                |                          |                                   |

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                     | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 319                  | \$ 246                                   | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures                      | Short | 09.2025     | 1.496                | 742                                      | 0,02                 |
| Euro-Bund September Futures                      | Short | 09.2025     | 1.372                | 1.492                                    | 0,04                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures      | Long  | 09.2025     | 98                   | 81                                       | 0,00                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures      | Long  | 09.2025     | 5.253                | 6.028                                    | 0,15                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures     | Long  | 09.2025     | 1.664                | 2.622                                    | 0,06                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures    | Long  | 09.2025     | 653                  | 1.593                                    | 0,04                 |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures   | Short | 09.2025     | 36                   | (178)                                    | (0,01)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures       | Long  | 09.2025     | 183                  | 522                                      | 0,01                 |
|                                                  |       |             |                      | \$ 13.148                                | 0,32                 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                                   | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|-----------|-----------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 62                   | \$ (21)   | \$ (2)    | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,000       | 25.07.2025    | 121                  | (52)      | (4)       | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 109,500       | 25.07.2025    | 63                   | (21)      | (4)       | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures      | 110,250       | 25.07.2025    | 58                   | (14)      | (7)       | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,000       | 25.07.2025    | 62                   | (21)      | (47)      | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,500       | 25.07.2025    | 184                  | (71)      | (98)      | (0,01)               |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures     | 112,750       | 25.07.2025    | 58                   | (18)      | (25)      | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | € 117,250     | 25.07.2025    | 21                   | (5)       | (4)       | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 118,500       | 25.07.2025    | 21                   | (4)       | (3)       | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                      | 129,000       | 25.07.2025    | 14                   | (6)       | (6)       | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                     | 132,500       | 25.07.2025    | 14                   | (7)       | (2)       | 0,00                 |
|                                                                |               |               |                      | \$ (240)  | \$ (202)  | (0,01)               |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |               |               |                      | \$ 12.946 | 0,31      |                      |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit              | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| AT&T, Inc.                   | 1,000 %                     | 20.12.2025       | \$ 9.200                  | \$ (27)                                  | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.12.2025       | 2.500                     | 20                                       | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.06.2026       | 4.000                     | 14                                       | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.12.2027       | 4.600                     | 264                                      | 0,01                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.12.2029       | 400                       | 13                                       | 0,00                 |
| Boeing Co.                   | 1,000                       | 20.06.2030       | 13.200                    | 134                                      | 0,01                 |
| Morgan Stanley               | 1,000                       | 20.06.2026       | 1.300                     | 1                                        | 0,00                 |
| T-Mobile USA, Inc.           | 5,000                       | 20.06.2028       | 6.700                     | (243)                                    | (0,01)               |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.12.2027       | 500                       | 13                                       | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.06.2028       | 5.000                     | 80                                       | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000                       | 20.12.2028       | 1.200                     | 24                                       | 0,00                 |
|                              |                             |                  |                           | \$ 293                                   | 0,01                 |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000 %                     | 20.06.2030       | \$ 304.500                | \$ 1.767                                 | 0,04                 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variable Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag  | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|-------------|------------------------------------------|----------------------|
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 0,900 %         | 15.03.2052       | £ 8.400     | \$ 5.710                                 | 0,14                 |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500           | 19.03.2030       | 15.200      | 225                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500           | 19.03.2035       | 22.900      | (138)                                    | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 19.03.2055       | 5.300       | 226                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,250           | 18.06.2032       | ¥ 9.120.000 | 699                                      | 0,02                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 1,750           | 21.12.2052       | \$ 60.600   | 10.722                                   | 0,26                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,050           | 14.12.2052       | 9.570       | 1.556                                    | 0,04                 |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,156           | 10.03.2033       | 16.530      | 348                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2030       | 54.700      | (338)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250           | 18.06.2055       | 3.900       | 83                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 18.12.2025       | 40.000      | 303                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 20.06.2054       | 90.500      | 3.964                                    | 0,10                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 18.12.2054       | 9.800       | 527                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,613           | 15.08.2033       | 38.890      | 292                                      | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,642           | 15.02.2055       | 3.600       | 178                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,655           | 15.02.2055       | 1.800       | 85                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,687           | 15.08.2033       | 109.900     | 183                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 20.06.2029       | 9.800       | (46)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2029       | 73.500      | 579                                      | 0,01                 |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 15.05.2032       | 18.061      | (252)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,765           | 17.12.2054       | 5.000       | 150                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,807           | 31.05.2028       | 24.700      | (266)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,807           | 15.02.2055       | 1.900       | 38                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,836           | 02.05.2035       | 14.300      | (72)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,842           | 04.03.2030       | 5.400       | (80)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,899           | 11.03.2035       | 3.180       | (44)                                     | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,900           | 15.02.2035       | 17.000      | (292)                                    | (0,01)               |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,930           | 24.03.2035       | 6.100       | (103)                                    | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,975           | 21.03.2035       | 3.600       | (75)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,496          | 04.01.2027       | BRL 100     | (1)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,528          | 04.01.2027       | 64.800      | (396)                                    | (0,01)               |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 11,548          | 04.01.2027       | 195.600     | (1.175)                                  | (0,03)               |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,291          | 02.01.2029       | 100.700     | 155                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,320          | 02.01.2029       | 8.900       | 15                                       | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,354          | 02.01.2029       | 12.100      | 15                                       | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,926          | 04.01.2027       | 15.800      | (8)                                      | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,927          | 04.01.2027       | 152.500     | (81)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 14,009          | 04.01.2027       | 10.100      | (2)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,740           | 01.06.2034       | CAD 3.000   | 28                                       | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2033       | 4.300       | (54)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 01.06.2034       | 5.400       | (28)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,500           | 01.06.2032       | 44.100      | (1.147)                                  | (0,03)               |
| Erhalt                                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750           | 20.12.2033       | 12.000      | (541)                                    | (0,01)               |
| Zahlung                                     | 3-Month NZD-BBR                     | 3,750           | 15.06.2027       | NZD 39.100  | 757                                      | 0,02                 |
| Zahlung                                     | 3-Month NZD-BBR                     | 4,250           | 21.12.2027       | 3.300       | 46                                       | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,000           | 19.03.2035       | AUD 14.800  | (37)                                     | 0,00                 |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 20.09.2033       | 10.900      | 435                                      | 0,01                 |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 20.03.2034       | 12.000      | 650                                      | 0,02                 |
| Zahlung                                     | 6-Month AUD-BBR-BBSW                | 4,500           | 18.09.2034       | 22.400      | 459                                      | 0,01                 |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 0,650 %            | 12.04.2027            | € 25.000        | \$ (650)                                        | (0,02)                       |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 1,000              | 13.05.2027            | 18.900          | (367)                                           | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,050              | 05.10.2029            | 3.100           | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,056              | 05.10.2029            | 5.200           | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,063              | 05.10.2029            | 8.000           | 4                                               | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250              | 17.09.2035            | 83.000          | 119                                             | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250              | 17.09.2055            | 39.100          | 2.800                                           | 0,07                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,300              | 25.09.2029            | 4.500           | (69)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,350              | 29.04.2030            | 2.700           | (11)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,400              | 09.04.2030            | 3.300           | (20)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,410              | 05.11.2034            | 2.500           | 5                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,420              | 07.03.2035            | 1.790           | (25)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,460              | 13.03.2035            | 2.000           | (21)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,610              | 24.03.2035            | 1.900           | 10                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,760              | 03.01.2029            | 2.300           | (54)                                            | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 7,750              | 01.04.2030            | MXN 58.400      | 7                                               | 0,00                         |
|                                                |                         |                    |                       |                 | \$ 24.987                                       | 0,61                         |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                    |                       |                 | \$ 27.047                                       | 0,66                         |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### OPTIONSKAUF

##### DEVIENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,110           | 26.11.2025         | 3.940                          | \$ 17  | \$ 13          | 0,00                         |
| BRC        | Call - OTC USD versus SEK | SEK 10,200         | 26.11.2025         | 8.499                          | 53     | 51             | 0,00                         |
| GLM        | Put - OTC EUR versus USD  | \$ 1,100           | 17.12.2025         | 1.003                          | 115    | 82             | 0,00                         |
| MBC        | Put - OTC EUR versus USD  | 1,098              | 23.12.2025         | 1.094                          | 127    | 85             | 0,01                         |
| MYI        | Put - OTC EUR versus USD  | 1,110              | 24.11.2025         | 22.473                         | 105    | 72             | 0,00                         |
|            |                           |                    |                    |                                | \$ 417 | \$ 303         | 0,01                         |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|----------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,360 %            | 14.07.2025         | 128.400                        | \$ 128   | \$ 3           | 0,00                         |
| CBK        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,500              | 21.07.2025         | 222.000                        | 189      | 31             | 0,00                         |
| FAR        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,650              | 04.08.2025         | 180.400                        | 226      | 105            | 0,00                         |
| JPM        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,650              | 12.08.2025         | 140.700                        | 120      | 108            | 0,01                         |
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,700              | 13.08.2025         | 55.200                         | 55       | 55             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,450              | 17.07.2025         | 201.400                        | 191      | 17             | 0,00                         |
|            | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,650              | 04.08.2025         | 108.800                        | 133      | 64             | 0,00                         |
|            |                                      |                            |                                             |                    |                    |                                | \$ 1.042 | \$ 383         | 0,01                         |

#### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %            | 16.07.2025         | 6.900                          | \$ (9)  | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900              | 16.07.2025         | 13.400                         | (15)    | (1)            | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000              | 16.07.2025         | 6.400                          | (7)     | 0              | 0,00                         |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850              | 16.07.2025         | 7.100                          | (9)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900              | 16.07.2025         | 6.200                          | (7)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                  |                         |                    |                    |                                | \$ (47) | \$ (3)         | 0,00                         |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld    | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|------------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,519 %            | 14.07.2025         | 15.300                         | \$ (129)   | \$ (21)        | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,555              | 24.07.2025         | 2.900                          | (9)        | (10)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,637              | 18.07.2025         | 3.200                          | (10)       | (16)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,700              | 21.07.2025         | 2.900                          | (9)        | (22)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,770              | 09.07.2025         | 3.000                          | (10)       | (27)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,905              | 24.07.2025         | 2.900                          | (9)        | (5)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,037              | 18.07.2025         | 3.200                          | (10)       | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,050              | 21.07.2025         | 2.900                          | (9)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,120              | 09.07.2025         | 3.000                          | (10)       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,489              | 21.07.2025         | 26.400                         | (189)      | (51)           | 0,00                         |
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,564              | 24.07.2025         | 2.900                          | (10)       | (11)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,605              | 23.07.2025         | 3.100                          | (11)       | (15)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,914              | 24.07.2025         | 2.900                          | (9)        | (5)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,955              | 23.07.2025         | 3.100                          | (10)       | (4)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,380              | 03.07.2025         | 1.400                          | (4)        | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR     | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 1.800                          | (6)        | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,640              | 03.07.2025         | 1.400                          | (4)        | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR     | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 1.800                          | (6)        | (3)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,700              | 04.08.2025         | 21.500                         | (226)      | (212)          | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,750              | 03.07.2025         | 3.800                          | (14)       | (26)           | 0,00                         |
| FAR        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,790              | 09.07.2025         | 3.700                          | (12)       | (39)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,100              | 03.07.2025         | 3.800                          | (14)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,140              | 09.07.2025         | 3.700                          | (12)       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,525              | 28.07.2025         | 2.900                          | (9)        | (10)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,583              | 23.07.2025         | 1.500                          | (5)        | (6)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,680              | 07.07.2025         | 1.600                          | (6)        | (6)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,695              | 17.07.2025         | 3.000                          | (9)        | (21)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,775              | 07.07.2025         | 3.200                          | (10)       | (28)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,875              | 28.07.2025         | 2.900                          | (10)       | (7)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 3,933              | 23.07.2025         | 1.500                          | (5)        | (2)            | 0,00                         |
| GLM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,030              | 07.07.2025         | 1.600                          | (6)        | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,095              | 17.07.2025         | 3.000                          | (9)        | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,125              | 07.07.2025         | 3.200                          | (10)       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,739              | 12.08.2025         | 16.500                         | (119)      | (212)          | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,757              | 13.08.2025         | 6.500                          | (55)       | (90)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,772              | 10.07.2025         | 3.100                          | (10)       | (30)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,122              | 10.07.2025         | 3.100                          | (10)       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,515              | 17.07.2025         | 24.000                         | (192)      | (46)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,669              | 07.07.2025         | 3.000                          | (11)       | (10)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,697              | 16.07.2025         | 2.900                          | (8)        | (20)           | 0,00                         |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,708              | 04.08.2025         | 12.900                         | (133)      | (131)          | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,715              | 02.07.2025         | 3.400                          | (12)       | (14)           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                                      | 3,725              | 03.07.2025         | 3.000                          | (11)       | (16)           | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,019              | 07.07.2025         | 3.000                          | (11)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,065              | 02.07.2025         | 3.400                          | (12)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,075              | 03.07.2025         | 3.000                          | (11)       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                                     | 4,097              | 16.07.2025         | 2.900                          | (8)        | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                | \$ (1.414) | \$ (1.123)     | (0,03)                       |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |
|            |                                       |                         |                                             |                    |                    |                                |            |                |                              |

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | \$ 92,469          | 07.07.2025         | 2.800                          | \$ (16) | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469             | 07.07.2025         | 2.800                          | (13)    | (1)            | 0,00                         |
|            |                                                                               |                    |                    |                                | \$ (29) | \$ (1)         | 0,00                         |

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                        | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Colombia Government International Bond | 1,000 %                        | 20.06.2027            | \$ 1.600                       | \$ (77)                                  | \$ 73                                           | \$ (4)         | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2027            | 400                            | (36)                                     | 33                                              | (3)            | 0,00                         |
| BRC        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026            | 2.325                          | (108)                                    | 107                                             | (1)            | 0,00                         |
| CBK        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2027            | 700                            | (25)                                     | 23                                              | (2)            | 0,00                         |
| GST        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2027            | 3.000                          | (112)                                    | 104                                             | (8)            | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2027            | 1.300                          | (116)                                    | 106                                             | (10)           | 0,00                         |
|            | Petroleos Mexicanos                    | 4,850                          | 07.05.2026            | 5.568                          | 0                                        | 68                                              | 68             | 0,00                         |
| JPM        | SoftBank Group Corp.                   | 1,000                          | 20.06.2026            | 2.300                          | (19)                                     | 9                                               | (10)           | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2026            | 2.275                          | (104)                                    | 103                                             | (1)            | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2027            | 400                            | (15)                                     | 14                                              | (1)            | 0,00                         |
| MYC        | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.06.2027            | 2.900                          | (104)                                    | 96                                              | (8)            | 0,00                         |
|            | Colombia Government International Bond | 1,000                          | 20.12.2027            | 3.400                          | (303)                                    | 276                                             | (27)           | 0,00                         |
|            |                                        |                                |                       |                                | \$ (1.019)                               | \$ 1.012                                        | \$ (7)         | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------|----------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------|-----------|----------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                     | 20.12.2029       | € 14.569                  | \$ 2.814                              | \$ 338                                   | \$ 3.152  | 0,08                 |
| JPM        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000                       | 20.12.2029       | 16.833                    | 3.459                                 | 182                                      | 3.641     | 0,09                 |
|            |                                  |                             |                  |                           | \$ 6.273                              | \$ 520                                   | \$ 6.793  | 0,17                 |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| AZD        | 07.2025          | CAD 18              | \$ 13                 | \$ 0                          | \$ 0                            | \$ 0                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CNH 13.041          | 1.810                 | 0                             | (13)                            | (13)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | € 1.362             | 1.595                 | 0                             | (4)                             | (4)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 47.852           | AUD 73.664            | 424                           | 0                               | 424                                           | 0,01                 |
|            | 07.2025          | 168                 | € 148                 | 6                             | 0                               | 6                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 2.021               | NZD 3.359             | 18                            | 0                               | 18                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | AUD 73.664          | \$ 47.880             | 0                             | (426)                           | (426)                                         | (0,01)               |
|            | 08.2025          | CNH 27.641          | 3.853                 | 0                             | (20)                            | (20)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | NZD 3.359           | 2.023                 | 0                             | (18)                            | (18)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 13               | CAD 18                | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BOA        | 08.2025          | 1.598               | € 1.362               | 4                             | 0                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | AUD 676             | \$ 440                | 0                             | (3)                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 1.016            | IDR 16.570.067        | 5                             | 0                               | 5                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 1.098               | SGD 1.405             | 6                             | 0                               | 6                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH 5.808           | \$ 812                | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | SGD 1.402           | 1.098                 | 0                             | (6)                             | (6)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | TWD 456             | 14                    | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | \$ 1.204            | MXN 22.842            | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | CAD 13.738          | \$ 10.056             | 0                             | (12)                            | (12)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK 2.220           | 219                   | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
| BPS        | 07.2025          | THB 1.189           | 36                    | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TWD 134.818         | 4.149                 | 0                             | (493)                           | (493)                                         | (0,01)               |
|            | 07.2025          | \$ 910              | BRL 5.066             | 18                            | 0                               | 18                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 133                 | € 115                 | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 2.000               | IDR 32.626.237        | 10                            | 0                               | 10                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 18                  | KRW 24.488            | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 520                 | THB 17.031            | 4                             | 0                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 511                 | TWD 15.212            | 12                            | 0                               | 12                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CNH 12.926          | \$ 1.810              | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CZK 439             | 20                    | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
| BRC        | 08.2025          | TWD 117.183         | 3.595                 | 0                             | (478)                           | (478)                                         | (0,01)               |
|            | 08.2025          | \$ 801              | INR 69.600            | 9                             | 0                               | 9                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 816                 | MXN 15.550            | 3                             | 0                               | 3                                             | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 4.642               | TWD 137.406           | 134                           | 0                               | 134                                           | 0,00                 |
|            | 05.2026          | 706                 | KWD 215               | 0                             | (3)                             | (3)                                           | 0,00                 |
|            | 06.2026          | 483                 | 147                   | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 06.2027          | 266                 | 81                    | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |
|            | 05.2029          | KWD 1.021           | \$ 3.510              | 154                           | 0                               | 154                                           | 0,00                 |
|            | 07.2029          | 105                 | 360                   | 16                            | 0                               | 16                                            | 0,00                 |
|            | 07.2025          | € 800.990           | 909.636               | 0                             | (30.605)                        | (30.605)                                      | (0,74)               |
| BSH        | 07.2025          | IDR 12.825.328      | 785                   | 0                             | (5)                             | (5)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | ILS 6.595           | 1.894                 | 0                             | (64)                            | (64)                                          | 0,00                 |
|            | 07.2025          | NOK 1.105           | 109                   | 0                             | (1)                             | (1)                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | TRY 108             | 3                     | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | \$ 245.134          | £ 180.172             | 1.765                         | 0                               | 1.765                                         | 0,04                 |
|            | 07.2025          | 939                 | ILS 3.171             | 2                             | 0                               | 2                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 827                 | KRW 1.129.408         | 8                             | 0                               | 8                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 60                  | NOK 606               | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 112                 | PLN 420               | 4                             | 0                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 21.851              | TRY 899.689           | 480                           | 0                               | 480                                           | 0,01                 |
| BSH        | 07.2025          | ZAR 128.222         | \$ 7.086              | 0                             | (117)                           | (117)                                         | 0,00                 |
|            | 08.2025          | CZK 4.329           | 195                   | 0                             | (11)                            | (11)                                          | 0,00                 |
|            | 08.2025          | £ 179.298           | 243.988               | 0                             | (1.749)                         | (1.749)                                       | (0,04)               |
|            | 08.2025          | \$ 6.199            | TRY 257.215           | 68                            | 0                               | 68                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | 4.045               | TWD 119.328           | 103                           | 0                               | 103                                           | 0,00                 |
|            | 07.2025          | 4.419               | PEN 15.980            | 84                            | 0                               | 84                                            | 0,00                 |
|            | 08.2025          | PEN 16.679          | \$ 4.514              | 0                             | (179)                           | (179)                                         | (0,01)               |
|            | 09.2025          | 31.678              | 8.626                 | 0                             | (281)                           | (281)                                         | (0,01)               |
|            | 09.2025          | \$ 223              | PEN 809               | 4                             | 0                               | 4                                             | 0,00                 |
|            | 12.2025          | PEN 15.708          | \$ 4.328              | 0                             | (80)                            | (80)                                          | 0,00                 |
| CBK        | 07.2025          | CAD 30              | 21                    | 0                             | 0                               | 0                                             | 0,00                 |
|            | 07.2025          | € 5.535             | 6.340                 | 0                             | (157)                           | (157)                                         | 0,00                 |
|            | 07.2025          | £ 179               | 243                   | 0                             | (2)                             | (2)                                           | 0,00                 |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| DUB        | 07.2025               | KRW                    | 11.917.744               | \$ 8.689                         | \$ 0                               | \$ (123)                                             | 0,00                         |
|            | 07.2025               | PEN                    | 15.641                   | 4.279                            | 0                                  | (128)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 62.213                   | 1.871                            | 0                                  | (45)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 223.287                  | 6.864                            | 0                                  | (823)                                                | (0,02)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 6.740                    | BRL 39.414                       | 481                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 4.840                    | € 4.193                          | 82                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.419                    | IDR 23.114.268                   | 4                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 98                       | KRW 133.362                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 245                      | PEN 888                          | 5                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.998                    | TWD 59.314                       | 44                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 4.152                    | \$ 578                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 242.967                  | 7.451                            | 0                                  | (994)                                                | (0,02)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.353                    | CNH 9.794                        | 19                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 8.788                    | INR 756.930                      | 24                                 | (7)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025               | MXN                    | 3.999                    | \$ 208                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025               | PEN                    | 30.144                   | 8.158                            | 0                                  | (320)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | ILS                    | 3.203                    | 924                              | 0                                  | (27)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 163.634                  | 120                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 145                      | 112                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 111                      | IDR 1.810.743                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 562                      | TWD 16.694                       | 13                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 4.189                    | INR 360.934                      | 12                                 | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025               | PEN                    | 2.661                    | \$ 724                           | 0                                  | (25)                                                 | 0,00                         |
| FAR        | 07.2025               | AUD                    | 72.988                   | 47.092                           | 0                                  | (741)                                                | (0,02)                       |
|            | 07.2025               | CHF                    | 3.968                    | 4.819                            | 0                                  | (166)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CNH                    | 6.634                    | 923                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 4.611.257                | 32.144                           | 220                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 324                      | 252                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.709                    | BRL 15.489                       | 129                                | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 4.950                    | CHF 3.963                        | 28                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 18.092                   | ¥ 2.633.442                      | 140                                | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 2.070                    | PLN 7.634                        | 42                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 882                      | SGD 1.125                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CHF                    | 3.947                    | \$ 4.950                         | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 13.643                   | 1.907                            | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ¥                      | 2.623.758                | 18.092                           | 0                                  | (140)                                                | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 1.123                    | 882                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.328                    | INR 114.856                      | 8                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               |                        | 10.724                   | MXN 208.817                      | 240                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 09.2025               |                        | 0                        | PEN 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | BRL                    | 155.376                  | \$ 28.177                        | 0                                  | (291)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | IDR                    | 749.126                  | 46                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 15.569                   | 479                              | 0                                  | (57)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 111                      | € 95                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 336                      | IDR 5.482.811                    | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 343                      | SGD 437                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               |                        | 35                       | TWD 1.138                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 337                      | \$ 19                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 436                      | 343                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | \$                     | 28.177                   | BRL 157.778                      | 296                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 12.2025               |                        | 1.965                    | MXN 38.041                       | 12                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CNH                    | 12.568                   | \$ 1.741                         | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 643.264                  | 469                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | NZD                    | 3.359                    | 2.003                            | 0                                  | (36)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | 9.699                    | 7.551                            | 0                                  | (64)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 136.437                  | 4.195                            | 0                                  | (502)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.029                    | KRW 1.401.033                    | 7                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 4.928                    | PLN 18.286                       | 130                                | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 719                      | SGD 920                          | 4                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 56.818                   | \$ 3.179                         | 0                                  | (13)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 25.748                   | 3.587                            | 0                                  | (22)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 918                      | 719                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 114.693                  | 3.516                            | 0                                  | (471)                                                | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 895                      | INR 77.625                       | 8                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 1.580                    | TWD 46.594                       | 40                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CAD                    | 67.715                   | \$ 49.303                        | 0                                  | (324)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | CNH                    | 6.025                    | 836                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 126                      | 171                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | HKD                    | 17.709                   | 2.264                            | 5                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 210.620                  | 1.466                            | 8                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| MBC        | 07.2025               | SGD                    | 23.301                   | 18.163                           | 0                                  | (132)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 31.230                   | 944                              | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 68.369                   | 2.098                            | 0                                  | (256)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 64.578                   | CAD 88.769                       | 478                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 11.150                   | € 9.663                          | 193                                | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 346                      | IDR 5.624.734                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 863                      | PLN 3.230                        | 31                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 18.964                   | SGD 24.524                       | 291                                | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               |                        | 1.330                    | TWD 42.070                       | 118                                | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CAD                    | 88.620                   | \$ 64.578                        | 0                                  | (479)                                                | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | CNH                    | 13.280                   | 1.845                            | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 24.467                   | 18.964                           | 0                                  | (295)                                                | (0,01)                       |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| MYI        | 08.2025               | TWD                    | 90.422                   | \$ 2.783                         | \$ 0                               | \$ (360)                                             | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | CAD                    | 7.253                    | 5.324                            | 11                                 | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 8                        | 12                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 104.167                  | 721                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | NOK                    | 2.726                    | 270                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 15                       | CAD 20                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 241                      | CHF 192                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 191                      | € 163                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 105                      | £ 77                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 5.753                    | ¥ 838.986                        | 55                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 11                       | PLN 40                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 69                       | SGD 88                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 13.906                   | \$ 1.942                         | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ¥                      | 835.902                  | 5.753                            | 0                                  | (55)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 270                      | NOK 2.725                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 2.280                    | CNH 16.307                       | 5                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | IDR                    | 12.948.913               | \$ 793                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                         |
| SCX        | 07.2025               | ILS                    | 49                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.565                    | IDR 25.498.774                   | 6                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 7                        | ¥ 1.041                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 3.787                    | SGD 4.884                        | 48                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 410                      | THB 13.514                       | 6                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 6.576                    | TWD 192.542                      | 52                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 23.958                   | \$ 3.354                         | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ¥                      | 1.037                    | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 4.873                    | 3.787                            | 0                                  | (49)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 38.603                   | 1.183                            | 0                                  | (159)                                                | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.568                    | CNH 11.421                       | 32                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 1.641                    | INR 140.878                      | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | NOK                    | 284                      | \$ 28                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 358                      | € 311                            | 7                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 843                      | ¥ 121.708                        | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | ¥                      | 121.261                  | \$ 843                           | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 5                        | INR 464                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SSB        | 08.2025               |                        | 28                       | NOK 284                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 179.867                  | \$ 243.544                       | 0                                  | (2.937)                                              | (0,07)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 16.263                   | BRL 95.114                       | 1.164                              | 0                                                    | 0,03                         |
|            | 08.2025               |                        | 10                       | CAD 14                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| UAG        | 11.2025               | PEN                    | 11.897                   | \$ 3.225                         | 0                                  | (116)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | IDR                    | 12.891.279               | 794                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                    | 485                      | 135                              | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | 67.967                   | 470                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 1.127.622                | 831                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    | 4.959                    | 149                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 794                      | IDR 12.887.919                   | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 831                      | KRW 1.127.077                    | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 564                      | NOK 5.728                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 2.456                    | CNH 17.601                       | 11                                 | 0                                                    | 0,00                         |
| WST        | 09.2025               | MXN                    | 249                      | \$ 13                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 930.956                  | € 793.891                        | 952                                | 0                                                    | 0,02                         |
|            | 07.2025               |                        | 9.711                    | ¥ 1.398.462                      | 0                                  | (29)                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | €                      | 793.891                  | \$ 932.988                       | 0                                  | (953)                                                | (0,02)                       |
|            | 08.2025               | ¥                      | 1.393.316                | 9.711                            | 29                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 8.847                         | \$ (46.031)                        | \$ (37.184)                                          | (0,90)                       |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CAD                    | 2.092                    | \$ 1.534                         | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.534                    | CAD 2.089                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025               |                        | 2.591                    | 3.567                            | 23                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                        | 2.659                    | 3.675                            | 35                                 | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | CAD                    | 99                       | \$ 72                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 54                       | CAD 74                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| MBC        | 07.2025               | CAD                    | 3.734                    | \$ 2.716                         | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.652                    | CAD 3.642                        | 17                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 2.716                    | 3.727                            | 20                                 | 0                                                    | 0,00                         |
| MYI        | 07.2025               | CAD                    | 106                      | \$ 77                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 5                        | CAD 7                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SCX        | 07.2025               |                        |                          |                                  | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CAD                    | 3.736                    | \$ 2.738                         | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
| SSB        | 07.2025               |                        |                          |                                  | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.738                    | CAD 3.730                        | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 96                            | \$ (21)                            | \$ 75                                                | 0,00                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CHF                    | \$ 5.095                 | \$ 6.380                         | \$ 0                               | \$ (22)                                              | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 6.380                    | CHF 5.074                        | 22                                 | 22                                                   | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025               | CHF                    | \$ 147                   | \$ 181                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               | \$                     | 6                        | CHF 5                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| CBK        | 07.2025               | CHF                    | \$ 253                   | \$ 310                           | 0                                  | (8)                                                  | 0,00                         |
| FAR        | 07.2025               |                        | 5.055                    | 6.314                            | 0                                  | (36)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 6.193                    | CHF 5.100                        | 214                                | 214                                                  | 0,01                         |
|            | 08.2025               |                        | 6.314                    | 5.034                            | 36                                 | 36                                                   | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | CHF                    | \$ 70                    | \$ 86                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
| MBC        | 07.2025               | \$                     | 6.151                    | CHF 5.055                        | 199                                | 199                                                  | 0,00                         |
| MYI        | 07.2025               | CHF                    | \$ 192                   | \$ 241                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
| RBC        | 07.2025               | \$                     | 6.160                    | CHF 5.052                        | 187                                | 187                                                  | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 658                           | \$ (72)                            | \$ 586                                               | 0,01                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | €                      | 252.71                   | \$ 295.989                       | \$ 0                               | \$ (751)                                             | (0,02)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 296.61                   | € 252.792                        | 749                                | 749                                                  | 0,02                         |
| BOA        | 07.2025               |                        | 320.91                   | 282.253                          | 10.387                             | 10.387                                               | 0,25                         |
| BPS        | 07.2025               | €                      | 3.51                     | \$ 4.045                         | 0                                  | (64)                                                 | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               |                        | 11.41                    | 13.088                           | 0                                  | (336)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 321.41                   | € 283.065                        | 10.816                             | 10.816                                               | 0,26                         |
| CBK        | 07.2025               | €                      | 4.61                     | \$ 5.312                         | 0                                  | (131)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 471                      | € 402                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                         |
| DUB        | 07.2025               | €                      | 279.71                   | \$ 324.570                       | 0                                  | (3.848)                                              | (0,09)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 324.51                   | € 279.164                        | 3.843                              | 3.843                                                | 0,09                         |
| MBC        | 07.2025               | €                      | 13.41                    | \$ 15.407                        | 0                                  | (336)                                                | (0,01)                       |
| WST        | 07.2025               |                        | 277.41                   | 325.343                          | 0                                  | (333)                                                | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 313.71                   | € 277.680                        | 12.254                             | 12.254                                               | 0,30                         |
|            | 08.2025               |                        | 326.01                   | 277.443                          | 333                                | 333                                                  | 0,01                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 38.383                        | \$ (5.799)                         | \$ 32.584                                            | 0,79                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £                      | 6.71                     | \$ 9.288                         | \$ 13                              | \$ 13                                                | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 9.21                     | £ 6.768                          | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                         |
| BOA        | 07.2025               | £                      | 98                       | \$ 133                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               |                        | 7.51                     | 10.328                           | 0                                  | (76)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 9.61                     | £ 7.179                          | 145                                | 145                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 10.11                    | 7.427                            | 72                                 | 72                                                   | 0,00                         |
| CBK        | 07.2025               |                        | 409                      | 301                              | 4                                  | 4                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               |                        | 9.71                     | 7.266                            | 168                                | 168                                                  | 0,01                         |
| MBC        | 07.2025               | £                      | 212                      | \$ 287                           | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 32                       | £ 24                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SSB        | 07.2025               | £                      | 7.31                     | \$ 10.087                        | 6                                  | 6                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 9.71                     | £ 7.226                          | 118                                | 118                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 10.01                    | 7.356                            | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                         |
| UAG        | 07.2025               |                        | 40                       | 30                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                        |                          | \$ 526                           | \$ (98)                            | \$ 428                                               | 0,01                         |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| BOA        | 07.2025               | SGD                    | \$ 4.21                  | \$ 3.315                         | \$ 0                               | \$ (18)                                              | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 3.31                     | SGD 4.235                        | 18                                 | 18                                                   | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               | SGD                    | \$ 41                    | \$ 32                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| CBK        | 07.2025               |                        | 781                      | 609                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
| DUB        | 07.2025               | \$                     | 4.31                     | SGD 5.607                        | 50                                 | 50                                                   | 0,00                         |
| FAR        | 07.2025               | SGD                    | \$ 9.21                  | \$ 7.263                         | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 8.51                     | SGD 11.001                       | 87                                 | 87                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 7.21                     | 9.241                            | 11                                 | 11                                                   | 0,00                         |
| GLM        | 07.2025               | SGD                    | \$ 4.01                  | \$ 3.195                         | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 3.11                     | SGD 4.063                        | 3                                  | 3                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | SGD                    | \$ 4.21                  | \$ 3.347                         | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 9.01                     | SGD 11.670                       | 78                                 | 78                                                   | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                        | 3.31                     | 4.275                            | 19                                 | 19                                                   | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| MBC                              | 07.2025               | SGD                    | 10.763                   | \$ 8.324                         | \$ 0                               | \$ (127)                                             | 0,00                         |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 6.777                    | SGD 8.694                        | 49                                 | 49                                                   | 0,00                         |
|                                  | 08.2025               |                        | 8.188                    | 10.564                           | 127                                | 127                                                  | 0,01                         |
| MYI                              | 07.2025               | SGD                    | 80                       | \$ 62                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 12                       | SGD 15                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SCX                              | 07.2025               | SGD                    | 1.801                    | \$ 1.396                         | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                         |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 1.396                    | SGD 1.797                        | 18                                 | 18                                                   | 0,00                         |
| SSB                              | 07.2025               |                        | 128                      | 163                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| UAG                              | 07.2025               | SGD                    | 43                       | \$ 33                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 460                           | \$ (199)                           | \$ 261                                               | 0,01                         |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 3.095                                             | 0,08                         |

### LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                          |                |                          |                                   |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>2,000 % fällig am 01.08.2055 | \$ 1.500       | \$ (1.188)               | (0,03)                            |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere                                       |                | \$ (1.188)               | (0,03)                            |
| Summe Anlagen                                                         |                | \$ 6.097.383             | 147,81                            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                           |                | \$ (1.972.166)           | (47,81)                           |
| Nettovermögen                                                         |                | \$ 4.125.217             | 100,00                            |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- (a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.
- (b) Wertpapier per Emissionstermin.
- (c) Nullkuponwertpapier.
- (d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.
- (f) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (g) Mit dem Fonds verbunden.
- (h) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,02 %):

| Emittentenbeschreibung           | Kupon   | Fälligkeits-<br>datum | Kauf-<br>datum | Kosten   | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|---------|-----------------------|----------------|----------|----------------|------------------------------|
| Coastal Gaslink Pipeline LP      | 5,857 % | 30.03.2049            | 04.06.2024     | \$ 1.023 | \$ 1.160       | 0,03                         |
| Pantheon Senior Debt Secondaries | 6,317   | 26.03.2026            | 18.03.2025     | 1.400    | 1.400          | 0,03                         |
| Project Alfa                     | 4,256   | 27.02.2026            | 28.02.2025     | 885      | 998            | 0,03                         |
|                                  |         |                       |                | \$ 3.308 | \$ 3.558       | 0,09                         |

- (j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 135.006 USD (31. Dezember 2024: 224.403 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 6.630 USD) als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 1.246 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 82.436 USD (31. Dezember 2024: USD 80.196) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 23.490 USD (31. Dezember 2024: 11.600 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 5.921.938                                                    | \$ 11.524                                                    | \$ 5.933.462        |
| Investmentfonds               | 122.021                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 122.021             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 2.987                                                                       | 40.101                                                          | 0                                                            | 43.088              |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (1.188)                                                         | 0                                                            | (1.188)             |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 125.008</b>                                                           | <b>\$ 5.960.851</b>                                             | <b>\$ 11.524</b>                                             | <b>\$ 6.097.383</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 5.500.546                                                    | \$ 4.511                                                     | \$ 5.505.057        |
| Investmentfonds               | 172.630                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 172.630             |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 5.765                                                                       | 29.936                                                          | 0                                                            | 35.701              |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (1.168)                                                         | 0                                                            | (1.168)             |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 178.395</b>                                                           | <b>\$ 5.529.314</b>                                             | <b>\$ 4.511</b>                                              | <b>\$ 5.712.220</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:**

| Kontrahent                                | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus Pensions-<br>geschäften | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| BOS                                       | 4,250 %         | 23.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (2.857)   | \$ (2.860)                                       | (0,07)                       |
|                                           | 4,290           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (2.453)      | (2.455)                                          | (0,06)                       |
|                                           | 4,430           | 16.06.2025            | 14.07.2025            | (28.341)     | (28.393)                                         | (0,69)                       |
| BRC                                       | 4,150           | 30.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (7.339)      | (7.340)                                          | (0,18)                       |
|                                           | 4,420           | 27.06.2025            | 03.07.2025            | (23.020)     | (23.031)                                         | (0,56)                       |
| BSN                                       | 4,450           | 09.06.2025            | 14.07.2025            | (36.964)     | (37.065)                                         | (0,90)                       |
| CIB                                       | 4,440           | 06.06.2025            | 18.07.2025            | (3.864)      | (3.875)                                          | (0,09)                       |
| DEU                                       | 4,480           | 25.06.2025            | 02.07.2025            | (2.277)      | (2.279)                                          | (0,06)                       |
| JPS                                       | 4,350           | 23.06.2025            | 07.07.2025            | (2.936)      | (2.939)                                          | (0,07)                       |
|                                           | 4,550           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | (1.403)      | (1.403)                                          | (0,03)                       |
| STR                                       | 4,490           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | (21.477)     | (21.480)                                         | (0,52)                       |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |                 |                       |                       |              | <b>\$ (133.120)</b>                              | <b>(3,23)</b>                |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für Derivative OTC-Finanzinstrumente**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der Derivative OTC-Finanzinstrumente und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (30)                             | \$ 10                                 | \$ (20)                             | \$ (64)                             | \$ 0                                  | \$ (64)                             |
| BOA        | 10.280                              | (9.900)                               | 380                                 | 28                                  | (160)                                 | (132)                               |
| BPS        | 2.487                               | (2.560)                               | (73)                                | 703                                 | (620)                                 | 83                                  |
| BRC        | (19.451)                            | 18.160                                | (1.291)                             | 2.534                               | (2.270)                               | 264                                 |
| BSH        | (452)                               | 360                                   | (92)                                | 10                                  | 0                                     | 10                                  |
| CBK        | (2.114)                             | 1.980                                 | (134)                               | 947                                 | (570)                                 | 377                                 |
| CKL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (189)                               | 0                                     | (189)                               |
| DUB        | 14                                  | 0                                     | 14                                  | (7.340)                             | 6.410                                 | (930)                               |
| FAR        | (150)                               | 0                                     | (150)                               | 1.809                               | (1.490)                               | 319                                 |
| GLM        | (33)                                | 150                                   | 117                                 | (1.421)                             | 1.280                                 | (141)                               |
| GST        | 38                                  | 0                                     | 38                                  | (25)                                | 0                                     | (25)                                |
| JPM        | 2.771                               | (2.590)                               | 181                                 | 1.848                               | (1.900)                               | (52)                                |
| MBC        | (753)                               | 820                                   | 67                                  | (4.968)                             | 3.790                                 | (1.178)                             |
| MYC        | (191)                               | 0                                     | (191)                               | (5)                                 | 0                                     | (5)                                 |
| MYI        | 74                                  | 0                                     | 74                                  | 9                                   | 120                                   | 129                                 |
| RBC        | 186                                 | 0                                     | 186                                 | (35)                                | 0                                     | (35)                                |
| RYL        | 5                                   | 0                                     | 5                                   | 56                                  | 0                                     | 56                                  |
| SAL        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SCX        | (73)                                | 0                                     | (73)                                | 8.827                               | (7.590)                               | 1.237                               |
| SOG        | 7                                   | 0                                     | 7                                   | (62)                                | 0                                     | (62)                                |
| SSB        | (1.771)                             | 2.010                                 | 239                                 | 7                                   | 0                                     | 7                                   |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| UAG        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | (40)                                | 0                                     | (40)                                |
| WST        | 12.253                              | (11.680)                              | 573                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.



**Vergleichsinformationen**

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 37,92             | 31,77             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 31,43             | 33,29             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,03              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                        | 1,43              | 2,05              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,16              | 0,07              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,39              | 0,47              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,66              | 0,26              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 27,98             | 32,09             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 0,22              | 0,21              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 48,69             | 50,14             |
| Kommunalanleihen und Wechsel                                                           | 0,37              | 0,49              |
| US-Regierungsbehörden                                                                  | 55,32             | 49,39             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 18,33             | 19,08             |
| Non-Agency-MBS                                                                         | 5,09              | 6,37              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                                                       | 6,30              | 6,40              |
| Staatsemissionen                                                                       | 9,43              | 5,44              |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 0,08              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                                        | 2,96              | 4,31              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,32              | (0,02)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | (0,01)            | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,08              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,04              | 0,00              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,61              | 0,76              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | 0,01              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,01              | 0,01              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,03)            | (0,03)            |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,17              | 0,05              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,90)            | 0,55              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,82              | (0,52)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                                                              | (0,03)            | (0,03)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (47,81)           | (42,69)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| Beschreibung                                 | Pari<br>(000S) | Markt-<br>wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens | Beschreibung                            | Pari<br>(000S) | Markt-<br>wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens | Beschreibung                              | Pari<br>(000S) | Markt-<br>wert<br>(000S) | % Des<br>Netto-<br>vermö-<br>gens |
|----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Übertragbare Wertpapiere                     |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| Unternehmensanleihen und Wechsel             |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| Banken und Finanzen                          |                |                          |                                   |                                         |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
| ABN AMRO Bank NV                             |                |                          |                                   | Volkswagen Group of America Finance LLC |                |                          |                                   | Carlyle Euro CLO DAC                      |                |                          |                                   |
| 5,387 % fällig am 03.12.2028                 | 1.000          | \$ 1.000                 | 0,97                              | 5,236 % fällig am 20.03.2026            | \$ 600         | \$ 600                   | 0,58                              | 3,033 % fällig am 15.08.2032              | € 289          | \$337                    | 0,33                              |
| American Honda Finance Corp.                 |                |                          |                                   | 5,327 % fällig am 12.09.2025            | 300            | 300                      | 0,29                              | Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. |                |                          |                                   |
| 4,925 % fällig am 21.05.2026                 | 1.000          | 1.001                    | 0,97                              |                                         |                | 5.979                    | 5,80                              | 5,658 % fällig am 15.07.2031              | \$ 396         | 397                      | 0,38                              |
| Aries Capital DAC                            |                |                          |                                   | Versorgungsunternehmen                  |                |                          |                                   | Euro-Galaxy CLO DAC                       |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 18.09.2030 (a)             | 9.684          | 5.712                    | 5,53                              | Electricite de France S.A.              |                |                          |                                   | 2,811 % fällig am 24.04.2034              | € 249          | 292                      | 0,28                              |
| Athene Global Funding                        |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 13.10.2025            | 1.100          | 1.096                    | 1,06                              | Greenwood Park CLO Ltd.                   |                |                          |                                   |
| 5,411 % fällig am 27.08.2026                 | 900            | 904                      | 0,88                              | Pacific Gas & Electric Co.              |                |                          |                                   | 5,528 % fällig am 15.04.2031              | \$ 341         | 342                      | 0,33                              |
| Banco Santander S.A.                         |                |                          |                                   | 2,950 % fällig am 01.03.2026            | 300            | 296                      | 0,29                              | Henley CLO DAC                            |                |                          |                                   |
| 5,465 % fällig am 15.07.2028                 | 1.000          | 1.003                    | 0,97                              |                                         |                | 1.392                    | 1,35                              | 3,148 % fällig am 25.04.2034              | € 700          | 821                      | 0,80                              |
| Bank of America N.A.                         |                |                          |                                   | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel  |                | 39.914                   | 38,72                             | Latitude Australia Personal Loans Series  |                |                          |                                   |
| 4,925 % fällig am 30.10.2026 AUD             | 1.000          | 659                      | 0,64                              | US-Regierungsbehörden                   |                |                          |                                   | 4,721 % fällig am 17.09.2033 AUD          | 404            | 265                      | 0,26                              |
| Bank of Montreal                             |                |                          |                                   | Fannie Mae                              |                |                          |                                   | Oak Hill European Credit Partners DAC     |                |                          |                                   |
| 5,274 % fällig am 10.09.2027                 | \$ 1.000       | 1.003                    | 0,97                              | 5,255 % fällig am 25.01.2055            | 570            | 570                      | 0,55                              | 2,976 % fällig am 20.10.2031              | € 147          | 173                      | 0,17                              |
| Bank of Nova Scotia                          |                |                          |                                   | 5,305 % fällig am 25.05.2055            | 193            | 193                      | 0,19                              | SLM Private Credit Student Loan Trust     |                |                          |                                   |
| 5,169 % fällig am 04.06.2027                 | 400            | 401                      | 0,39                              | 5,402 % fällig am 25.07.2055            | 900            | 900                      | 0,87                              | 4,870 % fällig am 15.06.2039              | \$ 253         | 246                      | 0,24                              |
| Barclays PLC                                 |                |                          |                                   | 5,405 % fällig am                       |                |                          |                                   |                                           |                | 5.446                    | 5,29                              |
| 5,304 % fällig am 09.08.2026                 | 1.000          | 1.000                    | 0,97                              | 25.06.2054 -                            |                |                          |                                   |                                           |                | 5.722                    | 5,56                              |
| BPCE S.A.                                    |                |                          |                                   | 25.01.2055                              | 1.275          | 1.273                    | 1,24                              | Staatsemissionen                          |                |                          |                                   |
| 5,202 % fällig am 29.09.2025 AUD             | 1.500          | 985                      | 0,96                              | 5,505 % fällig am 25.01.2055            | 468            | 469                      | 0,46                              | Brazil Letras do Tesouro Nacional         |                |                          |                                   |
| Canadian Imperial Bank of Commerce           |                |                          |                                   | Freddie Mac                             |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am                         |                |                          |                                   |
| 4,384 % fällig am 20.12.2027                 | 2.100          | 1.379                    | 1,34                              | 5,205 % fällig am                       |                |                          |                                   | 01.10.2025 (a)                            | BRL 5.200      | 919                      | 0,89                              |
| Citigroup, Inc.                              |                |                          |                                   | 25.09.2054 -                            |                |                          |                                   | Israel Government International Bond      |                |                          |                                   |
| 1,122 % fällig am 28.01.2027                 | \$ 1.300       | 1.274                    | 1,24                              | 25.11.2054                              | 1.469          | 1.465                    | 1,42                              | 5,375 % fällig am 19.02.2030              | \$ 1.100       | 1.122                    | 1,09                              |
| Credit Agricole S.A.                         |                |                          |                                   | 5,255 % fällig am 25.03.2055            | 756            | 757                      | 0,73                              |                                           |                | 2.041                    | 1,98                              |
| 5,632 % fällig am 05.07.2026                 | 100            | 101                      | 0,10                              | 5,305 % fällig am 25.06.2055            | 1.183          | 1.187                    | 1,15                              | Kurzfristige Instrumente                  |                |                          |                                   |
| Deutsche Bank AG                             |                |                          |                                   | 5,306 % fällig am 25.06.2055            | 400            | 401                      | 0,39                              | Commercial Paper                          |                |                          |                                   |
| 2,129 % fällig am 24.11.2026                 | 900            | 891                      | 0,86                              | 5,404 % fällig am 25.07.2055            | 500            | 500                      | 0,49                              | Air Lease Corp.                           |                |                          |                                   |
| Ford Motor Credit Co. LLC                    |                |                          |                                   | 5,455 % fällig am 25.12.2054            |                |                          |                                   | 4,840 % fällig am 08.07.2025              |                |                          |                                   |
| 4,134 % fällig am 04.08.2025                 | 200            | 200                      | 0,19                              | - 25.01.2055                            | 1.239          | 1.238                    | 1,20                              | 4,840 % fällig am 15.07.2025              | 300            | 300                      | 0,29                              |
| 4,389 % fällig am 08.01.2026                 | 500            | 498                      | 0,48                              | 5,505 % fällig am 25.01.2055            | 186            | 187                      | 0,18                              |                                           | 500            | 499                      | 0,48                              |
| Goldman Sachs Bank USA                       |                |                          |                                   | 5,555 % fällig am 25.05.2054            | 587            | 590                      | 0,57                              | Alimentation Couche-Tard, Inc.            |                |                          |                                   |
| 5,175 % fällig am 18.03.2027                 | 700            | 702                      | 0,68                              | Ginnie Mae                              |                |                          |                                   | 4,640 % fällig am 29.07.2025              | 300            | 299                      | 0,29                              |
| Greenleaves Capital DAC                      |                |                          |                                   | 5,204 % fällig am 20.06.2055            | 1.800          | 1.801                    | 1,75                              | 4,640 % fällig am 30.07.2025              | 400            | 398                      | 0,39                              |
| 0,000 % fällig am 18.09.2030 (a)             | 9.684          | 5.712                    | 5,54                              | 5,252 % fällig am                       |                |                          |                                   | CBRE Services, Inc.                       |                |                          |                                   |
| HSBC Holdings PLC                            |                |                          |                                   | 20.01.2054 -                            |                |                          |                                   | 4,640 % fällig am 24.07.2025              | 700            | 698                      | 0,68                              |
| 5,932 % fällig am 14.08.2027                 | 595            | 600                      | 0,58                              | 20.10.2073                              | 2.318          | 2.332                    | 2,26                              | Crown Castle, Inc.                        |                |                          |                                   |
| 5,966 % fällig am 12.09.2026                 | 400            | 401                      | 0,39                              | 5,276 % fällig am 20.08.2066            | 231            | 232                      | 0,23                              | 5,030 % fällig am 22.07.2025              | 500            | 498                      | 0,48                              |
| JPMorgan Chase & Co.                         |                |                          |                                   | 7,843 % fällig am 20.09.2066            | 241            | 249                      | 0,24                              | 5,030 % fällig am 24.07.2025              | 300            | 299                      | 0,29                              |
| 5,171 % fällig am 22.09.2027                 | 1.046          | 1.049                    | 1,02                              | Ginnie Mae, TBA                         |                |                          |                                   | CVS Corp.                                 |                |                          |                                   |
| Morgan Stanley Bank N.A.                     |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 01.08.2055            | 10.500         | 10.642                   | 10,33                             | 4,920 % fällig am 14.07.2025              | 800            | 798                      | 0,78                              |
| 5,030 % fällig am 15.10.2027                 | 1.200          | 1.201                    | 1,17                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA   |                |                          |                                   | Enbridge, Inc.                            |                |                          |                                   |
| National Bank of Canada                      |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.08.2040            | 3.300          | 3.323                    | 3,22                              | 4,600 % fällig am 21.07.2025              | 700            | 698                      | 0,68                              |
| 5,312 % fällig am 25.03.2027                 | 1.100          | 1.101                    | 1,07                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055            | 2.100          | 2.132                    | 2,07                              | HCA, Inc.                                 |                |                          |                                   |
| NatWest Markets PLC                          |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.08.2055            | 7.700          | 7.940                    | 7,70                              | 4,950 % fällig am 14.08.2025              | 200            | 199                      | 0,19                              |
| 5,055 % fällig am 12.08.2025 AUD             | 400            | 262                      | 0,25                              |                                         |                | 38.381                   | 37,24                             | 4,950 % fällig am 15.08.2025              | 200            | 199                      | 0,19                              |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC              |                |                          |                                   | Non-Agency-MBS                          |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 22.08.2025              | 800            | 794                      | 0,77                              |
| 1,850 % fällig am 16.09.2026                 | \$ 700         | 668                      | 0,65                              | Curzon Mortgages PLC                    |                |                          |                                   | Holcim Finance U.S. LLC                   |                |                          |                                   |
| Nordea Bank Abp                              |                |                          |                                   | 5,482 % fällig am 28.07.2049            | £ 559          | 768                      | 0,75                              | 4,670 % fällig am 15.07.2025              | 300            | 299                      | 0,29                              |
| 5,145 % fällig am 19.03.2027                 | 1.300          | 1.307                    | 1,27                              | Elstree Funding                         |                |                          |                                   | 4,670 % fällig am 16.07.2025              | 600            | 599                      | 0,58                              |
| Standard Chartered Bank                      |                |                          |                                   | 4,943 % fällig am 21.01.2065            | 1.371          | 1.879                    | 1,82                              | Intel Corp.                               |                |                          |                                   |
| 4,853 % fällig am 03.12.2027                 | 300            | 305                      | 0,30                              | FirstMac Mortgage Funding Trust         |                |                          |                                   | 4,590 % fällig am 03.07.2025              | 900            | 900                      | 0,87                              |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.              |                |                          |                                   | 4,815 % fällig am 16.09.2056 AUD        | 587            | 384                      | 0,37                              | Jabil, Inc.                               |                |                          |                                   |
| 5,554 % fällig am 14.09.2026                 | 100            | 101                      | 0,10                              | Liberty Trust                           |                |                          |                                   | 4,850 % fällig am 14.07.2025              | 700            | 699                      | 0,68                              |
| Swedbank AB                                  |                |                          |                                   | 4,423 % fällig am 25.09.2056            | 266            | 174                      | 0,17                              | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.     |                |                          |                                   |
| 5,337 % fällig am 20.09.2027                 | 1.100          | 1.123                    | 1,09                              | 4,773 % fällig am 25.09.2056            | 500            | 328                      | 0,32                              | 4,600 % fällig am 28.07.2025              | 800            | 797                      | 0,77                              |
|                                              |                | 32.543                   | 31,57                             | Olympus Trust                           |                |                          |                                   | NXP BV                                    |                |                          |                                   |
| Industriewerte                               |                |                          |                                   | 4,508 % fällig am 10.10.2056            | 689            | 452                      | 0,44                              | 4,640 % fällig am 10.09.2025              | 800            | 793                      | 0,77                              |
| Bayer U.S. Finance LLC                       |                |                          |                                   | ORDE Trust                              |                |                          |                                   | ONEOK, Inc.                               |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025                 | 1.000          | 997                      | 0,97                              | 4,905 % fällig am 11.06.2056            | 1.800          | 1.180                    | 1,14                              | 4,600 % fällig am 14.07.2025              | 800            | 798                      | 0,78                              |
| Berry Global, Inc.                           |                |                          |                                   | Triton Trust                            |                |                          |                                   | Targa Resources Corp.                     |                |                          |                                   |
| Cox Communications, Inc.                     |                |                          |                                   | 4,753 % fällig am 12.03.2057            | 700            | 458                      | 0,44                              | 4,700 % fällig am 29.07.2025              | 800            | 797                      | 0,77                              |
| 3,350 % fällig am 15.09.2026                 | 1.000          | 985                      | 0,96                              | White Rose Master Issuer PLC            |                |                          |                                   |                                           |                | 11.361                   | 11,02                             |
| Fidelity National Information Services, Inc. |                |                          |                                   | 4,743 % fällig am 16.04.2073            | £ 485          | 666                      | 0,65                              | Kurzfristige Schuldtitel                  |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.07.2025                 | 325            | 325                      | 0,31                              |                                         |                | 6.289                    | 6,10                              | Pacific Gas & Electric Co.                |                |                          |                                   |
| Hyundai Capital America                      |                |                          |                                   | Forderungsbesicherte Wertpapiere        |                |                          |                                   | 5,339 % fällig am 04.09.2025              | 500            | 500                      | 0,48                              |
| 5,847 % fällig am 08.01.2027                 | 300            | 302                      | 0,29                              | Automobile ABS sonstige                 |                |                          |                                   | U.S. Treasury Bills                       |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 03.11.2025                 | 700            | 703                      | 0,68                              | Pepper SPARKZ Trust                     |                |                          |                                   | 4,351 % fällig am                         |                |                          |                                   |
| MPLX LP                                      |                |                          |                                   | 4,735 % fällig am 15.01.2033 AUD        | 422            | 276                      | 0,27                              | 04.09.2025 (a)(b)(d)                      | 755            | 750                      | 0,73                              |
| 1,750 % fällig am 01.03.2026                 | 1.100          | 1.079                    | 1,05                              | ABS sonstige                            |                |                          |                                   | Summe kurzfristige Instrumente            |                | 12.611                   | 12,23                             |
|                                              |                |                          |                                   | AlbaCore Euro CLO DAC                   |                |                          |                                   | Summe Übertragbare Wertpapiere            | \$ 104.958     | 101,83                   |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 3,269 % fällig am 15.07.2035            | € 1.000        | 1.175                    | 1,14                              |                                           |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | Bain Capital Credit CLO Ltd.            |                |                          |                                   |                                           |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 5,299 % fällig am 21.10.2034            | \$ 700         | 696                      | 0,68                              |                                           |                |                          |                                   |
|                                              |                |                          |                                   | 5,509 % fällig am 19.07.2034            | 700            | 702                      | 0,68                              |                                           |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                             | AKTIEN  | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------|---------|---------------------------|-----------------------------------|
| <b>INVESTMENTFONDS</b>                   |         |                           |                                   |
| <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b> |         |                           |                                   |
| PIMCO Select Funds plc                   |         |                           |                                   |
| - PIMCO US Dollar                        |         |                           |                                   |
| Short-Term Floating                      |         |                           |                                   |
| NAV Fund (c)                             | 110.324 | \$ 1.100                  | 1,07                              |
| <b>BÖRSENGEHANDELTE FONDS</b>            |         |                           |                                   |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO                   |         |                           |                                   |
| US Dollar Short                          |         |                           |                                   |
| Maturity UCITS ETF (c)                   | 88.811  | 8.891                     | 8,62                              |
| Summe Investmentfonds                    |         | \$ 9.991                  | 9,69                              |

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| 3-Month EURIBOR March Futures                                  | Long  | 03.2026     | 21                      | \$ 1                                            | 0,00                         |
| 3-Month SOFR June Futures                                      | Long  | 09.2025     | 29                      | (2)                                             | 0,00                         |
| 3-Month SOFR March Futures                                     | Long  | 06.2026     | 143                     | 80                                              | 0,08                         |
| 3-Month SONIA Index June Futures                               | Long  | 09.2026     | 36                      | 12                                              | 0,01                         |
| Australia Government 3-Year Note September Futures             | Long  | 09.2025     | 132                     | 5                                               | 0,00                         |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures            | Long  | 09.2025     | 29                      | (10)                                            | (0,01)                       |
| BIST 30 Index August Futures                                   | Short | 08.2025     | 524                     | (105)                                           | (0,10)                       |
| CAC 40 Index July Futures                                      | Long  | 07.2025     | 3                       | (2)                                             | 0,00                         |
| DAX Index September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 1                       | 10                                              | 0,01                         |
| E-Mini Russell 2000 Index September Futures                    | Long  | 09.2025     | 1                       | 2                                               | 0,00                         |
| E-Mini S&P 100 Index September Futures                         | Long  | 09.2025     | 4                       | 61                                              | 0,06                         |
| E-mini S&P 500 Index September Futures                         | Long  | 09.2025     | 1                       | 5                                               | 0,00                         |
| Euro STOXX 50 September Futures                                | Long  | 09.2025     | 112                     | (4)                                             | 0,00                         |
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 45                      | 16                                              | 0,02                         |
| Euro-Oat September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 4                       | (5)                                             | 0,00                         |
| FTSE 100 Index September Futures                               | Long  | 09.2025     | 10                      | 1                                               | 0,00                         |
| FTSE China Index July Futures                                  | Long  | 07.2025     | 92                      | 12                                              | 0,01                         |
| FTSE Taiwan Index July Futures                                 | Long  | 07.2025     | 5                       | 1                                               | 0,00                         |
| FTSE/JSE TOP 40 Index September Futures                        | Long  | 09.2025     | 31                      | 24                                              | 0,02                         |
| FTSE/MIB Index September Futures                               | Long  | 09.2025     | 2                       | 5                                               | 0,01                         |
| Hang Seng China Enterprises Index July Futures                 | Long  | 07.2025     | 27                      | 33                                              | 0,03                         |
| IBEX 35 Index July Futures                                     | Long  | 07.2025     | 8                       | 0                                               | 0,00                         |
| IFSC Nifty 50 Index July Futures                               | Long  | 07.2025     | 29                      | 29                                              | 0,03                         |
| MSCI Singapore Index July Futures                              | Long  | 07.2025     | 33                      | 27                                              | 0,03                         |
| Nikkei 225 Index September Futures                             | Long  | 09.2025     | 7                       | 57                                              | 0,06                         |
| S&P 60 Index September Futures                                 | Long  | 09.2025     | 5                       | 15                                              | 0,01                         |
| Short Euro-BTP Italy Government Bond September Futures         | Long  | 09.2025     | 17                      | (5)                                             | 0,00                         |
| SPI 200 Index September Futures                                | Long  | 09.2025     | 15                      | (2)                                             | 0,00                         |
| Topix Index September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 4                       | 20                                              | 0,02                         |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025     | 133                     | (112)                                           | (0,11)                       |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 270                     | 365                                             | 0,35                         |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025     | 3                       | (7)                                             | (0,01)                       |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025     | 15                      | (62)                                            | (0,06)                       |
| Volatility S&P 500 Index July Futures                          | Short | 07.2025     | 21                      | 14                                              | 0,01                         |
| VSTOXX Mini July Futures                                       | Long  | 07.2025     | 10                      | (1)                                             | 0,00                         |
| WIG20 Index September Futures                                  | Long  | 09.2025     | 56                      | 43                                              | 0,04                         |
|                                                                |       |             |                         | \$ 521                                          | 0,51                         |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                         | \$ 521                                          | 0,51                         |

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu bezahlender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.EM-41 5-Year Index | (1,000) %                      | 20.06.2029            | \$ 4.200                       | \$ (82)                                         | (0,08)                       |
| CDX.HY-43 5-Year Index | (5,000)                        | 20.12.2029            | 5.400                          | (55)                                            | (0,06)                       |
| CDX.IG-43 5-Year Index | (1,000)                        | 20.12.2029            | 14.300                         | (54)                                            | (0,05)                       |
|                        |                                |                       |                                | \$ (191)                                        | (0,19)                       |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Index/Tranchen                     | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| CDX.EM-40 5-Year Index             | 1,000 %                     | 20.12.2028       | \$ 9.000                  | \$ 217                                   | 0,21                 |
| CDX.EM-43 5-Year Index             | 1,000                       | 20.06.2030       | 2.200                     | 2                                        | 0,00                 |
| CDX.HY-44 5-Year Index             | 5,000                       | 20.06.2030       | 8.300                     | 208                                      | 0,20                 |
| CDX.IG-44 5-Year Index             | 1,000                       | 20.06.2030       | 31.200                    | 110                                      | 0,11                 |
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index   | 5,000                       | 20.06.2030       | € 1.500                   | 11                                       | 0,01                 |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2030       | 7.200                     | 14                                       | 0,02                 |
|                                    |                             |                  |                           | \$ 562                                   | 0,55                 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Varibler Zinssatzindex              | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag    | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------------------|-----------------|------------------|---------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %         | 19.03.2030       | £ 3.300       | \$ 45                                    | 0,04                 |
| Erhalt                                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 18.09.2034       | 1.800         | 119                                      | 0,12                 |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750           | 18.09.2054       | 1.200         | (249)                                    | (0,24)               |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 4,000           | 17.09.2027       | 4.100         | (24)                                     | (0,02)               |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 4,000           | 17.09.2035       | 12.600        | 86                                       | 0,08                 |
| Zahlung                                     | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 4,250           | 18.09.2026       | 8.000         | (76)                                     | (0,07)               |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 4,250           | 17.09.2055       | 6.500         | 28                                       | 0,03                 |
| Zahlung                                     | 1-Day ILS-SHIR Compounded-OIS       | 3,920           | 21.04.2030       | ILS 21.400    | 22                                       | 0,02                 |
| Erhalt                                      | 1-Day ILS-SHIR Compounded-OIS       | 4,170           | 23.05.2030       | 17.300        | (74)                                     | (0,07)               |
| Erhalt                                      | 1-Day ILS-SHIR Compounded-OIS       | 4,491           | 21.07.2025       | 21.400        | 71                                       | 0,07                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS      | 6,000           | 17.09.2030       | INR 881.657   | 88                                       | 0,08                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 1,000           | 17.09.2035       | ¥ 230.000     | (4)                                      | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS   | 2,000           | 17.09.2055       | 282.400       | 11                                       | 0,01                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS   | 2,500           | 17.09.2030       | SGD 19.700    | 455                                      | 0,44                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day THB-THOR Compounded-OIS       | 2,000           | 17.09.2030       | THB 367.000   | 256                                      | 0,25                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500           | 17.09.2055       | \$ 9.500      | 106                                      | 0,10                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,620           | 30.11.2029       | 20.900        | (178)                                    | (0,17)               |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 17.09.2027       | 18.100        | (86)                                     | (0,08)               |
| Erhalt                                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 18.12.2029       | 7.600         | (57)                                     | (0,06)               |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 17.09.2030       | 1.300         | 2                                        | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750           | 17.09.2035       | 21.000        | 180                                      | 0,17                 |
| Zahlung                                     | 1-Year BRL-CDI                      | 13,290          | 02.01.2031       | BRL 27.200    | 36                                       | 0,03                 |
| Erhalt                                      | 1-Year BRL-CDI                      | 14,055          | 02.01.2031       | 9.400         | (24)                                     | (0,02)               |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,750           | 15.09.2027       | CAD 13.000    | (9)                                      | (0,01)               |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,750           | 15.09.2030       | 4.800         | (24)                                     | (0,02)               |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 15.09.2035       | 8.400         | (44)                                     | (0,04)               |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,000           | 15.09.2055       | 8.200         | 181                                      | 0,18                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month CNY-CNREPOFIX               | 1,500           | 17.09.2030       | CNY 61.200    | (46)                                     | (0,05)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,090           | 15.08.2029       | COP 6.691.500 | (87)                                     | (0,08)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,175           | 22.08.2029       | 11.895.700    | (137)                                    | (0,13)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,220           | 14.08.2029       | 8.906.900     | (106)                                    | (0,10)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,275           | 13.08.2029       | 6.328.500     | (72)                                     | (0,07)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,335           | 09.08.2029       | 9.161.400     | (100)                                    | (0,10)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,340           | 09.08.2029       | 4.580.700     | (50)                                     | (0,05)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,360           | 09.08.2029       | 13.879.500    | (148)                                    | (0,14)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,370           | 08.08.2029       | 14.016.900    | (148)                                    | (0,14)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,400           | 09.08.2029       | 9.220.900     | (95)                                     | (0,09)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,436           | 12.08.2029       | 8.438.000     | (84)                                     | (0,08)               |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,520           | 01.03.2029       | 9.821.800     | 77                                       | 0,07                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,546           | 17.10.2029       | 8.265.800     | 81                                       | 0,08                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,595           | 18.10.2029       | 4.142.900     | 38                                       | 0,04                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,650           | 18.10.2029       | 4.182.700     | 37                                       | 0,04                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,746           | 21.10.2029       | 7.461.700     | 59                                       | 0,06                 |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,800           | 18.12.2029       | 9.802.400     | (7)                                      | (0,01)               |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,805           | 22.10.2029       | 5.596.300     | 41                                       | 0,04                 |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,914           | 24.05.2029       | 18.670.700    | (98)                                     | (0,10)               |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,927           | 09.04.2029       | 6.812.500     | 36                                       | 0,03                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 7,930           | 23.10.2029       | 7.668.500     | 48                                       | 0,05                 |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,035           | 28.05.2029       | 9.474.600     | (41)                                     | (0,04)               |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,047           | 24.10.2029       | 21.407.200    | 110                                      | 0,11                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,105           | 25.10.2029       | 9.372.400     | 43                                       | 0,04                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,105           | 28.10.2029       | 22.145.900    | 102                                      | 0,10                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,150           | 11.04.2029       | 1.963.400     | 7                                        | 0,01                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,180           | 01.11.2029       | 9.008.200     | 35                                       | 0,03                 |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,225           | 18.06.2030       | 11.645.600    | (24)                                     | (0,02)               |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,240           | 05.11.2029       | 8.967.000     | 30                                       | 0,03                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,250           | 30.10.2029       | 8.173.000     | 27                                       | 0,03                 |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,310           | 19.03.2030       | 7.574.800     | (24)                                     | (0,02)               |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,320           | 19.03.2030       | 18.606.300    | (42)                                     | (0,04)               |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,435           | 12.04.2029       | 25.396.600    | 41                                       | 0,04                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,449           | 16.04.2029       | 14.674.600    | 13                                       | 0,01                 |
| Zahlung                                     | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,470           | 19.03.2030       | 6.500.000     | (11)                                     | (0,01)               |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,567           | 15.04.2029       | 12.991.700    | (2)                                      | 0,00                 |
| Erhalt                                      | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS      | 8,771           | 18.04.2029       | 15.441.900    | (29)                                     | (0,03)               |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month HKD-HIBOR                   | 3,500           | 17.09.2030       | HKD 49.800    | 137                                      | 0,13                 |
| Zahlung                                     | 3-Month ILS-TELBOR                  | 0,000           | 21.07.2025       | ILS 21.400    | (71)                                     | (0,07)               |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag     | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|---------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month KRW-KORIBOR     | 2,500 %            | 17.09.2030            | KRW 10.368.914 | \$ (30)                                         | (0,03)                       |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 3-Month TWD-TAIBOR      | 1,750              | 17.09.2030            | TWD 169.900    | 16                                              | 0,01                         |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 7,560              | 23.08.2029            | ZAR 101.500    | (109)                                           | (0,11)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 7,775              | 18.03.2030            | 90.600         | (73)                                            | (0,07)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,130              | 25.01.2029            | 308.000        | (665)                                           | (0,64)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,205              | 31.08.2028            | 89.600         | (281)                                           | (0,27)                       |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,220              | 30.08.2028            | 109.400        | 213                                             | 0,21                         |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,220              | 31.08.2028            | 30.900         | (100)                                           | (0,10)                       |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,250              | 22.11.2028            | 127.300        | 161                                             | 0,16                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,276              | 14.06.2029            | 119.000        | 267                                             | 0,26                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,330              | 27.07.2028            | 54.000         | 114                                             | 0,11                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,352              | 09.11.2028            | 248.400        | 494                                             | 0,48                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,355              | 03.11.2028            | 113.400        | 265                                             | 0,26                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,360              | 06.11.2028            | 104.400        | 237                                             | 0,23                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,459              | 22.05.2029            | 172.100        | 450                                             | 0,44                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,510              | 17.05.2029            | 251.400        | 675                                             | 0,65                         |
| Zahlung                                     | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,530              | 16.05.2029            | 67.200         | 185                                             | 0,18                         |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,645              | 02.04.2029            | 104.100        | (314)                                           | (0,31)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,649              | 03.04.2029            | 74.900         | (227)                                           | (0,22)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,650              | 02.04.2029            | 52.500         | (159)                                           | (0,15)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,670              | 02.04.2029            | 104.500        | (321)                                           | (0,31)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,820              | 12.04.2029            | 21.600         | (20)                                            | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 8,880              | 11.04.2029            | 93.300         | (324)                                           | (0,32)                       |
| Erhalt                                      | 3-Month ZAR-JIBAR       | 9,090              | 28.09.2028            | 64.300         | (188)                                           | (0,18)                       |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 6-Month AUD-BBR-BBSW    | 3,500              | 17.09.2027            | AUD 600        | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month AUD-BBR-BBSW    | 4,500              | 17.09.2035            | 100            | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,650              | 18.06.2030            | CLP 18.007.800 | (9)                                             | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,800              | 18.06.2030            | 1.287.600      | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 4,860              | 18.06.2030            | 3.929.000      | (38)                                            | (0,04)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month CLP-CHILIBOR    | 5,010              | 05.11.2029            | 7.243.200      | (127)                                           | (0,12)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,340              | 06.01.2032            | CZK 171.700    | (542)                                           | (0,53)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,365              | 28.11.2029            | 1.900          | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,470              | 05.02.2030            | 185.500        | (65)                                            | (0,06)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,489              | 30.10.2029            | 144.200        | (95)                                            | (0,09)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,545              | 16.07.2034            | 40.300         | (8)                                             | (0,01)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 3,550              | 07.03.2030            | 94.500         | 9                                               | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,020              | 22.11.2033            | 15.400         | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,060              | 17.04.2034            | 98.400         | (91)                                            | (0,09)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,195              | 21.03.2033            | 125.300        | 180                                             | 0,17                         |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,220              | 21.03.2033            | 67.600         | 104                                             | 0,10                         |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,280              | 08.11.2033            | 124.900        | 288                                             | 0,28                         |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,290              | 18.04.2034            | 11.500         | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,420              | 05.05.2032            | 9.700          | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,420              | 01.06.2033            | 82.200         | (159)                                           | (0,15)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,455              | 01.06.2033            | 29.100         | (66)                                            | (0,06)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month CZK-PRIBOR      | 4,638              | 03.10.2033            | 100.400        | (347)                                           | (0,34)                       |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,000              | 17.09.2027            | € 4.500        | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                      | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250              | 17.09.2035            | 10.200         | (60)                                            | (0,06)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,250              | 17.09.2055            | 6.400          | 225                                             | 0,22                         |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 5,300              | 07.08.2029            | HUF 76.400     | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,340              | 08.08.2029            | 753.000        | (6)                                             | (0,01)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,545              | 02.08.2029            | 1.650.200      | 29                                              | 0,03                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,700              | 18.07.2029            | 966.000        | 37                                              | 0,04                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,722              | 18.07.2029            | 651.300        | 27                                              | 0,03                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,790              | 17.07.2029            | 500.300        | 24                                              | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,820              | 22.07.2029            | 951.900        | 50                                              | 0,05                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,825              | 17.07.2029            | 965.100        | 51                                              | 0,05                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,842              | 22.07.2029            | 2.130.000      | 118                                             | 0,11                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,850              | 22.07.2029            | 298.100        | 17                                              | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,850              | 06.05.2030            | 1.044.100      | (36)                                            | (0,04)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,970              | 25.04.2030            | 129.100        | (3)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 5,975              | 25.04.2030            | 2.057.800      | (39)                                            | (0,04)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,025              | 29.04.2030            | 1.739.300      | (22)                                            | (0,02)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,063              | 24.04.2030            | 516.300        | (4)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,079              | 22.10.2029            | 3.208.400      | (396)                                           | (0,38)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,080              | 24.04.2030            | 2.052.000      | (17)                                            | (0,02)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,090              | 21.10.2029            | 1.057.900      | (93)                                            | (0,09)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,118              | 22.10.2029            | 1.410.500      | (129)                                           | (0,13)                       |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,250              | 21.05.2029            | 1.059.800      | 20                                              | 0,02                         |
| Zahlung                                     | 6-Month HUF-BBR         | 6,270              | 22.05.2029            | 2.999.400      | 16                                              | 0,02                         |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,310              | 24.10.2029            | 800.000        | (93)                                            | (0,09)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,550              | 25.10.2029            | 2.405.400      | (388)                                           | (0,38)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,560              | 08.04.2029            | 1.585.600      | (78)                                            | (0,08)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,650              | 13.03.2030            | 2.693.400      | (57)                                            | (0,06)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,800              | 16.04.2029            | 1.019.800      | (76)                                            | (0,07)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 6,830              | 17.04.2029            | 1.006.600      | (78)                                            | (0,08)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 7,000              | 22.04.2029            | 4.689.600      | (170)                                           | (0,17)                       |
| Erhalt                                      | 6-Month HUF-BBR         | 7,100              | 19.04.2029            | 969.200        | (102)                                           | (0,10)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                       | 6-Month PLN-WIBOR       | 3,952              | 29.07.2030            | PLN 10.908     | 10                                              | 0,01                         |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,270              | 08.08.2029            | 20.300         | 102                                             | 0,10                         |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,283              | 08.08.2029            | 20.300         | 105                                             | 0,10                         |
| Zahlung                                     | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,495              | 12.08.2029            | 17.000         | 183                                             | 0,18                         |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nennbetrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,495 %            | 22.11.2029            | PLN 20.900 | \$ (193)                                        | (0,19)                       |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,513              | 25.11.2029            | 22.600     | 217                                             | 0,21                         |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,670              | 31.03.2030            | 17.200     | 72                                              | 0,07                         |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,692              | 31.03.2030            | 3.400      | 15                                              | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,695              | 28.03.2030            | 31.600     | 142                                             | 0,14                         |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,715              | 10.10.2029            | 9.300      | (107)                                           | (0,10)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,770              | 17.10.2029            | 20.500     | (318)                                           | (0,31)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month PLN-WIBOR       | 4,904              | 20.12.2029            | 31.200     | (468)                                           | (0,45)                       |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 7,775              | 12.06.2030            | MXN 83.100 | 4                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 8,090              | 12.06.2030            | 16.700     | (5)                                             | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,500              | 13.03.2030            | 131.600    | 234                                             | 0,23                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,700              | 07.03.2035            | 92.600     | 216                                             | 0,21                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 8,733              | 12.12.2029            | 45.200     | 100                                             | 0,10                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 9,050              | 12.12.2029            | 81.200     | 110                                             | 0,11                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 9,100              | 06.12.2034            | 58.800     | 117                                             | 0,11                         |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,385              | 26.12.2025            | 61.900     | (21)                                            | (0,02)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 28-Day MXN-TIIE         | 9,385              | 06.07.2029            | 61.900     | (119)                                           | (0,12)                       |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE         | 9,415              | 25.12.2025            | 23.300     | 8                                               | 0,01                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,415              | 25.10.2029            | 23.300     | 49                                              | 0,05                         |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,430              | 16.12.2025            | 45.400     | (16)                                            | (0,02)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 28-Day MXN-TIIE         | 9,430              | 16.10.2029            | 45.400     | (127)                                           | (0,12)                       |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE         | 9,480              | 16.12.2025            | 105.900    | (38)                                            | (0,04)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 28-Day MXN-TIIE         | 9,480              | 10.10.2034            | 105.900    | (377)                                           | (0,37)                       |
| Zahlung                                        | CPURNSA                 | 2,500              | 29.03.2033            | \$ 6.900   | (44)                                            | (0,04)                       |
| Erhalt                                         | CPURNSA                 | 2,525              | 07.06.2033            | 1.700      | (5)                                             | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | CPURNSA                 | 2,595              | 12.07.2033            | 5.200      | (24)                                            | (0,02)                       |
|                                                |                         |                    |                       |            | \$ (1.733)                                      | (1,68)                       |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                    |                       |            | \$ (1.362)                                      | (1,32)                       |

<sup>(1)</sup> Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

<sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

##### ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Variabler<br>Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------------|----------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BPS        | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month MYR-KLIBOR         | 3,500 %            | 17.09.2030            | MYR 53.440      | \$ 12                                    | \$ 171                                          | \$ 183         | 0,18                         |
| SCX        | Erhalt <sup>(1)</sup>                       | 3-Month MYR-KLIBOR         | 3,500              | 17.09.2030            | 30.100          | (51)                                     | (51)                                            | (102)          | (0,10)                       |
|            | Zahlung <sup>(1)</sup>                      | 3-Month MYR-KLIBOR         | 3,500              | 17.09.2030            | 19.462          | 18                                       | 48                                              | 66             | 0,06                         |
|            |                                             |                            |                    |                       |                 | \$ (21)                                  | \$ 168                                          | \$ 147         | 0,14                         |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

##### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/<br>Erhalt | Wertpapier   | Anzahl der<br>Anteile oder<br>Einheiten | Variabler<br>Zinssatz | Nenn-<br>betrag | Fälligkeits-<br>datum | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|--------------------|--------------|-----------------------------------------|-----------------------|-----------------|-----------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| MEI        | Erhalt             | KOSPI2 Index | 6.750.000                               | 0,000 %               | KRW 2.634.489   | 11.09.2025            | \$ 0                                     | \$ 129                                          | \$ 129         | 0,12                         |
|            | Zahlung            | SET 50 Index | 48.600                                  | 0,000                 | THB 33.807      | 29.09.2025            | 0                                        | (11)                                            | (11)           | (0,01)                       |
|            |                    |              |                                         |                       |                 |                       | \$ 0                                     | \$ 118                                          | \$ 118         | 0,11                         |

##### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD 2.545              | \$ 1.653                 | \$ 0                             | \$ (15)                            | \$ (15)                                              | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | CAD 2.949              | 2.162                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CHF 3.050              | 3.819                    | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | CNH 9.942              | 1.380                    | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | (0,01)                       |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |        |        |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|--------|--------|
| BOA        | 07.2025               | €                      | 2.340                    | \$                               | 2.740                              | \$ 0                                                 | (7)                          | (0,01) |        |
|            | 07.2025               | £                      | 1.386                    |                                  | 1.902                              | 3                                                    | 3                            | 0,00   |        |
|            | 07.2025               | NZD                    | 3.093                    |                                  | 1.862                              | 0                                                    | (16)                         | (0,02) |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 6.872                    | AUD                              | 10.578                             | 61                                                   | 0                            | 0,06   |        |
|            | 08.2025               | AUD                    | 10.578                   | \$                               | 6.876                              | 0                                                    | (61)                         | (0,06) |        |
|            | 08.2025               | CNH                    | 10.182                   |                                  | 1.412                              | 0                                                    | (15)                         | (0,01) |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 1.654                    | AUD                              | 2.545                              | 15                                                   | 0                            | 0,01   |        |
|            | 08.2025               |                        | 2.162                    | CAD                              | 2.944                              | 0                                                    | (1)                          | 0,00   |        |
|            | 08.2025               |                        | 3.819                    | CHF                              | 3.037                              | 13                                                   | 0                            | 0,01   |        |
|            | 08.2025               |                        | 61                       | CNH                              | 438                                | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
|            | 08.2025               |                        | 2.746                    | €                                | 2.340                              | 7                                                    | 0                            | 0,01   |        |
|            | 08.2025               |                        | 1.902                    | £                                | 1.386                              | 0                                                    | (3)                          | 0,00   |        |
|            | 08.2025               |                        | 1.864                    | NZD                              | 3.093                              | 16                                                   | 0                            | 0,02   |        |
|            | 07.2025               | €                      | 2.217                    | \$                               | 2.521                              | 0                                                    | (82)                         | (0,08) |        |
|            | 07.2025               | ILS                    | 185                      |                                  | 53                                 | 0                                                    | (2)                          | 0,00   |        |
|            | 07.2025               | PHP                    | 94.221                   |                                  | 1.676                              | 6                                                    | 0                            | 0,01   |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.580                    | €                                | 1.390                              | 51                                                   | 0                            | 0,05   |        |
|            | 07.2025               |                        | 33                       | HKD                              | 256                                | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
|            | 07.2025               |                        | 100                      | PLN                              | 366                                | 1                                                    | 0                            | 0,00   |        |
|            | 07.2025               |                        | 1.577                    | SGD                              | 2.033                              | 19                                                   | 0                            | 0,02   |        |
|            | 08.2025               | TWD                    | 205                      | \$                               | 6                                  | 0                                                    | (1)                          | 0,00   |        |
|            | 08.2025               | \$                     | 3.075                    | CZK                              | 65.884                             | 58                                                   | 0                            | 58     | 0,06   |
|            | 08.2025               |                        | 2.515                    | HUF                              | 907.947                            | 144                                                  | 0                            | 144    | 0,14   |
|            | 09.2025               |                        | 2.418                    | CLP                              | 2.293.474                          | 39                                                   | 0                            | 39     | 0,04   |
| BPS        | 07.2025               | IDR                    | 35.267.111               | \$                               | 2.172                              | 2                                                    | (2)                          | 0,00   |        |
|            | 07.2025               | TRY                    | 1.326                    |                                  | 33                                 | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
|            | 07.2025               | TWD                    | 30.008                   |                                  | 923                                | 0                                                    | (110)                        | (0,11) |        |
|            | 07.2025               | \$                     | 15                       | €                                | 13                                 | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
|            | 07.2025               |                        | 156                      | KRW                              | 211.989                            | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
|            | 07.2025               |                        | 4.823                    | PHP                              | 268.874                            | 0                                                    | (58)                         | (0,06) |        |
|            | 07.2025               |                        | 537                      | PLN                              | 2.011                              | 19                                                   | 0                            | 19     | 0,02   |
|            | 07.2025               |                        | 5.259                    | THB                              | 173.806                            | 93                                                   | 0                            | 93     | 0,09   |
|            | 07.2025               |                        | 15                       | TRY                              | 608                                | 0                                                    | 0                            | 0      | 0,00   |
|            | 07.2025               |                        | 12.328                   | TWD                              | 359.066                            | 0                                                    | (30)                         | (30)   | (0,03) |
|            | 08.2025               | CZK                    | 997                      | \$                               | 45                                 | 0                                                    | (2)                          | (2)    | 0,00   |
|            | 08.2025               | HUF                    | 800.141                  |                                  | 2.287                              | 0                                                    | (56)                         | (56)   | (0,06) |
|            | 08.2025               | TRY                    | 1.401                    |                                  | 34                                 | 0                                                    | 0                            | 0      | 0,00   |
|            | 08.2025               | TWD                    | 21.906                   |                                  | 674                                | 0                                                    | (87)                         | (87)   | (0,09) |
|            | 09.2025               | INR                    | 677.878                  |                                  | 7.800                              | 0                                                    | (75)                         | (75)   | (0,07) |
|            | 09.2025               | \$                     | 1.021                    | €                                | 875                                | 11                                                   | 0                            | 11     | 0,01   |
|            | 09.2025               |                        | 700                      | PLN                              | 2.566                              | 9                                                    | 0                            | 9      | 0,01   |
|            | 10.2025               | BRL                    | 2.800                    | \$                               | 457                                | 0                                                    | (44)                         | (44)   | (0,04) |
|            | 07.2025               | IDR                    | 107.745                  |                                  | 7                                  | 0                                                    | 0                            | 0      | 0,00   |
|            | 07.2025               | ILS                    | 179                      |                                  | 53                                 | 0                                                    | (1)                          | (1)    | 0,00   |
|            | 07.2025               | NZD                    | 4.761                    |                                  | 2.868                              | 0                                                    | (22)                         | (22)   | (0,02) |
|            | 07.2025               | RON                    | 69                       |                                  | 16                                 | 0                                                    | 0                            | 0      | 0,00   |
|            | 07.2025               | TRY                    | 3.098                    |                                  | 76                                 | 0                                                    | (1)                          | (1)    | 0,00   |
|            | 07.2025               | \$                     | 27                       | CAD                              | 37                                 | 0                                                    | 0                            | 0      | 0,00   |
| 07.2025    |                       | 5.412                  | £                        | 3.984                            | 47                                 | 0                                                    | 47                           | 0,05   |        |
| 07.2025    |                       | 3.300                  | HKD                      | 25.818                           | 0                                  | (6)                                                  | (6)                          | (0,01) |        |
| 07.2025    |                       | 118                    | ILS                      | 423                              | 8                                  | 0                                                    | 8                            | 0,01   |        |
| 07.2025    |                       | 532                    | ¥                        | 76.519                           | 0                                  | (2)                                                  | (2)                          | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 16                     | KRW                      | 22.427                           | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 4.855                  | NZD                      | 8.000                            | 1                                  | 0                                                    | 1                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 58                     | SGD                      | 74                               | 1                                  | 0                                                    | 1                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 378                    | TRY                      | 15.332                           | 6                                  | 0                                                    | 6                            | 0,01   |        |
| 07.2025    |                       | 71                     | TWD                      | 2.089                            | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 48                     | ZAR                      | 858                              | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 08.2025    | £                     | 2.483                  | \$                       | 3.379                            | 0                                  | (24)                                                 | (24)                         | (0,02) |        |
| 08.2025    | INR                   | 319                    |                          | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 08.2025    | \$                    | 53                     | TRY                      | 2.194                            | 1                                  | 0                                                    | 1                            | 0,00   |        |
| 09.2025    |                       | 1.600                  | CHF                      | 1.266                            | 6                                  | 0                                                    | 6                            | 0,01   |        |
| 09.2025    |                       | 1.608                  | £                        | 1.188                            | 20                                 | 0                                                    | 20                           | 0,02   |        |
| 09.2025    |                       | 400                    | HUF                      | 140.391                          | 11                                 | 0                                                    | 11                           | 0,01   |        |
| 09.2025    |                       | 1.992                  | NZD                      | 3.300                            | 17                                 | 0                                                    | 17                           | 0,02   |        |
| 09.2025    |                       | 7                      | PEN                      | 25                               | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 07.2025    | AUD                   | 2.467                  | \$                       | 1.585                            | 0                                  | (32)                                                 | (32)                         | (0,03) |        |
| 07.2025    | \$                    | 9                      | BRL                      | 52                               | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 08.2025    | BRL                   | 52                     | \$                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 09.2025    | \$                    | 5.061                  | PEN                      | 18.539                           | 152                                | 0                                                    | 152                          | 0,15   |        |
| 07.2025    | NOK                   | 11.140                 | \$                       | 1.126                            | 25                                 | 0                                                    | 25                           | 0,02   |        |
| 07.2025    | TWD                   | 7.558                  |                          | 232                              | 0                                  | (28)                                                 | (28)                         | (0,03) |        |
| 07.2025    | \$                    | 760                    | AUD                      | 1.171                            | 8                                  | 0                                                    | 8                            | 0,01   |        |
| 07.2025    |                       | 1.187                  | BRL                      | 6.689                            | 39                                 | 0                                                    | 39                           | 0,04   |        |
| 07.2025    |                       | 186                    | CAD                      | 255                              | 1                                  | 0                                                    | 1                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 23                     | €                        | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 6.505                  | £                        | 4.824                            | 105                                | 0                                                    | 105                          | 0,10   |        |
| 07.2025    |                       | 2.074                  | KRW                      | 2.842.429                        | 28                                 | 0                                                    | 28                           | 0,03   |        |
| 07.2025    |                       | 5.444                  | NOK                      | 54.965                           | 0                                  | (13)                                                 | (13)                         | (0,01) |        |
| 07.2025    |                       | 7                      | PLN                      | 27                               | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 3.996                  | SEK                      | 37.935                           | 0                                  | (16)                                                 | (16)                         | (0,02) |        |
| 07.2025    |                       | 54                     | SGD                      | 69                               | 0                                  | 0                                                    | 0                            | 0,00   |        |
| 07.2025    |                       | 2.711                  | THB                      | 89.895                           | 57                                 | 0                                                    | 57                           | 0,06   |        |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| CIB<br>DUB | 08.2025               | CNH                    | 3.242                    | \$ 451                           | \$ 0                               | \$ (3)                                               | 0,00                      |
|            | 08.2025               | THB                    | 105.005                  | 3.247                            | 5                                  | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 08.2025               | TWD                    | 7.463                    | 229                              | 0                                  | (31)                                                 | (0,03)                    |
|            | 09.2025               | PEN                    | 3.692                    | 998                              | 0                                  | (40)                                                 | (0,04)                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 800                      | COP 3.296.800                    | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 12.2025               | PEN                    | 1.750                    | \$ 473                           | 0                                  | (18)                                                 | (0,02)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 10                       | HUF 3.337                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | AUD                    | 669                      | \$ 431                           | 0                                  | (8)                                                  | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.572                    | € 2.217                          | 30                                 | 0                                                    | 0,03                      |
|            | 07.2025               |                        | 212                      | SGD 273                          | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | €                      | 2.212                    | \$ 2.572                         | 0                                  | (30)                                                 | (0,03)                    |
|            | 08.2025               | THB                    | 39.373                   | 1.212                            | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
| FAR        | 08.2025               | \$                     | 1.099                    | CNH 7.854                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 1.517                    | INR 131.464                      | 12                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 09.2025               | MXN                    | 2.541                    | \$ 132                           | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 09.2025               | \$                     | 6.414                    | COP 26.478.889                   | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | AUD                    | 11.749                   | \$ 7.580                         | 0                                  | (119)                                                | (0,12)                    |
|            | 07.2025               | BRL                    | 20.063                   | 3.632                            | 0                                  | (44)                                                 | (0,04)                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 5.179                    | 721                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.356                    | BRL 13.364                       | 93                                 | 0                                                    | 0,09                      |
|            | 07.2025               |                        | 7                        | PHP 388                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               |                        | 3.632                    | BRL 20.369                       | 44                                 | 0                                                    | 0,04                      |
|            | 09.2025               |                        | 1.980                    | MXN 38.545                       | 44                                 | 0                                                    | 0,04                      |
|            | 09.2025               |                        | 900                      | THB 29.139                       | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| GLM        | 11.2025               | PEN                    | 211                      | \$ 57                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | RON                    | 63                       | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.060                    | IDR 17.279.218                   | 4                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 2.571                    | MYR 10.883                       | 16                                 | 0                                                    | 0,02                      |
|            | 07.2025               |                        | 2.907                    | ZAR 52.569                       | 47                                 | 0                                                    | 0,04                      |
|            | 08.2025               |                        | 21                       | HUF 7.325                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               |                        | 500                      | BRL 2.800                        | 3                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               |                        | 400                      | CZK 8.437                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SEK                    | 35.525                   | \$ 3.755                         | 28                                 | 0                                                    | 0,03                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 3.755                    | SEK 35.449                       | 0                                  | (28)                                                 | (0,03)                    |
|            | 07.2025               | AUD                    | 152                      | \$ 100                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | BRL                    | 42                       | 7                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| IND        | 07.2025               | CNH                    | 9.812                    | 1.360                            | 0                                  | (12)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 1.487.048                | 1.086                            | 0                                  | (14)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | SEK                    | 2.455                    | 259                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 395.534                  | 13.480                           | 53                                 | (126)                                                | (0,07)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 3.708                    | AUD 5.680                        | 14                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               |                        | 22                       | CAD 30                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 5.742                    | CHF 4.659                        | 111                                | 0                                                    | 0,11                      |
|            | 07.2025               |                        | 5.280                    | ILS 19.064                       | 383                                | 0                                                    | 0,37                      |
|            | 07.2025               |                        | 1.501                    | KRW 2.035.534                    | 4                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 12.430                   | TWD 359.228                      | 0                                  | (64)                                                 | (0,06)                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 9.291                    | \$ 1.288                         | 0                                  | (14)                                                 | (0,01)                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 95.152                   | 1.108                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| JPM        | 08.2025               | TWD                    | 141.338                  | 4.310                            | 0                                  | (604)                                                | (0,59)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 100                      | AUD 152                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 6.064                    | CNH 43.378                       | 14                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 08.2025               |                        | 4.074                    | INR 351.426                      | 14                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 09.2025               | PHP                    | 68.824                   | \$ 1.200                         | 0                                  | (18)                                                 | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | CAD                    | 851                      | 622                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CHF                    | 71                       | 87                               | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CNH                    | 4.704                    | 653                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | HKD                    | 27.549                   | 3.520                            | 5                                  | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               | NZD                    | 146                      | 87                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 422                      | 113                              | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    | 30.876                   | 947                              | 0                                  | (116)                                                | (0,11)                    |
| MBC        | 07.2025               | \$                     | 99                       | AUD 152                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 7.522                    | CAD 10.197                       | 0                                  | (49)                                                 | (0,05)                    |
|            | 07.2025               |                        | 61                       | € 53                             | 2                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 282                      | £ 209                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 102                      | ¥ 14.683                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH                    | 4.717                    | \$ 653                           | 0                                  | (8)                                                  | (0,01)                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 43.582                   | 1.332                            | 0                                  | (184)                                                | (0,18)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 13                       | CAD 17                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 6                        | HUF 2.011                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               | CLP                    | 2.419.141                | \$ 2.578                         | 0                                  | (13)                                                 | (0,01)                    |
|            | 09.2025               | ZAR                    | 7.237                    | 400                              | 0                                  | (5)                                                  | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | CAD                    | 265                      | 194                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MYI        | 07.2025               | ¥                      | 167.034                  | 1.152                            | 1                                  | (5)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | NOK                    | 39.694                   | 3.935                            | 13                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               | PLN                    | 32                       | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | 509                      | 397                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | 1.025                    | € 886                            | 15                                 | 0                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               |                        | 52                       | HKD 411                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 676                      | ¥ 97.700                         | 1                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | 73                       | SGD 94                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CZK                    | 1.718                    | \$ 79                            | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | 7                        | HUF 2.619                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | 1.152                    | ¥ 166.420                        | 4                                  | 0                                                    | 0,00                      |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
|            | 08.2025               | \$ 3.935               | NOK 39.687               | \$ 0                             | \$ (13)                            | \$ (13)                                              | (0,01)                    |
|            | 09.2025               | 700                    | CAD 952                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 10.2025               | BRL 2.400              | \$ 392                   | 0                                | (38)                               | (38)                                                 | (0,04)                    |
| RBC        | 07.2025               | CHF 1.268              | 1.546                    | 0                                | (47)                               | (47)                                                 | (0,05)                    |
| RYL        | 08.2025               | \$ 1.976               | HUF 717.452              | 125                              | 0                                  | 125                                                  | 0,12                      |
| SCX        | 07.2025               | IDR 31.893.551         | \$ 1.957                 | 0                                | (7)                                | (7)                                                  | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | ¥ 18.762               | 130                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | SGD 331                | 257                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 25                  | ¥ 3.600                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 121                    | TWD 3.512                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD 27.116             | \$ 831                   | 0                                | (111)                              | (111)                                                | (0,11)                    |
|            | 08.2025               | \$ 121                 | CNH 862                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 62                     | INR 5.320                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 130                    | ¥ 18.693                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 257                    | SGD 331                  | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                      |
| SOG        | 07.2025               | 7                      | € 6                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 2.416                  | PLN 9.055                | 89                               | 0                                  | 89                                                   | 0,09                      |
|            | 07.2025               | 884                    | SGD 1.139                | 10                               | 0                                  | 10                                                   | 0,01                      |
|            | 08.2025               | 2.706                  | HUF 981.012              | 169                              | 0                                  | 169                                                  | 0,16                      |
| SSB        | 07.2025               | £ 5.456                | \$ 7.438                 | 3                                | (41)                               | (38)                                                 | (0,04)                    |
|            | 07.2025               | \$ 890                 | £ 658                    | 11                               | 0                                  | 11                                                   | 0,01                      |
|            | 08.2025               | 271                    | CAD 370                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | 4.076                  | £ 2.973                  | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
| UAG        | 09.2025               | 500                    | IDR 8.172.795            | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 107                    | ILS 385                  | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,01                      |
|            | 09.2025               | 3.422                  | MXN 66.332               | 61                               | 0                                  | 61                                                   | 0,06                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 2.556                         | \$ (2.680)                         | \$ (124)                                             | (0,12)                    |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 4.309                | \$ 5.045                 | \$ 0                             | \$ (13)                            | \$ (13)                                              | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$ 4.933               | € 4.341                  | 163                              | 0                                  | 163                                                  | 0,16                      |
|            | 08.2025               | 5.057                  | 4.309                    | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,01                      |
| BOA        | 07.2025               | 5.220                  | 4.591                    | 169                              | 0                                  | 169                                                  | 0,16                      |
| BRC        | 07.2025               | € 69                   | \$ 78                    | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 5.408               | € 4.761                  | 180                              | 0                                  | 180                                                  | 0,18                      |
| CBK        | 07.2025               | € 214                  | \$ 246                   | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 103                 | € 89                     | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | € 4.348                | \$ 5.044                 | 0                                | (60)                               | (60)                                                 | (0,06)                    |
|            | 08.2025               | \$ 5.044               | € 4.338                  | 60                               | 0                                  | 60                                                   | 0,06                      |
| MBC        | 07.2025               | € 827                  | \$ 946                   | 0                                | (25)                               | (25)                                                 | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | \$ 123                 | € 105                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 587                           | \$ (105)                           | \$ 482                                               | 0,48                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|---------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD                              | 07.2025               | £ 174               | \$ 238                   | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | \$ 238              | £ 174                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| BRC                              | 07.2025               | £ 182               | \$ 248                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$ 251              | £ 186                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | 248                 | 182                      | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| CBK                              | 07.2025               | £ 5                 | \$ 7                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| MBC                              | 07.2025               | \$ 237              | £ 176                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,01                      |
| SSB                              | 07.2025               | £ 181               | \$ 248                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  | 07.2025               | \$ 244              | £ 180                    | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                      |
|                                  | 08.2025               | 248                 | 181                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|                                  |                       |                     |                          | \$ 13                            | \$ (2)                             | \$ 11                                                | 0,01                      |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                     |                          |                                  |                                    | \$ 634                                               | 0,62                      |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                          |                 |                           |                                   |
| Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>5,000 % fällig am 01.07.2040 | \$ 800          | \$ (806)                  | (0,78)                            |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere                                       |                 | \$ (806)                  | (0,78)                            |
| Summe Anlagen                                                         |                 | \$ 113.936                | 110,55                            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                           |                 | \$ (10.876)               | (10,55)                           |
| Nettovermögen                                                         |                 | \$ 103.060                | 100,00                            |

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(l) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 415 USD (31. Dezember 2024: null USD) und Barmittel in Höhe von 830 USD (31. Dezember 2024: 1.940 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 8.404 USD (31. Dezember 2024: 17.013 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 104.557                                                      | \$ 401                                                       | \$ 104.958 |
| Investmentfonds               | 9.991                                                                       | 0                                                               | 0                                                            | 9.991      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 260                                                                         | (467)                                                           | 0                                                            | (207)      |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (806)                                                           | 0                                                            | (806)      |
| Summen                        | \$ 10.251                                                                   | \$ 103.284                                                      | \$ 401                                                       | \$ 113.936 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert  |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 7.463                                                                    | \$ 167.929                                                      | \$ 0                                                         | \$ 175.392 |
| Investmentfonds               | 2.771                                                                       | 17.434                                                          | 0                                                            | 20.205     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (674)                                                                       | (5.723)                                                         | 0                                                            | (6.397)    |
| Leerverkaufte Wertpapiere     | 0                                                                           | (18.231)                                                        | 0                                                            | (18.231)   |
| Summen                        | \$ 9.560                                                                    | \$ 161.409                                                      | \$ 0                                                         | \$ 170.969 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

## Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für Derivative OTC-Finanzinstrumente

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der Derivative OTC-Finanzinstrumente und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 139                              | \$ 0                                  | \$ 139                              | \$ (75)                             | \$ 0                                  | \$ (75)                             |
| BOA        | 402                                 | (580)                                 | (178)                               | 370                                 | (300)                                 | 70                                  |
| BPS        | (147)                               | 280                                   | 133                                 | (253)                               | 290                                   | 37                                  |
| BRC        | 243                                 | (240)                                 | 3                                   | 395                                 | (220)                                 | 175                                 |
| BSH        | 120                                 | 0                                     | 120                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| CBK        | 116                                 | 0                                     | 116                                 | 1.004                               | (1.040)                               | (36)                                |
| CIB        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 11                                  | 0                                     | 11                                  |
| DUB        | 3                                   | 0                                     | 3                                   | 90                                  | 0                                     | 90                                  |
| FAR        | 15                                  | 0                                     | 15                                  | 279                                 | (260)                                 | 19                                  |
| GLM        | 73                                  | 0                                     | 73                                  | 731                                 | (290)                                 | 441                                 |
| IND        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 231                                 | 0                                     | 231                                 |
| JPM        | (257)                               | 550                                   | 293                                 | 418                                 | (340)                                 | 78                                  |
| MBC        | (401)                               | 273                                   | (128)                               | (439)                               | 260                                   | (179)                               |
| MEI        | 118                                 | 0                                     | 118                                 | 343                                 | (330)                                 | 13                                  |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| MYI        | \$ (26)                             | \$ 0                                  | \$ (26)                             | \$ 12                               | \$ 0                                  | \$ 12                               |
| RBC        | (47)                                | 0                                     | (47)                                | (501)                               | 1.130                                 | 629                                 |
| RYL        | 125                                 | 0                                     | 125                                 | 336                                 | (260)                                 | 76                                  |
| SCX        | (154)                               | 142                                   | (12)                                | 75                                  | (120)                                 | (45)                                |
| SOG        | 268                                 | (260)                                 | 8                                   | (62)                                | 0                                     | (62)                                |
| SSB        | (24)                                | 0                                     | (24)                                | 123                                 | 0                                     | 123                                 |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (190)                               | 260                                   | 70                                  |
| UAG        | 68                                  | 0                                     | 68                                  | 220                                 | (350)                                 | (130)                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 29,67             | 29,50             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 37,05             | 14,16             |
| Investmentfonds                                                        | 6,35              | 5,03              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,53              | 0,10              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 5,83              | 10,08             |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 2,25              | 2,21              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 18,32             | 38,92             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                  | 30. Jun. 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|--------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Unternehmensanleihen und Wechsel                       | 38,72             | 57,60             |
| US-Regierungsbehörden                                  | 37,24             | 3,08              |
| Non-Agency-MBS                                         | 6,10              | 0,46              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                       | 5,56              | 2,23              |
| Staatsemissionen                                       | 1,98              | 1,21              |
| Stammaktien                                            | k. A.             | 3,40              |
| Kurzfristige Instrumente                               | 12,23             | 11,93             |
| Investmentfonds                                        | 9,69              | 9,21              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate    |                   |                   |
| Futures                                                | 0,51              | (0,20)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf    | (0,19)            | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,55              | (0,01)            |
| Zinsswaps                                              | (1,68)            | (4,11)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                             |                   |                   |
| Zinsswaps                                              | 0,14              | (0,01)            |
| Total Return Swaps auf Indizes                         | 0,11              | 0,16              |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere                     | k. A.             | 0,01              |
| Devisenterminkontrakte                                 | (0,12)            | 1,74              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                    | 0,49              | (0,48)            |
| Leerverkaufte Wertpapiere                              | (0,78)            | (8,31)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                            | (10,55)           | 22,10             |
| Nettovermögen                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                      | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                          |                |                          |                                   | DEUTSCHLAND                                          |                |                          |                                   | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.          |                |                          |                                   |
| AUSTRALIEN                                        |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 12.11.2025 €                  |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |                |                          |                                   | Commerzbank AG                                       |                |                          |                                   | 821 £ 699 0,33                                  |                |                          |                                   |
| APA Infrastructure Ltd.                           |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am                                    |                |                          |                                   | Summe Jersey, Kanalinseln                       |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 18.07.2031 £ 400 £ 360 0,17     |                |                          |                                   | 09.10.2025 (d)(f) € 200 £ 173 0,08                   |                |                          |                                   | 3.646 1,73                                      |                |                          |                                   |
| KANADA                                            |                |                          |                                   | Deutsche Bank AG                                     |                |                          |                                   | LUXEMBURG                                       |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |                |                          |                                   | 1,875 % fällig am 22.12.2028 £ 800 748 0,36          |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                |                |                          |                                   |
| Bank of Montreal                                  |                |                          |                                   | Deutsche EuroShop AG                                 |                |                          |                                   | CPI Property Group S.A.                         |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 10.10.2028 300 305 0,15         |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.10.2030 € 100 86 0,04           |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 22.01.2028 £ 500 477 0,23     |                |                          |                                   |
| Royal Bank of Canada                              |                |                          |                                   | DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH |                |                          |                                   | Logicor Financing SARL                          |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 24.01.2028 800 811 0,38         |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 21.08.2030 700 610 0,29            |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 15.01.2030 800 716 0,34       |                |                          |                                   |
| Toronto-Dominion Bank                             |                |                          |                                   | Summe Deutschland                                    |                |                          |                                   | Prologis International Funding S.A.             |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 05.04.2027 400 389 0,18         |                |                          |                                   | 1.617 0,77                                           |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 22.02.2032 200 175 0,08       |                |                          |                                   |
| Summe Kanada                                      |                |                          |                                   | 1.505 0,71                                           |                |                          |                                   | Summe Luxemburg                                 |                |                          |                                   |
| 1.505 0,71                                        |                |                          |                                   | IRLAND                                               |                |                          |                                   | 1.368 0,65                                      |                |                          |                                   |
| KAIMANINSELN                                      |                |                          |                                   | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                     |                |                          |                                   | MEXIKO                                          |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |                |                          |                                   | Arbour CLO DAC                                       |                |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                                |                |                          |                                   |
| Gaci First Investment Co.                         |                |                          |                                   | 3,293 % fällig am 15.11.2037 700 600 0,28            |                |                          |                                   | Mexico Government International Bond            |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 11.06.2029 400 404 0,19         |                |                          |                                   | Ares European CLO DAC                                |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 19.03.2114 400 277 0,13       |                |                          |                                   |
| Yorkshire Power Finance Ltd.                      |                |                          |                                   | 3,266 % fällig am 15.10.2034 1.019 873 0,41          |                |                          |                                   | NIEDERLANDE                                     |                |                          |                                   |
| 7,250 % fällig am 04.08.2028 400 426 0,20         |                |                          |                                   | Hayfin Emerald CLO DAC                               |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                |                |                          |                                   |
| Summe Kaimaninseln                                |                |                          |                                   | 3,337 % fällig am 17.11.2037 1.000 856 0,41          |                |                          |                                   | ABN AMRO Bank NV                                |                |                          |                                   |
| 830 0,39                                          |                |                          |                                   | Indigo Credit Management DAC                         |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| TSchechische REPUBLIK                             |                |                          |                                   | 3,479 % fällig am 15.07.2038 1.000 858 0,41          |                |                          |                                   | 22.09.2025 (d)(f) € 300 258 0,12                |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |                |                          |                                   | Palmer Square European Loan Funding DAC              |                |                          |                                   | Amvest RCF Custodian BV                         |                |                          |                                   |
| Czechoslovak Group A/S                            |                |                          |                                   | 3,113 % fällig am 15.05.2033 243 208 0,10            |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 11.06.2031 200 171 0,08       |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 10.01.2031 (a) € 200 175 0,08   |                |                          |                                   | 3,143 % fällig am 15.05.2034 565 483 0,23            |                |                          |                                   | BMW International Investment BV                 |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 10.01.2031 (a) \$ 200 147 0,07  |                |                          |                                   | Toro European CLO DAC                                |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 24.01.2028 £ 800 811 0,38     |                |                          |                                   |
| EPH Financing International A/S                   |                |                          |                                   | 3,185 % fällig am 12.01.2032 3.426 2.932 1,39        |                |                          |                                   | Cooperative Rabobank UA                         |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 30.11.2029 € 100 92 0,04        |                |                          |                                   | 6.810 3,23                                           |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am                               |                |                          |                                   |
| 6,651 % fällig am 13.11.2028 1.100 1.023 0,49     |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                          |                                   | 29.12.2025 (d)(f) € 600 516 0,24                |                |                          |                                   |
| Summe Tschechische Republik                       |                |                          |                                   | Flutter Treasury DAC                                 |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 23.05.2029 £ 1.000 991 0,47   |                |                          |                                   |
| 1.437 0,68                                        |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 04.06.2031 £ 500 504 0,24          |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 14.09.2027 950 962 0,46       |                |                          |                                   |
| DÄNEMARK                                          |                |                          |                                   | GE Capital UK Funding Unlimited Co.                  |                |                          |                                   | E.ON International Finance BV                   |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 18.01.2033 900 946 0,45            |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 31.01.2034 200 192 0,09       |                |                          |                                   |
| Carlsberg Breweries A/S                           |                |                          |                                   | 1.450 0,69                                           |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 03.06.2030 300 321 0,15       |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 28.02.2039 £ 500 497 0,24       |                |                          |                                   | NON-AGENCY-MBS                                       |                |                          |                                   | Enel Finance International NV                   |                |                          |                                   |
| Danske Bank A/S                                   |                |                          |                                   | Kinbane DAC                                          |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 14.09.2040 800 784 0,37       |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 13.04.2027 600 600 0,28         |                |                          |                                   | 3,188 % fällig am 24.01.2063 € 912 782 0,37          |                |                          |                                   | Holcim Sterling Finance Netherlands BV          |                |                          |                                   |
| Orsted A/S                                        |                |                          |                                   | Summe Irland                                         |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 12.05.2032 300 264 0,13       |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 16.05.2033 1.500 1.210 0,57     |                |                          |                                   | ITALIEN                                              |                |                          |                                   | ING Groep NV                                    |                |                          |                                   |
| Summe Dänemark                                    |                |                          |                                   | FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE                     |                |                          |                                   | 1,125 % fällig am 07.12.2028 1.500 1.387 0,66   |                |                          |                                   |
| 2.307 1,09                                        |                |                          |                                   | Golden Bar Securitisation SRL                        |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 20.05.2033 500 513 0,24       |                |                          |                                   |
| FRANKREICH                                        |                |                          |                                   | 3,086 % fällig am 22.09.2043 1.026 885 0,42          |                |                          |                                   | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV      |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                  |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 09.05.2027 € 600 517 0,25     |                |                          |                                   |
| Banque Federative du Credit Mutuel S.A.           |                |                          |                                   | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA                  |                |                          |                                   | Toyota Motor Finance Netherlands BV             |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 22.10.2029 400 404 0,19         |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 10.09.2030 400 347 0,16            |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 22.10.2029 £ 500 506 0,24     |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 25.05.2028 200 204 0,10         |                |                          |                                   | Intesa Sanpaolo SpA                                  |                |                          |                                   | Universal Music Group NV                        |                |                          |                                   |
| BNP Paribas S.A.                                  |                |                          |                                   | 6,625 % fällig am 31.05.2033 £ 700 753 0,36          |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 30.06.2032 € 100 88 0,04      |                |                          |                                   |
| 2,875 % fällig am 24.02.2029 1.400 1.317 0,62     |                |                          |                                   | Nexi SpA                                             |                |                          |                                   | Volkswagen Financial Services NV                |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 18.08.2029 500 520 0,25         |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 21.05.2031 € 100 86 0,04           |                |                          |                                   | 2,125 % fällig am 18.01.2028 £ 1.300 1.215 0,58 |                |                          |                                   |
| BPCE S.A.                                         |                |                          |                                   | Snam SpA                                             |                |                          |                                   | Summe Niederlande                               |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 22.10.2030 500 502 0,24         |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 28.05.2030 \$ 300 221 0,11         |                |                          |                                   | 9.496 4,50                                      |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 24.05.2029 800 828 0,39         |                |                          |                                   | Summe Italien                                        |                |                          |                                   | NORWEGEN                                        |                |                          |                                   |
| Credit Agricole S.A.                              |                |                          |                                   | JAPAN                                                |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 29.11.2027 1.400 1.419 0,67     |                |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                                     |                |                          |                                   | Public Property Invest A/S                      |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 09.11.2034 300 305 0,14         |                |                          |                                   | Japan Government International Bond                  |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 01.10.2032 € 600 506 0,24     |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 14.06.2031 600 639 0,30         |                |                          |                                   | 0,500 % fällig am 20.03.2059 ¥ 160.000 396 0,19      |                |                          |                                   | PERU                                            |                |                          |                                   |
| Electricite de France S.A.                        |                |                          |                                   | JERSEY, KANALINSELN                                  |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 2.500 2.380 1,13     |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                          |                                   | Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.    |                |                          |                                   |
| 5,875 % fällig am 22.01.2029 (d) 400 393 0,19     |                |                          |                                   | AA Bond Co. Ltd.                                     |                |                          |                                   | 9,700 % fällig am 05.03.2045 PEN 1.000 215 0,10 |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 29.01.2026 (d) 1.000 1.001 0,47 |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 31.07.2050 £ 600 630 0,30          |                |                          |                                   | STAATSEMISSIONEN                                |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 02.06.2034 400 411 0,20         |                |                          |                                   | Gatwick Funding Ltd.                                 |                |                          |                                   | Peru Government International Bond              |                |                          |                                   |
| SEB S.A.                                          |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 15.04.2032 300 271 0,13            |                |                          |                                   | 6,850 % fällig am 12.08.2035 1.600 340 0,16     |                |                          |                                   |
| 3,625 % fällig am 24.06.2030 € 200 172 0,08       |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 27.03.2036 500 474 0,22            |                |                          |                                   | 6,950 % fällig am 12.08.2031 3.600 805 0,38     |                |                          |                                   |
| Societe Generale S.A.                             |                |                          |                                   | Heathrow Funding Ltd.                                |                |                          |                                   | 1.145 0,54                                      |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 22.01.2032 £ 200 204 0,10       |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 13.05.2043 400 395 0,19            |                |                          |                                   | Summe Peru                                      |                |                          |                                   |
| Ubisoft Entertainment S.A.                        |                |                          |                                   | 6,450 % fällig am 10.12.2033 1.100 1.177 0,56        |                |                          |                                   | 1.360 0,64                                      |                |                          |                                   |
| 0,878 % fällig am 24.11.2027 € 700 541 0,26       |                |                          |                                   | SLOWAKEI                                             |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                |                |                          |                                   |
| Summe Frankreich                                  |                |                          |                                   | SPP-Distribucia A/S                                  |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 09.06.2031 € 1.000 733 0,35   |                |                          |                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|

| BESCHREIBUNG                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Whitbread Group PLC          |                |                          |                                   | USA                                |                |                          |                                   | Walgreens Boots Alliance, Inc. |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 31.05.2032 | £ 1.400        | £ 1.391                  | 0,66                              | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL   |                |                          |                                   | 3,600 % fällig am 20.11.2025   | £ 400          | £ 396                    | 0,19                              |
| Workspace Group PLC          |                |                          |                                   | AT&T, Inc.                         |                |                          |                                   | Wells Fargo & Co.              |                |                          |                                   |
| 2,250 % fällig am 11.03.2028 | 800            | 739                      | 0,35                              | 4,250 % fällig am 01.06.2043       | £ 450          | £ 357                    | 0,17                              | 2,125 % fällig am 24.09.2031   | 900            | 772                      | 0,37                              |
| Yorkshire Building Society   |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 14.09.2029       | 1.000          | 990                      | 0,47                              | 2,500 % fällig am 05.02.2029   | 1.650          | 1.530                    | 0,72                              |
| 1,500 % fällig am 15.09.2029 | 800            | 724                      | 0,34                              | 5,200 % fällig am 18.11.2033       | 500            | 498                      | 0,24                              | Welltower OP LLC               |                |                          |                                   |
| Yorkshire Water Finance PLC  |                |                          |                                   | Athene Global Funding              |                |                          |                                   | 4,800 % fällig am 20.11.2028   | 500            | 503                      | 0,24                              |
| 1,750 % fällig am 27.10.2032 | 200            | 155                      | 0,07                              | 1,750 % fällig am 24.11.2027       | 400            | 374                      | 0,18                              |                                |                | 28.005                   | 13,28                             |
| 2,750 % fällig am 18.04.2041 | 700            | 448                      | 0,21                              | 5,150 % fällig am 28.07.2027       | 900            | 907                      | 0,43                              |                                |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 28.04.2030 | 1.100          | 1.095                    | 0,52                              | Bank of America Corp.              |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
| 6,375 % fällig am 18.11.2034 | 100            | 103                      | 0,05                              | 3,584 % fällig am 27.04.2031       | 2.300          | 2.193                    | 1,04                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                | 79.293                   | 37,61                             | Berkshire Hathaway Finance Corp.   |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 19.06.2039       | 1.600          | 1.113                    | 0,53                              |                                |                | 76                       | 0,04                              |
|                              |                |                          |                                   | Citigroup, Inc.                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 23.10.2026       | 1.000          | 965                      | 0,46                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Digital Stout Holding LLC          |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 17.10.2030       | 900            | 854                      | 0,40                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC          |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 09.10.2028       | 200            | 200                      | 0,09                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 6,860 % fällig am 05.06.2026       | 500            | 508                      | 0,24                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Goldman Sachs Group, Inc.          |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 1,875 % fällig am 16.12.2030 (g)   | 1.600          | 1.384                    | 0,66                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 29.10.2029       | 1.175          | 1.141                    | 0,54                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Lineage OP LP                      |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.07.2030       | \$ 100         | 73                       | 0,03                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | MassMutual Global Funding          |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 1,375 % fällig am 15.12.2026       | £ 1.500        | 1.436                    | 0,68                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 12.12.2027       | 750            | 762                      | 0,36                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | McDonald's Corp.                   |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 2,950 % fällig am 15.03.2034       | 700            | 599                      | 0,28                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Metropolitan Life Global Funding   |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 0,625 % fällig am 08.12.2027       | 400            | 367                      | 0,17                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 21.09.2029       | 400            | 357                      | 0,17                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 10.01.2030       | 900            | 916                      | 0,43                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Morgan Stanley                     |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,213 % fällig am 24.10.2035       | 650            | 641                      | 0,30                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,789 % fällig am 18.11.2033       | 600            | 626                      | 0,30                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | New York Life Global Funding       |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 07.12.2029       | 900            | 921                      | 0,44                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Pacific Life Global Funding        |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 12.01.2028       | 1.100          | 1.115                    | 0,53                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 30.11.2028       | 300            | 308                      | 0,15                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Protective Life Global Funding     |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,248 % fällig am 13.01.2028       | 1.100          | 1.122                    | 0,53                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Realty Income Corp.                |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 13.07.2033       | 825            | 636                      | 0,30                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 05.12.2031       | 1.100          | 1.134                    | 0,54                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Spirit Airlines Pass-Through Trust |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 4,100 % fällig am 01.10.2029       | \$ 49          | 33                       | 0,02                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Time Warner Cable LLC              |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.07.2042       | £ 350          | 297                      | 0,14                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 02.06.2031       | 300            | 302                      | 0,14                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | Verizon Communications, Inc.       |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 1,875 % fällig am 19.09.2030       | 500            | 436                      | 0,21                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 08.04.2031       | 1.400          | 1.239                    | 0,59                              |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          |                                   |                                |                |                          |                                   |
|                              |                |                          |                                   |                                    |                |                          | </                                |                                |                |                          |                                   |

## AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## FUTURES

| Beschreibung                                        | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                       | Long  | 03.2030     | 57                   | £ 5                                      | 0,00                 |
| 3-Month SONIA Index December Futures                | Long  | 03.2027     | 211                  | 177                                      | 0,08                 |
| 3-Month SONIA Index December Futures                | Long  | 03.2028     | 170                  | 34                                       | 0,02                 |
| 3-Month SONIA Index December Futures                | Long  | 03.2029     | 107                  | (2)                                      | 0,00                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09.2025     | 6                    | (3)                                      | 0,00                 |
| Euro-Bobl September Futures                         | Long  | 09.2025     | 112                  | (50)                                     | (0,02)               |
| Euro-BTP September Futures                          | Long  | 09.2025     | 41                   | 1                                        | 0,00                 |
| Euro-Bund September Futures                         | Long  | 09.2025     | 23                   | (19)                                     | (0,01)               |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures            | Short | 09.2025     | 16                   | 31                                       | 0,01                 |
| Euro-OAT September Futures                          | Short | 09.2025     | 36                   | 16                                       | 0,01                 |
| Euro-Schatz September Futures                       | Short | 09.2025     | 134                  | 19                                       | 0,01                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 191                  | 68                                       | 0,03                 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|-------------------------------------------|----------------------|
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Short | 09.2025     | 2                    | £ 0                                       | 0,00                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 263                  | 318                                       | 0,15                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Short | 09.2025     | 59                   | (69)                                      | (0,03)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09.2025     | 22                   | (65)                                      | (0,03)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures           | Long  | 09.2025     | 228                  | 403                                       | 0,19                 |
|                                                      |       |             |                      | £ 864                                     | 0,41                 |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHADELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                               | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------------|----------------|----------------|----------------------|---------|-----------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | \$ 108,500     | 25.07.2025     | 15                   | £ (4)   | £ (1)     | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,000        | 25.07.2025     | 11                   | (3)     | 0         | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,000        | 25.07.2025     | 15                   | (4)     | (8)       | (0,01)               |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,500        | 25.07.2025     | 11                   | (3)     | (4)       | 0,00                 |
|                                                            |                |                |                      | £ (14)  | £ (13)    | (0,01)               |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

£ 851 0,40

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit      | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|-------------------------------------------|----------------------|
| Publicis Groupe S.A. | (1,000) %                   | 20.12.2029        | € 1.200                    | £ 4                                       | 0,00                 |

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Referenzeinheit                   | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-----------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|-------------------------------------------|----------------------|
| International Game Technology PLC | 5,000 %                     | 20.06.2030        | € 700                      | £ (2)                                     | 0,00                 |
| Morgan Stanley                    | 1,000                       | 20.06.2026        | \$ 1.300                   | 1                                         | 0,00                 |
| Nexi SpA                          | 5,000                       | 20.06.2030        | € 400                      | (3)                                       | 0,00                 |
| Telefonica Europe BV              | 1,000                       | 20.06.2030        | 1.200                      | 1                                         | 0,00                 |
| ZF Europe Finance BV              | 5,000                       | 20.12.2029        | 400                        | (20)                                      | (0,01)               |
|                                   |                             |                   |                            | £ (23)                                    | (0,01)               |

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Index/Tranchen                      | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|-------------------------------------------|----------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index              | 1,000 %                     | 20.06.2030        | \$ 40.150                  | £ 153                                     | 0,07                 |
| iTraxx Crossover 43 5-Year Index    | 5,000                       | 20.06.2030        | € 600                      | 13                                        | 0,01                 |
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index  | 1,000                       | 20.06.2030        | 13.650                     | 21                                        | 0,01                 |
| iTraxx Europe Main 43 10-Year Index | 1,000                       | 20.06.2035        | 2.500                      | 25                                        | 0,01                 |
|                                     |                             |                   |                            | £ 212                                     | 0,10                 |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variable Zinssatzindex         | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------|--------------------------------|-----------------|-------------------|-------------|-------------------------------------------|----------------------|
| Erhalt                             | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %         | 19.03.2030        | £ 1.600     | £ (4)                                     | 0,00                 |
| Erhalt                             | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500           | 19.03.2035        | 2.800       | (26)                                      | (0,01)               |
| Zahlung                            | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2027        | 8.700       | (3)                                       | 0,00                 |
| Erhalt                             | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,750           | 19.03.2055        | 5.100       | 48                                        | 0,02                 |
| Erhalt                             | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 1,250           | 17.06.2030        | \$ 8.000    | (523)                                     | (0,25)               |
| Erhalt                             | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 19.03.2032        | 10.500      | (186)                                     | (0,09)               |
| Erhalt                             | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,250           | 18.06.2035        | 5.700       | (53)                                      | (0,03)               |
| Erhalt <sup>(4)</sup>              | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750           | 17.09.2027        | 15.000      | (42)                                      | (0,02)               |
| Zahlung                            | 1-Year BRL-CDI                 | 13,354          | 02.01.2029        | BRL 34.100  | 32                                        | 0,02                 |
| Zahlung                            | 6-Month EUR-EURIBOR            | 1,940           | 05.03.2027        | € 6.500     | (56)                                      | (0,03)               |
| Zahlung <sup>(4)</sup>             | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,000           | 17.09.2027        | 6.800       | 35                                        | 0,02                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>             | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2030        | 200         | 0                                         | 0,00                 |
| Zahlung <sup>(4)</sup>             | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2035        | 1.500       | 0                                         | 0,00                 |
| Erhalt <sup>(4)</sup>              | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250           | 17.09.2055        | 1.900       | 24                                        | 0,01                 |
| Erhalt                             | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,280           | 04.03.2030        | 1.300       | 0                                         | 0,00                 |
| Erhalt                             | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,300           | 25.09.2029        | 700         | (8)                                       | 0,00                 |
| Erhalt                             | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,350           | 29.04.2030        | 1.000       | (3)                                       | 0,00                 |
| Erhalt                             | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,360           | 07.10.2029        | 800         | (11)                                      | (0,01)               |

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variabler Zinssatzindex | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,400 %            | 09.04.2030            | € 1.300         | £ (6)                                           | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,450              | 05.05.2035            | 800             | 10                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,500              | 19.03.2027            | 500             | (1)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,650              | 14.08.2029            | 800             | (21)                                            | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,700              | 13.08.2029            | 1.000           | (28)                                            | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,760              | 03.01.2029            | 400             | (7)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,880              | 19.12.2028            | 600             | (19)                                            | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 2,950              | 29.12.2028            | 300             | (10)                                            | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,179              | 29.11.2028            | 200             | (8)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,255              | 22.11.2028            | 300             | (13)                                            | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR     | 3,270              | 08.11.2028            | 600             | (24)                                            | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 6-Month NOK-NIBOR       | 3,780              | 05.03.2027            | NOK 312.600     | 83                                              | 0,04                         |
| Erhalt                                         | CPURNSA                 | 2,501              | 10.05.2029            | \$ 2.000        | 2                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | CPURNSA                 | 2,520              | 04.04.2029            | 1.950           | (2)                                             | 0,00                         |
|                                                |                         |                    |                       |                 | £ (820)                                         | (0,39)                       |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                         |                    |                       |                 | £ (627)                                         | (0,30)                       |

- (1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (2) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- (3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.
- (4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

#### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

##### OPTIONSKAUF

##### DEISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Kosten | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|--------|----------------|------------------------------|
| JPM        | Call - OTC EUR versus USD | \$ 1,223           | 05.03.2026         | 1.200                          | £ 4    | £ 16           | 0,01                         |

##### VERKAUFSOPTIONEN

##### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900 %            | 16.07.2025         | 1.400                          | £ (1)   | £ 0            | 0,00                         |

##### DEISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung              | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| GLM        | Call - OTC USD versus TRY | TRY 53,500         | 11.12.2025         | 600                            | £ (14)  | £ (12)         | (0,01)                       |

##### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler<br>Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,555 %            | 24.07.2025         | 1.300                          | £ (3)   | £ (3)          | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,637              | 18.07.2025         | 1.300                          | (3)     | (5)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,700              | 21.07.2025         | 1.300                          | (3)     | (7)            | (0,01)                       |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,770              | 09.07.2025         | 2.200                          | (5)     | (15)           | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,905              | 24.07.2025         | 1.300                          | (3)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,037              | 18.07.2025         | 1.300                          | (3)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,050              | 21.07.2025         | 1.300                          | (3)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 4,120              | 09.07.2025         | 2.200                          | (5)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,564              | 24.07.2025         | 900                            | (2)     | (3)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,605              | 23.07.2025         | 900                            | (2)     | (3)            | 0,00                         |
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,914              | 24.07.2025         | 900                            | (2)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR           | Zahlung                                     | 3,955              | 23.07.2025         | 900                            | (2)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR        | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 500                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR        | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 500                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,583              | 23.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR           | Erhalt                                      | 3,653              | 14.07.2025         | 700                            | (2)     | (2)            | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|---------------------------------------|-------------------------|------------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|-----------------------|
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                             | 3,680 %        | 07.07.2025     | 300                        | £ (1)   | £ (1)      | 0,00                  |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                             | 3,695          | 17.07.2025     | 900                        | (2)     | (5)        | 0,00                  |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                             | 3,775          | 07.07.2025     | 900                        | (2)     | (6)        | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 3,933          | 23.07.2025     | 300                        | (1)     | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 4,030          | 07.07.2025     | 300                        | (1)     | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 4,053          | 14.07.2025     | 700                        | (2)     | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 4,095          | 17.07.2025     | 900                        | (2)     | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 4,125          | 07.07.2025     | 900                        | (2)     | 0          | 0,00                  |
| JPM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                             | 3,772          | 10.07.2025     | 2.200                      | (5)     | (15)       | (0,01)                |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 4,122          | 10.07.2025     | 2.200                      | (5)     | 0          | 0,00                  |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                             | 3,664          | 14.07.2025     | 700                        | (2)     | (3)        | 0,00                  |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR        | Erhalt                             | 3,697          | 16.07.2025     | 900                        | (2)     | (4)        | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 4,064          | 14.07.2025     | 700                        | (2)     | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR        | Zahlung                            | 4,097          | 16.07.2025     | 900                        | (2)     | 0          | 0,00                  |
|            |                                       |                         |                                    |                |                |                            | £ (72)  | £ (78)     | (0,03)                |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|----------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------------------------|-----------------------------------------|-------------------------------------------|------------|-----------------------|
| BPS        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                     | 20.12.2029        | € 394                      | £ 63                                    | £ (1)                                     | £ 62       | 0,03                  |
| JPM        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000                       | 20.12.2029        | 591                        | 94                                      | (1)                                       | 93         | 0,04                  |
|            |                                  |                             |                   |                            | £ 157                                   | £ (2)                                     | £ 155      | 0,07                  |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|------------|-------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------------|---------------------------------|------------------------------------------------|-----------------------|
| AZD        | 07.2025           | CNH 1.484           | \$ 206                | £ 0                           | £ (1)                           | £ (1)                                          | 0,00                  |
|            | 07.2025           | \$ 14               | NZD 24                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | CNH 2.070           | \$ 288                | 0                             | (2)                             | (2)                                            | 0,00                  |
|            | 08.2025           | NZD 24              | 14                    | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | TWD 3.269           | 100                   | 0                             | (10)                            | (10)                                           | 0,00                  |
| BOA        | 07.2025           | PEN 1.000           | 275                   | 0                             | (5)                             | (5)                                            | 0,00                  |
|            | 07.2025           | \$ 316              | PEN 1.130             | 2                             | 0                               | 2                                              | 0,00                  |
|            | 07.2025           | 34                  | SGD 44                | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | SGD 44              | \$ 34                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | TWD 31              | 1                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 12.2025           | PEN 1.136           | 316                   | 0                             | (2)                             | (2)                                            | 0,00                  |
| BPS        | 07.2025           | € 18.848            | £ 15.832              | 0                             | (315)                           | (315)                                          | (0,16)                |
|            | 07.2025           | £ 16.931            | € 19.863              | 85                            | 0                               | 85                                             | 0,04                  |
|            | 07.2025           | PEN 756             | \$ 207                | 0                             | (4)                             | (4)                                            | 0,00                  |
|            | 07.2025           | THB 266             | 8                     | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 07.2025           | TWD 5.753           | 177                   | 0                             | (15)                            | (15)                                           | (0,01)                |
|            | 07.2025           | \$ 90               | BRL 501               | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                  |
|            | 07.2025           | 186                 | IDR 3.034.474         | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                  |
|            | 07.2025           | 10                  | THB 328               | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 07.2025           | 46                  | TWD 1.383             | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | CNH 433             | \$ 61                 | 0                             | 0                               | 0                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | € 19.863            | £ 16.966              | 0                             | (84)                            | (84)                                           | (0,04)                |
|            | 08.2025           | TRY 8.113           | \$ 195                | 0                             | (2)                             | (2)                                            | 0,00                  |
|            | 08.2025           | TWD 9.801           | 312                   | 0                             | (21)                            | (21)                                           | (0,01)                |
|            | 08.2025           | \$ 60               | CZK 1.329             | 3                             | 0                               | 3                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | 121                 | INR 10.555            | 1                             | 0                               | 1                                              | 0,00                  |
|            | 08.2025           | 98                  | TWD 3.178             | 9                             | 0                               | 9                                              | 0,00                  |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| BRC        | 09.2025               |                        | PEN                      | 551                              | £ 2                                | £ 2                                                  | 0,00                         |
|            | 10.2025               | BRL                    | \$                       | 147                              | 0                                  | (10)                                                 | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CHF                    | £                        | 248                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      |                          | 545                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | €                        | 150                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 3.759                  | \$                       | 5.114                            | 0                                  | (27)                                                 | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | ILS                    |                          | 218                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    |                          | 9                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    |                          | 129                              | 0                                  | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TRY                    |                          | 38                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | ILS                      | 365                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 32                     | PLN                      | 121                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 284                    | TRY                      | 11.658                           | 4                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ZAR                    | \$                       | 1.451                            | 0                                  | (16)                                                 | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | CZK                      | 13.114                           | 25                                 | 0                                                    | 0,01                         |
| CBK        | 08.2025               | 4.715                  | £                        | 3.465                            | 25                                 | 0                                                    | 0,01                         |
|            | 08.2025               | 235                    | TRY                      | 9.782                            | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 12.2025               | 46                     |                          | 2.145                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | AUD                    | £                        | 982                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | \$                       | 957.909                          | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | PEN                    |                          | 376                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    |                          | 2.603                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    |                          | 10.034                           | 0                                  | (27)                                                 | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | BRL                      | 1.125                            | 39                                 | 0                                                    | 0,02                         |
|            | 07.2025               | 129                    | IDR                      | 2.104.348                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 26                     | KRW                      | 35.563                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 101                    | PEN                      | 365                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 191                    | TWD                      | 5.657                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | \$                       | 504                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | PEN                    |                          | 4.837                            | 0                                  | (48)                                                 | (0,02)                       |
| DUB        | 08.2025               | TWD                    |                          | 11.027                           | 338                                | (33)                                                 | (0,02)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | INR                      | 70.680                           | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | 70                     | PEN                      | 251                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                    | \$                       | 369                              | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    |                          | 13.636                           | 10                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    |                          | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | IDR                      | 11                               | 181.066                            | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 45                     | TWD                      | 1.331                            | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | \$                       | 833                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | INR                      | 349                              | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | MXN                    | \$                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | BRL                    |                          | 6.949                            | 0                                  | (9)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    |                          | 1.061                            | 33                                 | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | IDR                      | 31                               | 499.165                            | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 16                     | SGD                      | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| GLM        | 08.2025               | SGD                    | \$                       | 20                               | 16                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 09.2025               | PEN                    |                          | 2.339                            | 647                                | (8)                                                  | 0,00                         |
|            | 10.2025               | \$                     | BRL                      | 1.261                            | 9                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 12.2025               | TRY                    | \$                       | 3.217                            | 69                                 | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CNH                    |                          | 1.338                            | 185                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    |                          | 94.129                           | 69                                 | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | NZD                    |                          | 24                               | 14                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    |                          | 304                              | 237                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    |                          | 5.824                            | 179                                | (16)                                                 | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | £                        | 471                              | 350                                | 6                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 347                    | PLN                      | 1.304                            | 10                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 22                     | SGD                      | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ZAR                    | \$                       | 7.435                            | 416                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    |                          | 1.906                            | 265                                | (2)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    |                          | 29                               | 22                                 | 0                                                    | 0,00                         |
| MBC        | 08.2025               | TWD                    |                          | 6.568                            | 201                                | (20)                                                 | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | INR                      | 136                              | 11.772                             | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | CNH                    | \$                       | 731                              | 101                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | €                        | 915                              | 1.073                              | 4                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ¥                      | £                        | 23.900                           | 124                                | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | SGD                    | \$                       | 731                              | 570                                | (3)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | THB                    |                          | 1.299                            | 39                                 | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    |                          | 2.809                            | 86                                 | (8)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | £                        | 322                              | 238                                | 3                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 32                     | IDR                      | 521.258                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 249                    | PLN                      | 933                              | 7                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 591                    | SGD                      | 764                              | 7                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 83                     | TWD                      | 2.634                            | 5                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | \$                       | 733                              | 101                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    |                          | 762                              | 591                                | (7)                                                  | 0,00                         |
| MYI        | 08.2025               | TWD                    |                          | 2.683                            | 82                                 | (8)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                      | £                        | 1.835                            | 1.567                              | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | \$                       | 186                              | 250                                | (4)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    |                          | 633                              | 88                                 | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CZK                    |                          | 14.422                           | 676                                | (7)                                                  | 0,00                         |
|            | 10.2025               | BRL                    |                          | 800                              | 131                                | (9)                                                  | 0,00                         |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|---------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| RYL        | 07.2025               | \$                  | 608                      | £ 451                            | £ 7                                | £ 7                                                  | 0,00                         |
| SCX        | 07.2025               | AUD                 | 77                       | 37                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | €                   | 280                      | 239                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                   | 113                      | 134                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                     | 292                      | \$ 394                           | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                 | 6                        | 2                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | PEN                 | 1.124                    | 310                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                 | 296                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                  | 142                      | IDR 2.321.429                    | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                     | 397                      | PEN 1.423                        | 3                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                     | 118                      | SGD 152                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                     | 168                      | TWD 4.979                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                 | 1.092                    | \$ 153                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | £                   | 240                      | € 280                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                 | 152                      | \$ 118                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                 | 1.605                    | 49                               | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                  | 158                      | CNH 1.149                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                     | 106                      | INR 9.109                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SOG        | 07.2025               | £                   | 86                       | € 100                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                  | 679                      | £ 499                            | 3                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               |                     | 1                        | INR 70                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SSB        | 07.2025               | CAD                 | 1.473                    | £ 792                            | 4                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                   | 792                      | CAD 1.481                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               |                     | 1.456                    | \$ 1.978                         | 0                                  | (13)                                                 | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                  | 5.629                    | £ 4.157                          | 50                                 | 0                                                    | 0,02                         |
|            | 08.2025               | CAD                 | 1.479                    | 792                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| UAG        | 07.2025               | £                   | 390                      | ¥ 77.100                         | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | ILS                 | 56                       | \$ 16                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025               | \$                  | 116                      | MXN 2.246                        | 2                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            |                       |                     |                          | £ 342                            | £ (794)                            | £ (452)                                              | (0,22)                       |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

£ (371) (0,18)

### BESCHREIBUNG

#### SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE

|                                           | PARI (000S) | MARKTWERT<br>(000S) | % DES<br>NETTOVERMÖGENS |
|-------------------------------------------|-------------|---------------------|-------------------------|
| Credit Suisse AG AT1 Claim                | \$ 200      | £ 18                | 0,01                    |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte |             | £ 18                | 0,01                    |
| Summe Anlagen                             |             | £ 220.966           | 104,77                  |
| Sonstige Aktiva und Passiva               |             | £ (10.052)          | (4,77)                  |
| Nettovermögen                             |             | £ 210.914           | 100,00                  |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

- (a) Wertpapier per Emissionstermin.
- (b) Nullkuponwertpapier.
- (c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.
- (d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (e) Mit dem Fonds verbunden.
- (f) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 1.384 GBP (31. Dezember 2024: 237 GBP) als Sicherheiten verpfändet.
- (h) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von 282 GBP (31. Dezember 2024: null GBP) als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 5.184 GBP (31. Dezember 2024: 3.842 GBP) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------|
| Übertragbare Wertpapiere            | £ 0                                                                         | £ 216.641                                                       | £ 302                                                        | £ 216.943 |
| Investmentfonds                     | 4.152                                                                       | 0                                                               | 0                                                            | 4.152     |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 606                                                                         | (753)                                                           | 0                                                            | (147)     |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 18                                                              | 0                                                            | 18        |
| Summen                              | £ 4.758                                                                     | £ 215.906                                                       | £ 302                                                        | £ 220.966 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert        |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | £ 0                                                                         | £ 204.682                                                       | £ 0                                                          | £ 204.682        |
| Investmentfonds                     | 15.176                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 15.176           |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 2.100                                                           | 0                                                            | 2.100            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (118)                                                                       | (29)                                                            | 0                                                            | (147)            |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 20                                                              | 0                                                            | 20               |
| <b>Summen</b>                       | <b>£ 15.058</b>                                                             | <b>£ 206.773</b>                                                | <b>£ 0</b>                                                   | <b>£ 221.831</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                                | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus Pensionsge-<br>schäften | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|--------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| BRC                                       | 3,800 %    | 23.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | £ (1.358)    | £ (1.364)                                        | (0,65)                       |
| <b>Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b> |            |                       |                       |              | <b>£ (1.364)</b>                                 | <b>(0,65)</b>                |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für Derivative OTC-Finanzinstrumente

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der Derivative OTC-Finanzinstrumente und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | £ (13)                              | £ 0                                   | £ (13)                              | £ 1                                 | £ 0                                   | £ 1                                 |
| BOA        | (37)                                | 0                                     | (37)                                | 39                                  | 0                                     | 39                                  |
| BPS        | (286)                               | 282                                   | (4)                                 | 78                                  | 0                                     | 78                                  |
| BRC        | 3                                   | 0                                     | 3                                   | (11)                                | 0                                     | (11)                                |
| CBK        | (81)                                | 0                                     | (81)                                | 25                                  | 0                                     | 25                                  |
| DUB        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 10                                  | 0                                     | 10                                  |
| GLM        | (39)                                | 0                                     | (39)                                | (20)                                | 0                                     | (20)                                |
| JPM        | 69                                  | 0                                     | 69                                  | (15)                                | 0                                     | (15)                                |
| MBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 16                                  | 0                                     | 16                                  |
| MYC        | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MYI        | (25)                                | 0                                     | (25)                                | 5                                   | 0                                     | 5                                   |
| RBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 6                                   | 0                                     | 6                                   |
| RYL        | 7                                   | 0                                     | 7                                   | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 |
| SCX        | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 | 258                                 | (300)                                 | (42)                                |
| SOG        | 3                                   | 0                                     | 3                                   | (8)                                 | 0                                     | (8)                                 |
| SSB        | 41                                  | 0                                     | 41                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (8)                                 | 0                                     | (8)                                 |
| UAG        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | (5)                                 | 0                                     | (5)                                 |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 72,91             | 67,28             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 10,52             | 10,29             |
| Investmentfonds                                                        | 1,60              | 5,76              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | k. A.             | 0,80              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,41              | 0,10              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,17              | 0,31              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,20              | 0,15              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,01              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 14,18             | 15,30             |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>     | <b>100,00</b>     |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                                                             | 0,17              | k. A.             |
| Belgien                                                                                | k. A.             | 0,08              |
| Kanada                                                                                 | 0,71              | 0,82              |
| Kaimaninseln                                                                           | 0,39              | 0,98              |
| Chile                                                                                  | k. A.             | 0,20              |
| Tschechische Republik                                                                  | 0,68              | 0,66              |
| Dänemark                                                                               | 1,09              | 0,88              |
| Frankreich                                                                             | 5,33              | 7,38              |
| Deutschland                                                                            | 0,77              | 0,69              |
| Guernsey, Kanalinseln                                                                  | k. A.             | 0,30              |
| Irland                                                                                 | 4,29              | 4,38              |
| Italien                                                                                | 1,09              | 2,37              |
| Japan                                                                                  | 0,19              | k. A.             |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 1,73              | 2,96              |
| Luxemburg                                                                              | 0,65              | 1,41              |
| Mexiko                                                                                 | 0,13              | 0,61              |
| Niederlande                                                                            | 4,50              | 4,72              |
| Norwegen                                                                               | 0,24              | 0,87              |
| Peru                                                                                   | 0,64              | 0,47              |
| Slowakei                                                                               | 0,35              | 0,32              |
| Slowenien                                                                              | k. A.             | 0,18              |
| Südafrika                                                                              | 0,71              | 0,70              |
| Spanien                                                                                | 1,42              | 1,86              |
| Schweden                                                                               | k. A.             | 0,30              |
| Schweiz                                                                                | 1,14              | 1,75              |
| Großbritannien                                                                         | 52,08             | 36,65             |
| Vereinigte Staaten                                                                     | 22,08             | 24,49             |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 2,49              | k. A.             |
| Investmentfonds                                                                        | 1,97              | 7,12              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | k. A.             | 0,99              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,41              | (0,13)            |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte                             | (0,01)            | (0,01)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzkauf    | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | (0,01)            | 0,04              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,10              | 0,01              |
| Zinsswaps                                                                              | (0,39)            | (0,15)            |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | 0,01              | k. A.             |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | (0,01)            | 0,00              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,03)            | (0,03)            |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | k. A.             | (0,01)            |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,07              | 0,03              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,22)            | 0,18              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,01              | 0,01              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (4,77)            | (4,08)            |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                                         | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE                             |                |                          |                                   | JERSEY, KANALINSELN                                          |                |                          |                                   | Land Securities Capital Markets PLC              |                |                          |                                   |
| BRASILIEN                                            |                |                          |                                   | UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                             |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 22.09.2059 £ 301 £165 0,49     |                |                          |                                   |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                          |                                   | Aston Martin Capital Holdings Ltd.                           |                |                          |                                   | Legal & General Group PLC                        |                |                          |                                   |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional                    |                |                          |                                   | 10,375 % fällig am 31.03.2029 £ 200 £ 187 0,55               |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.11.2050 200 192 0,57        |                |                          |                                   |
| 0,000 % fällig am 01.10.2025 (b) BRL 4.400 £567 1,68 |                |                          |                                   | Gatwick Funding Ltd.                                         |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(e) 300 282 0,83 |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 28.09.2041 500 368 1,09            |                |                          |                                   | Heathrow Funding Ltd.                                        |                |                          |                                   | Lloyds Banking Group PLC                         |                |                          |                                   |
| 2,750 % fällig am 09.08.2051 500 292 0,86            |                |                          |                                   | 2,750 % fällig am 31.10.2048 177 145 0,43                    |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 27.06.2030 (d)(e) 200 201 0,59 |                |                          |                                   |
| Summe Jersey, Kanalinseln 992 2,93                   |                |                          |                                   | London & Quadrant Housing Trust                              |                |                          |                                   | 2,125 % fällig am 31.03.2032 400 331 0,98        |                |                          |                                   |
| MEXIKO                                               |                |                          |                                   | M&G PLC                                                      |                |                          |                                   | 5,560 % fällig am 20.07.2055 350 329 0,97        |                |                          |                                   |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                          |                                   | Manchester Airport Group Funding PLC                         |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 30.09.2044 350 224 0,66        |                |                          |                                   |
| Mexico Government International Bond                 |                |                          |                                   | Meadowhall Finance PLC                                       |                |                          |                                   | 4,988 % fällig am 12.07.2037 57 50 0,15          |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 19.03.2114 400 277 0,82            |                |                          |                                   | NIEDERLANDE                                                  |                |                          |                                   | Miller Homes Group Finco PLC                     |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                          |                                   | E.ON International Finance BV                                |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 15.05.2029 300 303 0,90        |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 650 666 1,97            |                |                          |                                   | SÜDAFRIKA                                                    |                |                          |                                   | Mitchells & Butlers Finance PLC                  |                |                          |                                   |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                          |                                   | South Africa Government International Bond                   |                |                          |                                   | 6,233 % fällig am 15.09.2034 493 459 1,36        |                |                          |                                   |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037 ZAR 6.400 229 0,67      |                |                          |                                   | TÜRKEI                                                       |                |                          |                                   | Morhomes PLC                                     |                |                          |                                   |
| STAATSEMISSIONEN                                     |                |                          |                                   | Turkey Government International Bond                         |                |                          |                                   | 3,400 % fällig am 19.02.2040 300 237 0,70        |                |                          |                                   |
| 49,053 % fällig am 19.08.2026 TRY 300 6 0,02         |                |                          |                                   | GROSSBRITANNIEN                                              |                |                          |                                   | Motability Operations Group PLC                  |                |                          |                                   |
| UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL                     |                |                          |                                   | Anglian Water Services Financing PLC                         |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 20.01.2041 400 224 0,66        |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 07.06.2043 £ 200 184 0,54          |                |                          |                                   | Aviva PLC                                                    |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 17.01.2043 500 437 1,29        |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 20.06.2039 200 196 0,58            |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 03.06.2055 200 169 0,50                    |                |                          |                                   | National Grid Electricity Transmission PLC       |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 20.05.2058 100 104 0,31            |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 11.08.2031 200 168 0,50                    |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 16.09.2038 600 395 1,17        |                |                          |                                   |
| 2,500 % fällig am 11.08.2031 200 168 0,50            |                |                          |                                   | Blend Funding PLC                                            |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 17.04.2040 508 319 0,94        |                |                          |                                   |
| 3,459 % fällig am 21.09.2049 400 279 0,82            |                |                          |                                   | British Telecommunications PLC                               |                |                          |                                   | NIE Finance PLC                                  |                |                          |                                   |
| Boparan Finance PLC                                  |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 13.02.2041 500 481 1,42                    |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 07.12.2035 200 202 0,60        |                |                          |                                   |
| 9,375 % fällig am 07.11.2029 100 104 0,31            |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 03.12.2055 100 100 0,30                    |                |                          |                                   | Northern Powergrid Northeast PLC                 |                |                          |                                   |
| Broadgate Financing PLC                              |                |                          |                                   | Broadgate Financing PLC                                      |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 01.04.2052 200 126 0,37        |                |                          |                                   |
| 4,999 % fällig am 05.10.2033 528 524 1,55            |                |                          |                                   | Burberry Group PLC                                           |                |                          |                                   | Northern Powergrid Yorkshire PLC                 |                |                          |                                   |
| 5,098 % fällig am 05.04.2035 85 82 0,24              |                |                          |                                   | Cadent Finance PLC                                           |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 04.05.2035 410 401 1,18        |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 20.06.2030 200 200 0,59            |                |                          |                                   | Catalyst Housing Ltd.                                        |                |                          |                                   | Northumbrian Water Finance PLC                   |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 22.09.2038 900 631 1,87            |                |                          |                                   | Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 02.10.2037 500 475 1,40        |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 31.10.2047 900 571 1,69            |                |                          |                                   | Clarion Funding PLC                                          |                |                          |                                   | Notting Hill Genesis                             |                |                          |                                   |
| 2,350 % fällig am 27.06.2078 200 98 0,29             |                |                          |                                   | Eastern Power Networks PLC                                   |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 12.10.2048 441 285 0,84        |                |                          |                                   |
| 1,875 % fällig am 07.09.2051 400 184 0,54            |                |                          |                                   | Greene King Finance PLC                                      |                |                          |                                   | Ocado Group PLC                                  |                |                          |                                   |
| 3,125 % fällig am 19.04.2048 500 322 0,95            |                |                          |                                   | Haleon UK Capital PLC                                        |                |                          |                                   | 11,000 % fällig am 15.06.2030 200 195 0,58       |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 26.02.2042 400 377 1,11            |                |                          |                                   | Imperial Brands Finance PLC                                  |                |                          |                                   | Sage Group PLC                                   |                |                          |                                   |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 396 392 1,16            |                |                          |                                   | J Sainsbury PLC                                              |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 05.03.2037 300 299 0,88        |                |                          |                                   |
| 3,375 % fällig am 29.03.2038 320 260 0,77            |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Sanctuary Capital PLC                            |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 12.02.2034 € 100 84 0,25           |                |                          |                                   | J Sainsbury PLC                                              |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 14.04.2050 200 108 0,32        |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 29.01.2035 £ 300 302 0,89          |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Severn Trent Utilities Finance PLC               |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 222 181 0,53            |                |                          |                                   | J Sainsbury PLC                                              |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 02.06.2040 500 305 0,90        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | J Sainsbury PLC                                              |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 24.01.2042 200 174 0,51        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Society of Lloyd's                               |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 07.02.2047 200 200 0,59        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | South Eastern Power Networks PLC                 |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 1,750 % fällig am 30.09.2034 400 301 0,89        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Southern Electric Power Distribution PLC         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 20.02.2037 300 276 0,82        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Southern Housing                                 |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 2,375 % fällig am 08.10.2036 350 255 0,75        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | SW Finance PLC                                   |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 28.05.2037 300 207 0,61        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 16.04.2040 400 382 1,13        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Telereal Securitisation PLC                      |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 6,165 % fällig am 10.12.2033 72 74 0,22          |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Tesco Property Finance PLC                       |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 5,411 % fällig am 13.07.2044 86 83 0,25          |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 5,661 % fällig am 13.10.2041 182 179 0,53        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 5,744 % fällig am 13.04.2040 581 581 1,72        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Thames Water Super Senior Issuer PLC             |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 10.10.2027 15 16 0,05          |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 9,750 % fällig am 10.10.2027 13 15 0,04          |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | United Utilities Water Finance PLC               |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 06.10.2038 500 466 1,38        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | University of Oxford                             |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 2,544 % fällig am 08.12.2117 450 214 0,63        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Vmed O2 UK Financing PLC                         |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.04.2032 (a) € 200 174 0,51  |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Vodafone Group PLC                               |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 12.08.2056 £ 600 338 1,00      |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | Wellcome Trust Ltd.                              |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 1,500 % fällig am 14.07.2071 500 172 0,51        |                |                          |                                   |
|                                                      |                |                          |                                   | John Lewis PLC                                               |                |                          |                                   | 2,517 % fällig am 07.02.2118 300 141 0,42        |                |                          |                                   |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Wessex Water Services Finance PLC       |                |                          |                                   | Apple, Inc.                      |                |                          |                                   | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                        |                |                          |                                   |
| 6,500 % fällig am 19.09.2040            | £ 200          | £202                     | 0,60                              | 3,600 % fällig am 31.07.2042     | £ 200          | £163                     | 0,48                              | Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust                |                |                          |                                   |
| Yorkshire Water Finance PLC             |                |                          |                                   | AT&T, Inc.                       |                |                          |                                   | 4,934 % fällig am 25.04.2035                                 | \$ 107         | £72                      | 0,21                              |
| 2,750 % fällig am 18.04.2041            | 600            | 384                      | 1,13                              | 4,250 % fällig am 01.06.2043     | 913            | 724                      | 2,14                              | GSR Mortgage Loan Trust                                      |                |                          |                                   |
|                                         |                | 17.371                   | 51,33                             | 4,875 % fällig am 01.06.2044     | 338            | 288                      | 0,85                              | 6,562 % fällig am 25.09.2035                                 | 0              | 0                        | 0,00                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                   |                |                          |                                   | Athene Global Funding            |                |                          |                                   | Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust |                |                          |                                   |
| Mansard Mortgages PLC                   |                |                          |                                   | 5,146 % fällig am 01.11.2029     | 200            | 201                      | 0,59                              | 4,866 % fällig am 15.12.2030                                 | 2              | 1                        | 0,00                              |
| 5,008 % fällig am 15.12.2049            | 64             | 63                       | 0,19                              | Berkshire Hathaway Finance Corp. |                |                          |                                   | Sequoia Mortgage Trust                                       |                |                          |                                   |
| Newgate Funding PLC                     |                |                          |                                   | 2,625 % fällig am 19.06.2059     | 400            | 215                      | 0,64                              | 3,522 % fällig am 20.07.2037                                 | 6              | 3                        | 0,01                              |
| 2,575 % fällig am 15.12.2050            | € 772          | 651                      | 1,92                              | Comcast Corp.                    |                |                          |                                   |                                                              |                | 76                       | 0,22                              |
| 4,517 % fällig am 01.12.2050            | £ 38           | 38                       | 0,11                              | 1,875 % fällig am 20.02.2036     | 250            | 181                      | 0,54                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                 |                |                          |                                   |
|                                         |                | 752                      | 2,22                              | JPMorgan Chase & Co.             |                |                          |                                   | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA                        |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                 |                |                          |                                   | 1,895 % fällig am 28.04.2033     | 300            | 251                      | 0,74                              | 6,000 % fällig am 01.08.2055                                 | 1.800          | 1.333                    | 3,94                              |
| United Kingdom Gilt                     |                |                          |                                   | McDonald's Corp.                 |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.08.2055                                 | 8.900          | 6.697                    | 19,79                             |
| 4,500 % fällig am 07.03.2035            | 1.000          | 1.001                    | 2,96                              | 4,125 % fällig am 11.06.2054     | 300            | 221                      | 0,65                              |                                                              |                | 8.030                    | 23,73                             |
| 4,750 % fällig am 22.10.2043            | 700            | 669                      | 1,98                              | Nestle Capital Corp.             |                |                          |                                   | Summe USA                                                    |                | 12.498                   | 36,92                             |
|                                         |                | 1.670                    | 4,94                              | 4,750 % fällig am 22.03.2036     | 200            | 194                      | 0,57                              | <b>KURZFRISTIGE INSTRUMENTE</b>                              |                |                          |                                   |
| Summe Großbritannien                    |                | 19.793                   | 58,49                             | Realty Income Corp.              |                |                          |                                   | <b>U.K. TREASURY BILLS</b>                                   |                |                          |                                   |
| <b>USA</b>                              |                |                          |                                   | 2,500 % fällig am 14.01.2042     | 200            | 128                      | 0,38                              | 4,180 % fällig am                                            |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b> |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 04.09.2041     | 200            | 182                      | 0,54                              | 22.09.2025 (b)(c)                                            | £ 150          | 148                      | 0,44                              |
| ACREC LLC                               |                |                          |                                   | Verizon Communications, Inc.     |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am                                            |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 18.08.2042            | \$ 500         | 364                      | 1,07                              | 3,375 % fällig am 27.10.2036     | 500            | 411                      | 1,21                              | 07.07.2025 (b)(c)                                            | 510            | 510                      | 1,50                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b> |                |                          |                                   | Walgreens Boots Alliance, Inc.   |                |                          |                                   | Summe kurzfristige                                           |                |                          |                                   |
| AES Corp.                               |                |                          |                                   | 3,600 % fällig am 20.11.2025     | 300            | 297                      | 0,88                              | Instrumente                                                  |                | 658                      | 1,94                              |
| 6,950 % fällig am 15.07.2055            | 100            | 71                       | 0,21                              | Wells Fargo & Co.                |                |                          |                                   | Summe Übertragbare Wertpapiere                               |                | £ 39.984                 | 118,14                            |
|                                         |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 02.11.2035     | 529            | 501                      | 1,48                              |                                                              |                |                          |                                   |
|                                         |                |                          |                                   |                                  |                | 4.028                    | 11,90                             |                                                              |                |                          |                                   |

### AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month SOFR June Futures                                      | Long  | 09.2027     | 12                   | £ 20                                     | 0,06                 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures            | Long  | 09.2025     | 6                    | 2                                        | 0,01                 |
| Euro-Bobl September Futures                                    | Long  | 09.2025     | 7                    | (3)                                      | (0,01)               |
| Euro-BTP September Futures                                     | Long  | 09.2025     | 1                    | 0                                        | 0,00                 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures                       | Short | 09.2025     | 5                    | 10                                       | 0,03                 |
| Euro-Schatz September Futures                                  | Short | 09.2025     | 12                   | 1                                        | 0,00                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025     | 21                   | (11)                                     | (0,04)               |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025     | 27                   | (18)                                     | (0,05)               |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 51                   | 67                                       | 0,20                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 4                    | 3                                        | 0,01                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025     | 6                    | (11)                                     | (0,03)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025     | 104                  | 205                                      | 0,60                 |
|                                                                |       |             |                      | £ 265                                    | 0,78                 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                      | £ 265                                    | 0,78                 |

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen                      | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|-------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| iTraxx Europe Main 43 10-Year Index | (1,000) %                   | 20.06.2035       | € 2.200                   | £ (5)                                    | (0,02)               |

#### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(2)</sup>

| Index/Tranchen                       | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(3)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| iTraxx Europe Main 43 5-Year Index   | 1,000 %                     | 20.06.2030       | € 4.700                   | £ 42                                     | 0,12                 |
| iTraxx Europe Senior 43 5-Year Index | 1,000                       | 20.06.2030       | 3.400                     | 9                                        | 0,03                 |
|                                      |                             |                  |                           | £ 51                                     | 0,15                 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex              | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 2.850         | £ 7                                             | 0,02                         |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,500              | 19.03.2035            | 4.600           | (24)                                            | (0,07)                       |
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750              | 19.03.2027            | 700             | 0                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS      | 3,750              | 19.03.2055            | 2.745           | (14)                                            | (0,04)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 19.03.2027            | \$ 3.900        | (12)                                            | (0,03)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,000              | 19.03.2030            | 6.900           | (151)                                           | (0,45)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 19.03.2032            | 6.200           | (158)                                           | (0,47)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,250              | 18.06.2035            | 6.400           | (50)                                            | (0,15)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,500              | 17.09.2055            | 100             | (2)                                             | 0,00                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 17.09.2027            | 5.500           | 18                                              | 0,05                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.12.2029            | 2.700           | 20                                              | 0,06                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 17.09.2030            | 6.600           | 50                                              | 0,15                         |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 18.12.2034            | 2.400           | 13                                              | 0,04                         |
| Zahlung <sup>(4)</sup>                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 17.09.2035            | 6.100           | 70                                              | 0,21                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS       | 3,750              | 17.09.2035            | 2.500           | (23)                                            | (0,07)                       |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 2,750              | 17.09.2027            | CAD 700         | (1)                                             | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS | 3,750              | 20.12.2025            | 4.400           | 74                                              | 0,22                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250              | 17.09.2030            | € 300           | 0                                               | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(4)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,250              | 17.09.2035            | 350             | 1                                               | 0,00                         |
| Zahlung                                        | 6-Month EUR-EURIBOR                 | 2,610              | 24.03.2035            | 200             | 1                                               | 0,00                         |
|                                                |                                     |                    |                       |                 | £ (181)                                         | (0,53)                       |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                     |                    |                       |                 | £ (135)                                         | (0,40)                       |

- <sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- <sup>(2)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.
- <sup>(3)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.
- <sup>(4)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## VERKAUFSOPTIONEN

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| CBK        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR    | Erhalt                                      | 2,380 %            | 03.07.2025         | 100                            | £ 0     | £ 0            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR    | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR    | Zahlung                                     | 2,640              | 03.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR    | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 200                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                        |                                             |                    |                    |                                | £ (1)   | £ 0            | 0,00                         |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit     | Zu<br>erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------|-----------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| GST        | Petroleos Mexicanos | 3,750 %                           | 24.12.2025            | \$ 100                         | £ 0                                      | £ 0                                                | £ 0            | 0,00                         |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Index/Tranchen                   | Zu<br>erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht<br>realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|--------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| JPM        | iTraxx Crossover 42 5-Year Index | 5,000 %                           | 20.12.2029            | € 295                          | £ 48                                     | £ (1)                                              | £ 47           | 0,14                         |

- <sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.



(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CNH                    | 1.953                    | \$ 271                           | £ 0                                | £ (1)                                                | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 124                      | 171                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 35                       | NZD 58                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 2.081                    | \$ 289                           | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                       |
|            | 08.2025               | NZD                    | 58                       | 35                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BOA        | 08.2025               | \$                     | 101                      | CNH 722                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | £                      | 171                      | £ 124                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | IDR                    | 1.670.183                | \$ 102                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 85.587                   | 63                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 174                      | CNY 1.250                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BPS        | 07.2025               | 2                      | SGD 3                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 258                    | ZAR 4.582                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 08.2025               | SGD                    | 3                        | \$ 2                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 21                       | 1                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 101                      | CNH 724                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| BRC        | 07.2025               | €                      | 5.392                    | £ 4.529                          | 0                                  | (91)                                                 | (0,27)                       |
|            | 07.2025               | £                      | 2.335                    | € 2.740                          | 13                                 | 13                                                   | 0,03                         |
|            | 07.2025               | 843                    | \$ 1.144                 | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | (0,03)                       |
|            | 07.2025               | TRY                    | 198                      | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | TWD                    | 3.072                    | 95                               | 0                                  | (8)                                                  | (0,02)                       |
| CBK        | 07.2025               | \$                     | 10                       | BRL 56                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 25                     | IDR 410.708              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 27                     | THB 908                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 8                      | TWD 231                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | CNH                    | 372                      | \$ 51                            | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
| DUB        | 08.2025               | €                      | 2.740                    | £ 2.340                          | 0                                  | (12)                                                 | (0,03)                       |
|            | 08.2025               | TWD                    | 3.635                    | \$ 112                           | 0                                  | (10)                                                 | (0,03)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 288                      | CNH 2.075                        | 2                                  | 2                                                    | 0,01                         |
|            | 08.2025               | 24                     | INR 2.129                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | 92                     | TWD 2.720                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,01                         |
| GLM        | 10.2025               | BRL                    | 3.100                    | \$ 506                           | 0                                  | (37)                                                 | (0,11)                       |
|            | 07.2025               | CHF                    | 56                       | £ 51                             | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 85                       | CAD 156                          | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 2.149                  | \$ 2.923                 | 0                                | (18)                               | (18)                                                 | (0,05)                       |
|            | 07.2025               | 144                    | 41                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | PLN                    | 266                      | 71                               | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | THB                    | 3.468                    | 104                              | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | TRY                    | 738                      | 18                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 21                       | ILS 69                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 6                      | PLN 24                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | 132                    | SGD 170                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 24                     | TRY 977                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 161                    | ZAR 2.908                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 10.104                   | \$ 559                           | 0                                  | (6)                                                  | (0,02)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 2.723                    | £ 2.001                          | 15                                 | 15                                                   | 0,04                         |
| JPM        | 09.2025               | 105                    | PEN 384                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               | AUD                    | 1.282                    | £ 614                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | £                      | 406                      | \$ 550                           | 0                                  | (4)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | KRW                    | 392.120                  | 286                              | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | TWD                    | 5.522                    | 170                              | 0                                  | (15)                                                 | (0,04)                       |
| JPM        | 07.2025               | \$                     | 226                      | BRL 1.294                        | 9                                  | 9                                                    | 0,02                         |
|            | 07.2025               | 75                     | IDR 1.219.904            | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 231                    | KRW 318.082              | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               | 14                     | THB 474                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 71                     | TWD 2.108                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 08.2025               | CNH                    | 663                      | \$ 92                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | TWD                    | 6.201                    | 190                              | 0                                  | (19)                                                 | (0,05)                       |
|            | 08.2025               | \$                     | 160                      | INR 13.798                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | 161                    | TWD 4.686                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 12.2025               | PEN                    | 390                      | \$ 105                           | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                       |
| JPM        | 07.2025               | ILS                    | 70                       | 20                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | KRW                    | 13.636                   | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | \$                     | 3                        | IDR 45.258                       | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 25                     | ILS 88                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | 2                      | TWD 50                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 08.2025               | CNH                    | 580                      | \$ 81                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | \$                     | 212                      | CNH 1.532                        | 2                                  | 2                                                    | 0,01                         |
|            | 08.2025               | 70                     | INR 6.083                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | BRL                    | 2.603                    | \$ 472                           | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | IDR                    | 1.067.651                | 65                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | TWD                    | 708                      | 22                               | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | \$                     | 226                      | BRL 1.249                        | 2                                  | 2                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               | 18                     | IDR 289.367              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 08.2025               | INR                    | 14.673                   | \$ 169                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 09.2025               | PEN                    | 57                       | 16                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 10.2025               | BRL                    | 100                      | 16                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                         |
|            | 10.2025               | \$                     | 337                      | BRL 1.901                        | 2                                  | 2                                                    | 0,01                         |
|            | 07.2025               | CNH                    | 1.761                    | \$ 244                           | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                       |
|            | 07.2025               | KRW                    | 32.654                   | 24                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
|            | 07.2025               | NZD                    | 58                       | 34                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| JPM        | 07.2025               | SGD                    | 72                       | 56                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| MBC        | 07.2025               | TWD                    | \$                       | 96                               | £ 0                                | £ (8)                                                | (0,03)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | PLN                      | 262                              | 2                                  | 2                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               |                        | TWD                      | 551                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ZAR                    | \$                       | 153                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | CNH                    |                          | 263                              | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                    |
|            | 08.2025               | TWD                    |                          | 120                              | 0                                  | (13)                                                 | (0,03)                    |
|            | 08.2025               | \$                     | CNH                      | 1.403                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | INR                      | 2.374                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | CNH                    | \$                       | 133                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | £                      | €                        | 1.254                            | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | ¥                        | 49.900                           | 0                                  | (6)                                                  | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | £                        | 157                              | 2                                  | 2                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               | SGD                    | \$                       | 134                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | TWD                    |                          | 45                               | 0                                  | (4)                                                  | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$                     | £                        | 179                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | IDR                      | 268.527                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | PLN                      | 187                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | SGD                      | 54                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | THB                      | 605                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | MYI                   | 07.2025                |                          | TWD                              | 17                                 | 0                                                    | 0                         |
| 08.2025    |                       | CNH                    | \$                       | 133                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
| 08.2025    |                       | SGD                    |                          | 42                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| 08.2025    |                       | TWD                    |                          | 43                               | 0                                  | (4)                                                  | (0,01)                    |
| 08.2025    |                       | \$                     | THB                      | 830                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| 08.2025    |                       |                        | TWD                      | 6.624                            | 18                                 | 18                                                   | 0,05                      |
| 09.2025    |                       | MXN                    | \$                       | 13                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| 07.2025    |                       | AUD                    | £                        | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| 07.2025    |                       | £                      | \$                       | 413                              | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                    |
| 07.2025    |                       | \$                     | £                        | 82                               | 2                                  | 2                                                    | 0,00                      |
| RYL        | 08.2025               |                        | CNH                      | 936                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 10.2025               | BRL                    | \$                       | 408                              | 0                                  | (30)                                                 | (0,09)                    |
| SCX        | 07.2025               | £                      | AUD                      | 1.091                            | 0                                  | (3)                                                  | (0,01)                    |
|            | 07.2025               |                        | \$                       | 423                              | 0                                  | (4)                                                  | (0,01)                    |
| SOG        | 07.2025               | CNY                    |                          | 175                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | £                      | €                        | 1.202                            | 11                                 | 11                                                   | 0,03                      |
|            | 07.2025               |                        | NOK                      | 75                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | \$                       | 429                              | 0                                  | (6)                                                  | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | ILS                    |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | IDR                      | 1.345.763                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | SGD                      | 11                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | TWD                      | 5.390                            | 3                                  | 3                                                    | 0,01                      |
|            | 08.2025               | SGD                    | \$                       | 8                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | TWD                    |                          | 26                               | 0                                  | (2)                                                  | (0,01)                    |
| SSB        | 08.2025               | \$                     | CNH                      | 1.613                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | CNY                      | 1.250                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | INR                      | 1.837                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | £                      | €                        | 196                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | INR                      | 14                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               |                        | TWD                      | 2.223                            | 7                                  | 7                                                    | 0,02                      |
| UAG        | 07.2025               | CAD                    | £                        | 153                              | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | £                      | CAD                      | 127                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$                     | £                        | 4.198                            | 51                                 | 51                                                   | 0,15                      |
|            | 07.2025               |                        | KRW                      | 116.558                          | 1                                  | 1                                                    | 0,00                      |
| UAG        | 08.2025               | CAD                    | £                        | 68                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$                     | TWD                      | 1.718                            | 4                                  | 4                                                    | 0,01                      |
|            | 07.2025               | £                      | AUD                      | 123                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               |                        | CHF                      | 31                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | ILS                    | \$                       | 3                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | THB                    |                          | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 09.2025               | \$                     | MXN                      | 671                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | £ 163                            | £ (344)                            | £ (181)                                              | (0,54)                    |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

£ (134) (0,40)

| BESCHREIBUNG                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>SONSTIGE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE</b> |                |                          |                                   |
| Credit Suisse AG AT1 Claim                 | \$ 1.600       | £ 140                    | 0,41                              |
| Summe Sonstige finanzielle Vermögenswerte  |                | £ 140                    | 0,41                              |
| Summe Anlagen                              |                | £ 40.120                 | 118,53                            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                |                | £ (6.272)                | (18,53)                           |
| Nettovermögen                              |                | £ 33,1                   | 100,00                            |

**ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):**

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 1.200 GBP (31. Dezember 2024: 3.830 GBP) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert       |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-----------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | £ 0                                                                         | £ 39.784                                                        | £ 200                                                        | £ 39.984        |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | 215                                                                         | (219 )                                                          | 0                                                            | (4)             |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 140                                                             | 0                                                            | 140             |
| <b>Summen</b>                       | <b>£ 215</b>                                                                | <b>£ 39.705</b>                                                 | <b>£ 200</b>                                                 | <b>£ 40.120</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>            | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert        |
|-------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------------|
| Übertragbare Wertpapiere            | £ 0                                                                         | £ 123.681                                                       | £ 268                                                        | £ 123.949        |
| Pensionsgeschäfte                   | 0                                                                           | 5.200                                                           | 0                                                            | 5.200            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup>       | (462)                                                                       | 1.412                                                           | 0                                                            | 950              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte | 0                                                                           | 160                                                             | 0                                                            | 160              |
| <b>Summen</b>                       | <b>£ (462)</b>                                                              | <b>£ 130.453</b>                                                | <b>£ 268</b>                                                 | <b>£ 130.259</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für Derivative OTC-Finanzinstrumente

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der Derivative OTC-Finanzinstrumente und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | £ (3)                               | £ 0                                   | £ (3)                               | £ 1                                 | £ 0                                   | £ 1                                 |
| BOA        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 |
| BPS        | (150)                               | 0                                     | (150)                               | 34                                  | 0                                     | 34                                  |
| BRC        | (11)                                | 0                                     | (11)                                | (20)                                | 0                                     | (20)                                |
| CBK        | (30)                                | 0                                     | (30)                                | 13                                  | 0                                     | 13                                  |
| DUB        | 3                                   | 0                                     | 3                                   | (4)                                 | 0                                     | (4)                                 |
| GLM        | (3)                                 | 0                                     | (3)                                 | (18)                                | 0                                     | (18)                                |
| JPM        | 24                                  | 0                                     | 24                                  | 48                                  | 0                                     | 48                                  |
| MBC        | 6                                   | 0                                     | 6                                   | 29                                  | 0                                     | 29                                  |
| MYI        | (31)                                | 0                                     | (31)                                | 22                                  | 0                                     | 22                                  |
| RBC        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 |
| RYL        | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 | (2)                                 | 0                                     | (2)                                 |
| SCX        | 6                                   | 0                                     | 6                                   | 128                                 | 0                                     | 128                                 |
| SOG        | 7                                   | 0                                     | 7                                   | (5)                                 | 0                                     | (5)                                 |
| SSB        | 57                                  | 0                                     | 57                                  | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (10)                                | 0                                     | (10)                                |
| UAG        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | (11)                                | 0                                     | (11)                                |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 40,74             | 58,39             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 11,48             | 15,02             |
| Pensionsgeschäfte                                                      | k. A.             | 3,08              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,40              | 0,10              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,40              | 1,15              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,27              | 0,22              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                    | 0,18              | 0,09              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 46,53             | 21,95             |
| <b>Summe Aktiva</b>                                                    | <b>100,00</b>     | <b>100,00</b>     |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                                                             | k. A.             | 0,15              |
| Österreich                                                                             | k. A.             | 0,36              |
| Belgien                                                                                | k. A.             | 0,07              |
| Brasilien                                                                              | 1,68              | 0,58              |
| Kaimaninseln                                                                           | 0,85              | 1,44              |
| Tschechische Republik                                                                  | 0,51              | k. A.             |
| Dänemark                                                                               | 1,05              | 0,96              |
| Frankreich                                                                             | 7,97              | 6,43              |
| Deutschland                                                                            | k. A.             | 0,08              |
| International                                                                          | 0,08              | k. A.             |
| Irland                                                                                 | 0,60              | 2,55              |
| Italien                                                                                | 0,51              | 0,35              |
| Japan                                                                                  | 1,13              | 0,21              |
| Jersey, Kanalinseln                                                                    | 2,93              | 3,56              |
| Luxemburg                                                                              | k. A.             | 0,32              |
| Mexiko                                                                                 | 0,82              | 0,97              |
| Niederlande                                                                            | 1,97              | 3,77              |
| Peru                                                                                   | k. A.             | 0,31              |
| Südafrika                                                                              | 0,67              | 0,47              |
| Spanien                                                                                | k. A.             | 0,68              |
| Schweiz                                                                                | k. A.             | 0,20              |
| Türkei                                                                                 | 0,02              | 0,55              |
| Großbritannien                                                                         | 58,49             | 54,07             |
| Vereinigte Staaten                                                                     | 36,92             | 29,63             |
| Kurzfristige Instrumente                                                               | 1,94              | 0,60              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | k. A.             | 4,54              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,78              | (0,38 )           |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | k. A.             | 0,07              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf                                    | (0,02 )           | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,15              | (0,01 )           |
| Zinsswaps                                                                              | (0,53 )           | 0,98              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                                                       | 0,00              | (0,01 )           |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,00              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,14              | 0,04              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,54 )           | 0,14              |
| Sonstige finanzielle Vermögenswerte                                                    | 0,41              | 0,14              |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (18,53 )          | (13,82 )          |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund

| BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                              |                |                          |                                   |                                                        |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| <b>KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG</b>                    |                |                          |                                   |                                                        |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
| Aspire Bakeries Holdings LLC                                 |                |                          |                                   | Armor Holdco, Inc.                                     |                |                          |                                   | Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.         |                |                          |                                   |
| 8,577 % fällig am 23.12.2030                                 | \$ 794         | \$ 798                   | 0,05                              | 8,500 % fällig am 15.11.2029                           | \$ 7.000       | \$ 6.715                 | 0,41                              | 3,250 % fällig am 12.11.2025                   | € 1.453        | \$ 1.694                 | 0,10                              |
| B&G Foods, Inc.                                              |                |                          |                                   | Armor RE Ltd.                                          |                |                          |                                   | Ladder Capital Finance Holdings LLLP           |                |                          |                                   |
| 7,827 % fällig am 10.10.2029                                 | 4.646          | 4.259                    | 0,26                              | 12,808 % fällig am 07.01.2032                          | 250            | 251                      | 0,02                              | 7,000 % fällig am 15.07.2031                   | \$ 2.550       | 2.668                    | 0,16                              |
| Barnes Group, Inc.                                           |                |                          |                                   | 14,558 % fällig am 07.05.2031                          | 250            | 259                      | 0,02                              | LFS Topco LLC                                  |                |                          |                                   |
| 7,077 % fällig am 27.01.2032                                 | 1.446          | 1.450                    | 0,09                              | Bayou Re Ltd.                                          |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 15.10.2026                   | 2.000          | 2.001                    | 0,12                              |
| Baush&Lomb Corp.                                             |                |                          |                                   | 22,808 % fällig am 30.04.2031                          | 250            | 269                      | 0,02                              | Longleaf Pine Re Ltd.                          |                |                          |                                   |
| TBD % fällig am 18.12.2030                                   | 1.625          | 1.630                    | 0,10                              | BNP Paribas S.A.                                       |                |                          |                                   | 21,794 % fällig am 27.05.2031                  | 250            | 258                      | 0,02                              |
| Clover Holdings SPV LLC                                      |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 14.08.2028                           | 1.500          | 1.590                    | 0,10                              | Midcap Financial Issuer Trust                  |                |                          |                                   |
| 15,000 % fällig am 09.12.2027                                | 48             | 48                       | 0,00                              | (e)(g)                                                 |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.05.2028                   | 700            | 694                      | 0,04                              |
| Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.                        |                |                          |                                   | Bread Financial Holdings, Inc.                         |                |                          |                                   | MPT Operating Partnership LP                   |                |                          |                                   |
| 1,625 % - 7,577 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am 15.06.2035                           | 550            | 554                      | 0,03                              | 8,500 % fällig am 15.02.2032                   | 1.750          | 1.833                    | 0,11                              |
| 01.04.2032                                                   | 36             | 36                       | 0,00                              | Burford Capital Global Finance LLC                     |                |                          |                                   | Nationstar Mortgage Holdings, Inc.             |                |                          |                                   |
| 1,625 % - 7,577 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 01.07.2031 (i)                       | 6.250          | 6.586                    | 0,40                              | 5,125 % fällig am 15.12.2030                   | 5.000          | 5.085                    | 0,31                              |
| 01.04.2032                                                   | 2.039          | 2.034                    | 0,12                              | Cape Lookout Re Ltd.                                   |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.11.2031                   | 1.000          | 1.016                    | 0,06                              |
| Cotiviti Corp.                                               |                |                          |                                   | 11,194 % fällig am 13.03.2032                          | 250            | 251                      | 0,02                              | 6,500 % fällig am 01.08.2029                   | 3.400          | 3.475                    | 0,21                              |
| 7,074 % fällig am 01.05.2031                                 | 6.444          | 6.422                    | 0,39                              | Clue Opco LLC                                          |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 01.02.2032                   | 1.075          | 1.117                    | 0,07                              |
| DirecTV Financing LLC                                        |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 15.10.2031                           | 1.475          | 1.565                    | 0,09                              | Navient Corp.                                  |                |                          |                                   |
| 9,791 % fällig am 02.08.2029                                 | 936            | 931                      | 0,06                              | Coinbase Global, Inc.                                  |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.03.2027                   | 625            | 623                      | 0,04                              |
| Forward Air Corp.                                            |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 01.10.2028                           | 2.154          | 2.021                    | 0,12                              | 5,500 % fällig am 15.03.2029                   | 1.700          | 1.666                    | 0,10                              |
| 8,780 % fällig am 19.12.2030                                 | 125            | 124                      | 0,01                              | 3,625 % fällig am 01.10.2031                           | 150            | 134                      | 0,01                              | 6,750 % fällig am 15.06.2026                   | 1.225          | 1.241                    | 0,08                              |
| GFL Environmental, Inc.                                      |                |                          |                                   | Credit Acceptance Corp.                                |                |                          |                                   | Newmark Group, Inc.                            |                |                          |                                   |
| 6,824 % fällig am 03.03.2032                                 | 725            | 726                      | 0,04                              | 6,625 % fällig am 15.03.2030                           | 400            | 406                      | 0,02                              | 7,500 % fällig am 12.01.2029                   | 7.525          | 7.966                    | 0,48                              |
| Global Medical Response, Inc. (9,079 % bar oder 0,750 % PIK) |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 15.12.2028                           | 1.300          | 1.378                    | 0,08                              | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                |                |                          |                                   |
| 0,750 % - 9,079 % fällig am                                  |                |                          |                                   | Diversified Healthcare Trust                           |                |                          |                                   | 1,850 % fällig am 16.09.2026                   | 225            | 215                      | 0,01                              |
| 31.10.2028 (b)                                               | 2.417          | 2.424                    | 0,15                              | 0,000 % fällig am 15.01.2026 (d)                       | 1.027          | 997                      | 0,06                              | 5,300 % fällig am 13.09.2027                   | 200            | 197                      | 0,01                              |
| Gray Television, Inc.                                        |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 01.03.2031                           | 975            | 824                      | 0,05                              | 6,950 % fällig am 15.09.2026                   | 925            | 936                      | 0,06                              |
| 7,439 % fällig am 01.12.2028                                 | 1.351          | 1.312                    | 0,08                              | Encore Capital Group, Inc.                             |                |                          |                                   | 7,050 % fällig am 15.09.2028                   | 1.425          | 1.457                    | 0,09                              |
| 9,574 % fällig am 04.06.2029                                 | 862            | 863                      | 0,05                              | 8,500 % fällig am 15.05.2030                           | 4.125          | 4.428                    | 0,27                              | OneMain Finance Corp.                          |                |                          |                                   |
| Jane Street Group LLC                                        |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 16.02.2028                           | 1.825          | 1.943                    | 0,12                              | 3,500 % fällig am 15.01.2027                   | 4.650          | 4.555                    | 0,28                              |
| 6,333 % fällig am 15.12.2031                                 | 492            | 492                      | 0,03                              | Everglades Re Ltd.                                     |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.09.2030                   | 4.000          | 3.694                    | 0,22                              |
| LC Ahab U.S. Didco LLC                                       |                |                          |                                   | 14,794 % fällig am 13.05.2031                          | 300            | 313                      | 0,02                              | 5,375 % fällig am 15.11.2029                   | 3.000          | 2.953                    | 0,18                              |
| 7,327 % fällig am 01.05.2031                                 | 348            | 348                      | 0,02                              | 15,794 % fällig am 13.05.2031                          | 300            | 312                      | 0,02                              | 6,625 % fällig am 15.01.2028                   | 1.575          | 1.628                    | 0,10                              |
| LifePoint Health, Inc.                                       |                |                          |                                   | 17,044 % fällig am 13.05.2031                          | 250            | 259                      | 0,02                              | 6,625 % fällig am 15.05.2029                   | 2.450          | 2.519                    | 0,15                              |
| 8,006 % fällig am 19.05.2031                                 | 2.276          | 2.255                    | 0,14                              | Ford Motor Credit Co. LLC                              |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 15.11.2031 (i)               | 1.600          | 1.666                    | 0,10                              |
| Sotera Health Holdings LLC                                   |                |                          |                                   | 2,900 % fällig am 09.01.2027                           | 125            | 117                      | 0,01                              | 7,500 % fällig am 15.05.2031                   | 2.100          | 2.196                    | 0,13                              |
| 7,546 % fällig am 30.05.2031                                 | 893            | 898                      | 0,05                              | 3,815 % fällig am 02.11.2027                           | 25             | 24                       | 0,00                              | 9,000 % fällig am 15.01.2029 (i)               | 750            | 787                      | 0,05                              |
| Stepstone Group Midco GmbH                                   |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 17.08.2027                           | 50             | 49                       | 0,00                              | Orange Capital RE DAC                          |                |                          |                                   |
| 8,608 % - 8,651 % fällig am                                  |                |                          |                                   | 4,271 % fällig am 09.01.2027                           | 150            | 148                      | 0,01                              | 8,323 % fällig am 17.01.2029                   | € 250          | 293                      | 0,02                              |
| 19.12.2031                                                   | 6.425          | 6.248                    | 0,38                              | 5,918 % fällig am 20.03.2028                           | 425            | 429                      | 0,03                              | Oxford Finance LLC                             |                |                          |                                   |
| Syniverse Holdings, Inc.                                     |                |                          |                                   | 6,798 % fällig am 07.11.2028                           | 150            | 156                      | 0,01                              | 6,375 % fällig am 01.02.2027                   | \$ 2.800       | 2.817                    | 0,17                              |
| 11,296 % fällig am 13.05.2027                                | 795            | 757                      | 0,05                              | 6,800 % fällig am 12.05.2028                           | 450            | 465                      | 0,03                              | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC |                |                          |                                   |
| TransDigm, Inc.                                              |                |                          |                                   | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC |                |                          |                                   | 0,000 % fällig am 05.04.2032 (d)               | 1.650          | 1.174                    | 0,07                              |
| 6,796 % fällig am 28.02.2031                                 | 12.807         | 12.844                   | 0,78                              | 7,000 % fällig am 01.05.2031                           | 4.725          | 4.896                    | 0,30                              | Panther Escrow Issuer LLC                      |                |                          |                                   |
| 6,796 % fällig am 19.01.2032                                 | 1.482          | 1.486                    | 0,09                              | Freedom Mortgage Corp.                                 |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 01.06.2031                   | 5.725          | 5.951                    | 0,36                              |
| Truist Insurance Holdings LLC                                |                |                          |                                   | 12,000 % fällig am 01.10.2028                          | 7.225          | 7.775                    | 0,47                              | Park Intermediate Holdings LLC                 |                |                          |                                   |
| 7,046 % fällig am 06.05.2031                                 | 644            | 645                      | 0,04                              | Freedom Mortgage Holdings LLC                          |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 01.10.2028                   | 400            | 400                      | 0,02                              |
| Twitter, Inc.                                                |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am 01.04.2032                           | 225            | 228                      | 0,01                              | Pebblebrook Hotel LP                           |                |                          |                                   |
| 10,927 % fällig am 26.10.2029                                | 4.179          | 4.088                    | 0,25                              | 9,125 % fällig am 15.05.2031                           | 3.200          | 3.303                    | 0,20                              | 6,375 % fällig am 15.10.2029                   | 2.100          | 2.113                    | 0,13                              |
| U.S. Renal Care, Inc.                                        |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 01.02.2029                           | 1.425          | 1.481                    | 0,09                              | PennyMac Financial Services, Inc.              |                |                          |                                   |
| 9,441 % fällig am 20.06.2028                                 | 2.761          | 2.621                    | 0,16                              | GGAM Finance Ltd.                                      |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.09.2031 (i)               | 700            | 687                      | 0,04                              |
| UKG, Inc.                                                    |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.04.2029                           | 2.100          | 2.176                    | 0,13                              | 6,875 % fällig am 15.05.2032                   | 2.575          | 2.635                    | 0,16                              |
| 7,311 % fällig am 10.02.2031                                 | 2.562          | 2.575                    | 0,16                              | Global Atlantic Fin Co.                                |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.02.2033                   | 1.350          | 1.385                    | 0,08                              |
| Virgin Media Bristol LLC                                     |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 15.10.2051                           | 1.200          | 1.178                    | 0,07                              | 7,125 % fällig am 15.11.2030                   | 3.675          | 3.811                    | 0,23                              |
| 7,587 % fällig am 31.03.2031                                 | 2.585          | 2.555                    | 0,15                              | Greystar Real Estate Partners LLC                      |                |                          |                                   | PRA Group, Inc.                                |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 7,750 % fällig am 01.09.2030                           | 1.100          | 1.168                    | 0,07                              | 8,875 % fällig am 31.01.2030 (i)               | 1.325          | 1.367                    | 0,08                              |
|                                                              |                |                          |                                   | HUB International Ltd.                                 |                |                          |                                   | Purple Re Ltd.                                 |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 15.06.2030                           | 6.600          | 6.902                    | 0,42                              | 13,294 % fällig am 06.06.2031                  | 300            | 307                      | 0,02                              |
|                                                              |                |                          |                                   | Hudson Pacific Properties LP                           |                |                          |                                   | Quercus Re DAC                                 |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,950 % fällig am 15.02.2028                           | 2.075          | 2.025                    | 0,12                              | 10,176 % fällig am 06.01.2031                  | € 250          | 301                      | 0,02                              |
|                                                              |                |                          |                                   | Icahn Enterprises LP                                   |                |                          |                                   | RFNA LP                                        |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.05.2027 (i)                       | 250            | 242                      | 0,01                              | 7,875 % fällig am 15.02.2030                   | \$ 3.000       | 3.072                    | 0,19                              |
|                                                              |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 15.05.2026                           | 1.840          | 1.828                    | 0,11                              | RHP Hotel Properties LP                        |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 10,000 % fällig am 15.11.2029                          | 1.975          | 1.958                    | 0,12                              | 6,500 % fällig am 01.04.2032 (i)               | 2.550          | 2.624                    | 0,16                              |
|                                                              |                |                          |                                   | Intesa Sanpaolo SpA                                    |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.06.2033                   | 450            | 463                      | 0,03                              |
|                                                              |                |                          |                                   | 4,198 % fällig am 01.06.2032                           | 3.150          | 2.899                    | 0,18                              | RLJ Lodging Trust LP                           |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 7,700 % fällig am 17.09.2025                           | 2.000          | 2.009                    | 0,12                              | 3,750 % fällig am 01.07.2026                   | 325            | 322                      | 0,02                              |
|                                                              |                |                          |                                   | (e)(g)                                                 |                |                          |                                   | 4,000 % fällig am 15.09.2029 (i)               | 2.025          | 1.891                    | 0,11                              |
|                                                              |                |                          |                                   | 9,125 % fällig am 07.09.2029                           | 2.500          | 3.406                    | 0,21                              | Rocket Cos., Inc.                              |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | (e)(g)                                                 |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 01.08.2030                   | 5.725          | 5.838                    | 0,35                              |
|                                                              |                |                          |                                   | Iron Mountain, Inc.                                    |                |                          |                                   | SBA Communications Corp.                       |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.02.2031                           | \$ 700         | 668                      | 0,04                              | 3,125 % fällig am 01.02.2029 (i)               | 600            | 567                      | 0,03                              |
|                                                              |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 15.09.2027                           | 6.176          | 6.145                    | 0,37                              | SLM Corp.                                      |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.07.2030                           | 300            | 296                      | 0,02                              | 6,500 % fällig am 31.01.2030                   | 2.350          | 2.468                    | 0,15                              |
|                                                              |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 15.01.2033                           | 1.700          | 1.749                    | 0,11                              | Starwood Property Trust, Inc.                  |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | Jane Street Group                                      |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.01.2027                   | 200            | 198                      | 0,01                              |
|                                                              |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 01.05.2033                           | 3.100          | 3.189                    | 0,19                              | 6,000 % fällig am 15.04.2030                   | 575            | 582                      | 0,04                              |
|                                                              |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 30.04.2031                           | 8.100          | 8.528                    | 0,52                              |                                                |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | Jefferson Capital Holdings LLC                         |                |                          |                                   |                                                |                |                          |                                   |
|                                                              |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 15.02.2029                           | 1.400          | 1.482                    | 0,09                              |                                                |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                           | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 6,500 % fällig am 01.07.2030                     | \$ 1.350       | \$ 1.395                 | 0,08                              | ams-OSRAM AG                           |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 01.05.2032 (i)      | \$ 3.150       | \$ 2.935                 | 0,18                              |
| 6,500 % fällig am 15.10.2030                     | 950            | 983                      | 0,06                              | 12,250 % fällig am 30.03.2029          | \$ 500         | \$ 534                   | 0,03                              | 4,750 % fällig am 01.03.2030          | 4.000          | 3.878                    | 0,24                              |
| Stonex Escrow Issuer LLC                         |                |                          |                                   | API Group DE, Inc.                     |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 01.02.2032          | 3.700          | 3.512                    | 0,21                              |
| 6,875 % fällig am 15.07.2032 (a)                 | 1.125          | 1.137                    | 0,07                              | 4,750 % fällig am 15.10.2029           | 4.000          | 3.942                    | 0,24                              | 5,000 % fällig am 01.02.2028          | 5.000          | 4.957                    | 0,30                              |
| TKC Holdings, Inc.                               |                |                          |                                   | Aramark Services, Inc.                 |                |                          |                                   | 5,125 % fällig am 01.05.2027          | 1.225          | 1.222                    | 0,07                              |
| 10,500 % fällig am 15.05.2029                    | 975            | 1.003                    | 0,06                              | 5,000 % fällig am 01.02.2028           | 950            | 947                      | 0,06                              | 5,375 % fällig am 01.06.2029          | 8.475          | 8.450                    | 0,51                              |
| Torrey Pines Re Ltd.                             |                |                          |                                   | Arches Buyer, Inc.                     |                |                          |                                   | Celanese U.S. Holdings LLC            |                |                          |                                   |
| 10,308 % fällig am 07.06.2032                    | 250            | 258                      | 0,02                              | 4,250 % fällig am 01.06.2028           | 450            | 431                      | 0,03                              | 6,500 % fällig am 15.04.2030 (i)      | 2.700          | 2.766                    | 0,17                              |
| 11,558 % fällig am 07.06.2032                    | 250            | 261                      | 0,02                              | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC |                |                          |                                   | 6,629 % fällig am 15.07.2032 (i)      | 1.850          | 1.941                    | 0,12                              |
| UBS Group AG                                     |                |                          |                                   | 3,250 % fällig am 01.09.2028           | 2.500          | 2.364                    | 0,14                              | Central Parent LLC                    |                |                          |                                   |
| 9,250 % fällig am 13.11.2028                     |                |                          |                                   | Aris Water Holdings LLC                |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 15.06.2029          | 1.200          | 993                      | 0,06                              |
| (e)(g)                                           | 300            | 328                      | 0,02                              | 7,250 % fällig am 01.04.2030           | 2.550          | 2.633                    | 0,16                              | Central Parent, Inc.                  |                |                          |                                   |
| UniCredit SpA                                    |                |                          |                                   | Aston Martin Capital Holdings Ltd.     |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 15.06.2029          | 225            | 184                      | 0,01                              |
| 5,459 % fällig am 30.06.2035                     | 4.600          | 4.576                    | 0,28                              | Athenahealth Group, Inc.               |                |                          |                                   | Century Communities, Inc.             |                |                          |                                   |
| Uniti Group LP                                   |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 15.02.2030 (i)       | 5.275          | 5.197                    | 0,32                              | 3,875 % fällig am 15.08.2029          | 225            | 209                      | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 15.02.2029                     | 1.325          | 1.282                    | 0,08                              | Avis Budget Car Rental LLC             |                |                          |                                   | Cordia Finanz GmbH                    |                |                          |                                   |
| 8,625 % fällig am 15.06.2032                     | 1.625          | 1.643                    | 0,10                              | 5,375 % fällig am 01.03.2029           | 900            | 868                      | 0,05                              | 9,375 % fällig am 03.10.2031          | 6.950          | 7.221                    | 0,44                              |
| Ursa Re Ltd.                                     |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.07.2027           | 369            | 367                      | 0,02                              | Cheplapharm Arzneimittel GmbH         |                |                          |                                   |
| 11,794 % fällig am 22.02.2028                    | 250            | 252                      | 0,02                              | Axalta Coating Systems LLC             |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.01.2028          | 2.800          | 2.708                    | 0,16                              |
| USI, Inc.                                        |                |                          |                                   | 3,375 % fällig am 15.02.2029           | 2.100          | 1.991                    | 0,12                              | Chobani LLC                           |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 15.01.2032                     | 600            | 634                      | 0,04                              | Axon Enterprise, Inc.                  |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 15.11.2028          | 2.000          | 1.965                    | 0,12                              |
| VFH Parent LLC                                   |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 15.03.2030           | 2.080          | 2.144                    | 0,13                              | 7,625 % fällig am 01.07.2029          | 2.700          | 2.817                    | 0,17                              |
| 7,500 % fällig am 15.06.2031                     | 1.500          | 1.575                    | 0,10                              | 6,250 % fällig am 15.03.2033           | 800            | 826                      | 0,05                              | Churchill Downs, Inc.                 |                |                          |                                   |
| Voyager Aviation Holdings LLC                    |                |                          |                                   | B&G Foods, Inc.                        |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.01.2028          | 5.700          | 5.630                    | 0,34                              |
| 8,500 % fällig am 09.05.2026^                    | 811            | 0                        | 0,00                              | 8,000 % fällig am 15.09.2028 (i)       | 125            | 121                      | 0,01                              | 5,500 % fällig am 01.04.2027          | 700            | 699                      | 0,04                              |
|                                                  |                | 227.279                  | 13,80                             | B.C. Ltd.                              |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 01.04.2030          | 1.400          | 1.405                    | 0,09                              |
| <b>INDUSTRIEWERTE</b>                            |                |                          |                                   | 10,000 % fällig am 15.04.2032          | 10.025         | 10.120                   | 0,61                              | 6,750 % fällig am 01.05.2031 (i)      | 800            | 823                      | 0,05                              |
| 180 Medical, Inc.                                |                |                          |                                   | B.C. Unlimited Liability Co.           |                |                          |                                   | Cinemark USA, Inc.                    |                |                          |                                   |
| 3,875 % fällig am 15.10.2029 (i)                 | 1.000          | 952                      | 0,06                              | 3,500 % fällig am 15.02.2029           | 5.150          | 4.909                    | 0,30                              | 5,250 % fällig am 15.07.2028 (i)      | 525            | 523                      | 0,03                              |
| 24 Hour Fitness Worldwide, Inc.                  |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.01.2028           | 4.000          | 3.900                    | 0,24                              | Clarios Global LP                     |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 01.06.2022 ^                   | 9.500          | 24                       | 0,00                              | 4,000 % fällig am 15.10.2030           | 8.575          | 8.000                    | 0,49                              | 6,750 % fällig am 15.02.2030          | 225            | 234                      | 0,01                              |
| Acushnet Co.                                     |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.01.2028           | 2.000          | 1.963                    | 0,12                              | Clarivate Science Holdings Corp.      |                |                          |                                   |
| 7,375 % fällig am 15.10.2028                     | 425            | 444                      | 0,03                              | Ball Corp.                             |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 01.07.2029 (i)      | 8.000          | 7.541                    | 0,46                              |
| ADT Security Corp.                               |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 15.08.2030           | 6.800          | 6.136                    | 0,37                              | Cleveland-Cliffs, Inc.                |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 15.07.2032 (i)                 | 3.200          | 3.074                    | 0,19                              | Bausch & Lomb Corp.                    |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 01.06.2027          | 950            | 950                      | 0,06                              |
| Advance Auto Parts, Inc.                         |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am 01.10.2028           | 4.225          | 4.415                    | 0,27                              | 6,875 % fällig am 01.11.2029          | 3.125          | 3.079                    | 0,19                              |
| 3,500 % fällig am 15.03.2032 (i)                 | 2.600          | 2.279                    | 0,14                              | Bausch Health Cos., Inc.               |                |                          |                                   | Cloud Software Group, Inc.            |                |                          |                                   |
| 3,900 % fällig am 15.04.2030                     | 225            | 211                      | 0,01                              | 4,875 % fällig am 01.06.2028           | 1.000          | 844                      | 0,05                              | 6,500 % fällig am 31.03.2029          | 5.225          | 5.277                    | 0,32                              |
| Advantage Sales & Marketing, Inc.                |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 30.05.2029           | 950            | 680                      | 0,04                              | 8,250 % fällig am 30.06.2032          | 1.200          | 1.278                    | 0,08                              |
| 6,500 % fällig am 15.11.2028 (i)                 | 1.725          | 1.346                    | 0,08                              | 11,000 % fällig am 30.09.2028          | 900            | 892                      | 0,05                              | 9,000 % fällig am 30.09.2029          | 3.775          | 3.916                    | 0,24                              |
| Affinity Interactive                             |                |                          |                                   | Beach Acquisition Bidco LLC            |                |                          |                                   | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. |                |                          |                                   |
| 6,875 % fällig am 15.12.2027                     | 1.000          | 614                      | 0,04                              | 10,000 % fällig am 15.07.2033 (a)      | 4.475          | 4.650                    | 0,28                              | 6,750 % fällig am 15.04.2032          | 4.225          | 4.339                    | 0,26                              |
| Ahead DB Holdings LLC                            |                |                          |                                   | Beacon Mobility Corp.                  |                |                          |                                   | 6,875 % fällig am 15.01.2030          | 2.000          | 2.047                    | 0,12                              |
| 6,625 % fällig am 01.05.2028                     | 4.600          | 4.617                    | 0,28                              | 7,250 % fällig am 01.08.2030 (a)       | 3.825          | 3.908                    | 0,24                              | 8,750 % fällig am 15.04.2030          | 4.800          | 4.913                    | 0,30                              |
| Ahlstrom Holding Oy                              |                |                          |                                   | Block, Inc.                            |                |                          |                                   | Cogent Communications Group LLC       |                |                          |                                   |
| 4,875 % fällig am 04.02.2028                     | 4.000          | 3.820                    | 0,23                              | 2,750 % fällig am 01.06.2026           | 2.075          | 2.033                    | 0,12                              | 6,500 % fällig am 01.07.2032          | 4.225          | 4.166                    | 0,25                              |
| Albertsons Cos., Inc.                            |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.06.2031 (i)       | 6.325          | 5.807                    | 0,35                              | CommScope LLC                         |                |                          |                                   |
| 3,500 % fällig am 15.03.2029 (i)                 | 1.675          | 1.589                    | 0,10                              | 6,500 % fällig am 15.05.2032           | 4.875          | 5.033                    | 0,31                              | 4,750 % fällig am 01.09.2029 (i)      | 1.864          | 1.822                    | 0,11                              |
| 4,875 % fällig am 15.02.2030                     | 3.175          | 3.124                    | 0,19                              | Bombardier, Inc.                       |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 01.07.2028 (i)      | 1.200          | 1.180                    | 0,07                              |
| 5,875 % fällig am 15.02.2028                     | 1.575          | 1.575                    | 0,10                              | 6,750 % fällig am 15.06.2033           | 4.000          | 4.150                    | 0,25                              | CommScope Technologies LLC            |                |                          |                                   |
| 6,250 % fällig am 15.03.2033                     | 925            | 954                      | 0,06                              | Boyne USA, Inc.                        |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.03.2027          | 875            | 853                      | 0,05                              |
| Albion Financing 1 SARL                          |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.05.2029           | 2.500          | 2.427                    | 0,15                              | Community Health Systems, Inc.        |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 21.05.2030                     | 8.725          | 8.926                    | 0,54                              | Buckeye Partners LP                    |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.02.2031 (i)      | 5.000          | 4.279                    | 0,26                              |
| Allied Universal Holdco LLC                      |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 01.02.2030           | 1.050          | 1.091                    | 0,07                              | 5,250 % fällig am 15.05.2030          | 3.650          | 3.240                    | 0,20                              |
| 7,875 % fällig am 15.02.2031                     | 4.600          | 4.810                    | 0,29                              | Builders FirstSource, Inc.             |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 15.03.2027          | 9.000          | 8.870                    | 0,54                              |
| Altice France S.A.                               |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 01.02.2032           | 1.775          | 1.646                    | 0,10                              | 6,000 % fällig am 15.01.2029          | 1.625          | 1.564                    | 0,09                              |
| 3,375 % fällig am 15.01.2028                     | € 1.100        | 1.084                    | 0,07                              | 5,000 % fällig am 01.03.2030           | 5.000          | 4.912                    | 0,30                              | 10,875 % fällig am 15.01.2032         | 3.450          | 3.661                    | 0,22                              |
| 5,125 % fällig am 15.01.2029                     | \$ 3.000       | 2.481                    | 0,15                              | 6,750 % fällig am 15.05.2035 (i)       | 2.125          | 2.191                    | 0,13                              | Connect Finco SARL                    |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 15.07.2029                     | 5.861          | 4.850                    | 0,29                              | Cablevision Lightpath LLC              |                |                          |                                   | 9,000 % fällig am 15.09.2029 (i)      | 2.875          | 2.893                    | 0,18                              |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028                     | 12.000         | 10.110                   | 0,61                              | 3,875 % fällig am 15.09.2027           | 604            | 583                      | 0,04                              | Consolidated Communications, Inc.     |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 15.10.2029                     | 2.000          | 1.660                    | 0,10                              | CACI International, Inc.               |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.10.2028          | 2.000          | 2.022                    | 0,12                              |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027                     | 5.000          | 4.504                    | 0,27                              | 6,375 % fällig am 15.06.2033           | 1.225          | 1.266                    | 0,08                              | CoreWeave, Inc.                       |                |                          |                                   |
| 11,500 % fällig am 01.02.2027 (h)                | € 800          | 910                      | 0,06                              | Capstone Borrower, Inc.                |                |                          |                                   | 9,250 % fällig am 01.06.2030          | 2.900          | 2.967                    | 0,18                              |
| Alumina Pty. Ltd.                                |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 15.06.2030           | 575            | 599                      | 0,04                              | CQP Holdco LP                         |                |                          |                                   |
| 6,125 % fällig am 15.03.2030                     | \$ 2.750       | 2.793                    | 0,17                              | Carnival Corp.                         |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.06.2031          | 8.050          | 7.958                    | 0,48                              |
| AMC Networks, Inc.                               |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 15.03.2030 (i)       | 7.075          | 7.199                    | 0,44                              | Crocs, Inc.                           |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 15.02.2029 (i)                 | 6.600          | 5.294                    | 0,32                              | 5,875 % fällig am 15.06.2031           | 1.600          | 1.631                    | 0,10                              | 4,250 % fällig am 15.03.2029          | 900            | 859                      | 0,05                              |
| 10,250 % fällig am 15.01.2029 (i)                | 1.200          | 1.245                    | 0,08                              | Carnival PLC                           |                |                          |                                   | Crowdstrike Holdings, Inc.            |                |                          |                                   |
| Amer Sports Co.                                  |                |                          |                                   | 1,000 % fällig am 28.10.2029           | € 5.000        | 5.300                    | 0,32                              | 3,000 % fällig am 15.02.2029          | 1.800          | 1.704                    | 0,10                              |
| 6,750 % fällig am 16.02.2031 (i)                 | 1.375          | 1.433                    | 0,09                              | Carvana Co. (12,000 % PIK)             | \$ 2.323       | 2.385                    | 0,14                              | Crown Americas LLC                    |                |                          |                                   |
| American Airlines, Inc.                          |                |                          |                                   | 12,000 % fällig am 01.12.2028 (b)      | 4.228          | 4.449                    | 0,27                              | 5,875 % fällig am 01.06.2033          | 1.475          | 1.486                    | 0,09                              |
| 5,500 % fällig am 20.04.2026                     | 2.233          | 2.230                    | 0,14                              | Carvana Co. (13,000 % PIK)             |                |                          |                                   | CSC Holdings LLC                      |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 20.04.2029                     | 9.725          | 9.723                    | 0,59                              | 13,000 % fällig am 01.06.2030 (b)      | 1.625          | 1.550                    | 0,09                              | 3,375 % fällig am 15.02.2031          | 1.300          | 902                      | 0,05                              |
| American Builders & Contractors Supply Co., Inc. |                |                          |                                   | CCO Holdings LLC                       |                |                          |                                   | 4,125 % fällig am 01.12.2030          | 1.625          | 1.148                    | 0,07                              |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029                     | 2.800          | 2.651                    | 0,16                              | 4,500 % fällig am 15.08.2030 (i)       |                |                          |                                   | 4,500 % fällig am 15.11.2031          | 2.000          | 1.409                    | 0,09                              |
| 4,000 % fällig am 15.01.2028                     | 2.400          | 2.349                    | 0,14                              |                                        |                |                          |                                   | 4,625 % fällig am 01.12.2030          | 3.200          | 1.491                    | 0,09                              |
|                                                  |                |                          |                                   |                                        |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.11.2031          | 800            | 374                      | 0,02                              |
|                                                  |                |                          |                                   |                                        |                |                          |                                   | 5,375 % fällig am 01.02.2028          | 3.300          | 3.024                    | 0,18                              |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,500 % fällig am 15.04.2027                  | \$ 1.450       | \$ 1.386                 | 0,08                              | Global Partners LP                                  |                |                          |                                   | Kinetik Holdings LP                             |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 15.01.2030                  | 3.200          | 1.586                    | 0,10                              | 7,125 % fällig am 01.07.2033                        | \$ 1.475       | \$ 1.497                 | 0,09                              | 6,625 % fällig am 15.12.2028                    | \$ 175         | \$ 179                   | 0,01                              |
| 6,500 % fällig am 01.02.2029                  | 150            | 122                      | 0,01                              | Go Daddy Operating Co. LLC                          |                |                          |                                   | Kodiak Gas Services LLC                         |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 01.04.2028 (i)              | 1.500          | 1.115                    | 0,07                              | 3,500 % fällig am 01.03.2029                        | 4.100          | 3.878                    | 0,24                              | 7,250 % fällig am 15.02.2029 (i)                | 900            | 932                      | 0,06                              |
| Darling Ingredients, Inc.                     |                |                          |                                   | Goat Holdco LLC                                     |                |                          |                                   | Kraken Oil & Gas Partners LLC                   |                |                          |                                   |
| 5,250 % fällig am 15.04.2027                  | 600            | 599                      | 0,04                              | 6,750 % fällig am 01.02.2032                        | 4.700          | 4.782                    | 0,29                              | 7,625 % fällig am 15.08.2029                    | 4.625          | 4.548                    | 0,28                              |
| DaVita, Inc.                                  |                |                          |                                   | goeasy Ltd.                                         |                |                          |                                   | Lamar Media Corp.                               |                |                          |                                   |
| 3,750 % fällig am 15.02.2031                  | 2.000          | 1.820                    | 0,11                              | 6,875 % fällig am 15.05.2030                        | 1.450          | 1.459                    | 0,09                              | 3,625 % fällig am 15.01.2031                    | 275            | 254                      | 0,02                              |
| 4,625 % fällig am 01.06.2030                  | 3.625          | 3.476                    | 0,21                              | 7,375 % fällig am 01.10.2030                        | 2.775          | 2.838                    | 0,17                              | Lamb Weston Holdings, Inc.                      |                |                          |                                   |
| DCLI BidCo LLC                                |                |                          |                                   | 7,625 % fällig am 15.07.2029                        | 3.000          | 3.095                    | 0,19                              | 4,125 % fällig am 31.01.2030 (i)                | 3.000          | 2.864                    | 0,17                              |
| 7,750 % fällig am 15.11.2029                  | 2.875          | 2.915                    | 0,18                              | 9,250 % fällig am 01.12.2028                        | 3.050          | 3.229                    | 0,20                              | 4,375 % fällig am 31.01.2032 (i)                | 1.000          | 940                      | 0,06                              |
| Delek Logistics Partners LP                   |                |                          |                                   | Goodyear Tire & Rubber Co.                          |                |                          |                                   | Level 3 Financing, Inc.                         |                |                          |                                   |
| 7,375 % fällig am 30.06.2033                  | 550            | 548                      | 0,03                              | 5,000 % fällig am 15.07.2029 (i)                    | 550            | 538                      | 0,03                              | 3,625 % fällig am 15.01.2029                    | 525            | 452                      | 0,03                              |
| Diamond Foreign Asset Co.                     |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 30.04.2031                        | 175            | 168                      | 0,01                              | 3,750 % fällig am 15.07.2029                    | 625            | 529                      | 0,03                              |
| 8,500 % fällig am 01.10.2030                  | 2.150          | 2.240                    | 0,14                              | 5,250 % fällig am 15.07.2031                        | 375            | 360                      | 0,02                              | 3,875 % fällig am 15.10.2030                    | 650            | 567                      | 0,03                              |
| Directv Financing LLC                         |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 30.04.2033                        | 275            | 263                      | 0,02                              | 4,000 % fällig am 15.04.2031                    | 625            | 538                      | 0,03                              |
| 5,875 % fällig am 15.08.2027                  | 5.200          | 5.186                    | 0,31                              | Graham Packaging Co., Inc.                          |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 01.07.2028                    | 675            | 622                      | 0,04                              |
| 10,000 % fällig am 15.02.2031 (i)             | 1.200          | 1.166                    | 0,07                              | 7,125 % fällig am 15.08.2028                        | 7.500          | 7.491                    | 0,45                              | 4,500 % fällig am 01.04.2030                    | 1.700          | 1.547                    | 0,09                              |
| Discovery Communications LLC                  |                |                          |                                   | Graphic Packaging International LLC                 |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 15.06.2029                    | 850            | 798                      | 0,05                              |
| 3,625 % fällig am 15.05.2030                  | 175            | 155                      | 0,01                              | 3,500 % fällig am 01.03.2029                        | 1.350          | 1.274                    | 0,08                              | 6,875 % fällig am 30.06.2033                    | 5.450          | 5.549                    | 0,34                              |
| DISH DBS Corp.                                |                |                          |                                   | Gray Media, Inc.                                    |                |                          |                                   | Levi Strauss & Co.                              |                |                          |                                   |
| 5,125 % fällig am 01.06.2029                  | 1.825          | 1.218                    | 0,07                              | 4,750 % fällig am 15.10.2030 (i)                    | 3.100          | 2.348                    | 0,14                              | 3,500 % fällig am 01.03.2031                    | 975            | 893                      | 0,05                              |
| 5,250 % fällig am 01.12.2026                  | 2.450          | 2.228                    | 0,14                              | 5,375 % fällig am 15.11.2031 (i)                    | 3.056          | 2.294                    | 0,14                              | LifePoint Health, Inc.                          |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 01.12.2028                  | 2.150          | 1.865                    | 0,11                              | 10,500 % fällig am 15.07.2029 (i)                   | 975            | 1.048                    | 0,06                              | 5,375 % fällig am 15.01.2029 (i)                | 3.425          | 3.195                    | 0,19                              |
| 7,375 % fällig am 01.07.2028                  | 1.225          | 886                      | 0,05                              | Griffon Corp.                                       |                |                          |                                   | 8,375 % fällig am 15.02.2032                    | 3.450          | 3.679                    | 0,22                              |
| 7,750 % fällig am 01.07.2026                  | 1.600          | 1.422                    | 0,09                              | 5,750 % fällig am 01.03.2028                        | 2.825          | 2.826                    | 0,17                              | 11,000 % fällig am 15.10.2030                   | 3.800          | 4.197                    | 0,25                              |
| DISH Network Corp.                            |                |                          |                                   | GYP Holdings Corp.                                  |                |                          |                                   | Light & Wonder International, Inc.              |                |                          |                                   |
| 11,750 % fällig am 15.11.2027                 | 1.150          | 1.186                    | 0,07                              | 4,625 % fällig am 01.05.2029                        | 1.525          | 1.530                    | 0,09                              | 7,250 % fällig am 15.11.2029 (i)                | 250            | 258                      | 0,02                              |
| Dye & Durham Ltd.                             |                |                          |                                   | HealthEquity, Inc.                                  |                |                          |                                   | 7,500 % fällig am 01.09.2031                    | 1.325          | 1.387                    | 0,08                              |
| 8,625 % fällig am 15.04.2029                  | 225            | 236                      | 0,01                              | 4,500 % fällig am 01.10.2029                        | 225            | 219                      | 0,01                              | Lithia Motors, Inc.                             |                |                          |                                   |
| EchoStar Corp.                                |                |                          |                                   | Helios Software Holdings, Inc.                      |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 01.06.2029                    | 175            | 167                      | 0,01                              |
| 10,750 % fällig am 30.11.2029                 | 4.675          | 4.819                    | 0,29                              | 4,625 % fällig am 01.05.2028                        | 150            | 142                      | 0,01                              | 4,625 % fällig am 15.12.2027                    | 500            | 496                      | 0,03                              |
| EchoStar Corp. (6,750 % bar oder 6,750 % PIK) |                |                          |                                   | 8,750 % fällig am 01.05.2029                        | 1.450          | 1.493                    | 0,09                              | Live Nation Entertainment, Inc.                 |                |                          |                                   |
| 6,750 % fällig am 30.11.2030 (b)              | 2.625          | 2.398                    | 0,15                              | Herc Holdings, Inc.                                 |                |                          |                                   | 3,750 % fällig am 15.01.2028                    | 975            | 946                      | 0,06                              |
| Efesto Bidco SpA Efesto U.S. LLC              |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.07.2027                        | 1.225          | 1.226                    | 0,07                              | Match Group Holdings LLC                        |                |                          |                                   |
| 7,500 % fällig am 15.02.2032                  | 3.800          | 3.851                    | 0,23                              | 7,000 % fällig am 15.06.2030                        | 2.425          | 2.534                    | 0,15                              | 4,625 % fällig am 01.06.2028                    | 2.825          | 2.759                    | 0,17                              |
| Element Solutions, Inc.                       |                |                          |                                   | 7,250 % fällig am 15.06.2033                        | 2.425          | 2.542                    | 0,15                              | 5,000 % fällig am 15.02.2027                    | 650            | 647                      | 0,04                              |
| 3,875 % fällig am 01.09.2028 (i)              | 1.200          | 1.165                    | 0,07                              | Hess Midstream Operations LP                        |                |                          |                                   | Mauser Packaging Solutions Holding Co.          |                |                          |                                   |
| Ellucian Holdings, Inc.                       |                |                          |                                   | 5,875 % fällig am 01.03.2028                        | 1.600          | 1.625                    | 0,10                              | 7,875 % fällig am 15.04.2027                    | 3.500          | 3.562                    | 0,22                              |
| 6,500 % fällig am 01.12.2029                  | 1.875          | 1.922                    | 0,12                              | Hilton Domestic Operating Co., Inc.                 |                |                          |                                   | McAfee Corp.                                    |                |                          |                                   |
| Embecka Corp.                                 |                |                          |                                   | 3,625 % fällig am 15.02.2032                        | 8.200          | 7.433                    | 0,45                              | 7,375 % fällig am 15.02.2030                    | 4.475          | 4.231                    | 0,26                              |
| 5,000 % fällig am 15.02.2030                  | 500            | 452                      | 0,03                              | 4,000 % fällig am 01.05.2031                        | 2.000          | 1.882                    | 0,11                              | McGraw-Hill Education, Inc.                     |                |                          |                                   |
| Emerald Borrower LP                           |                |                          |                                   | 6,125 % fällig am 01.04.2032                        | 200            | 205                      | 0,01                              | 5,750 % fällig am 01.08.2028                    | 200            | 201                      | 0,01                              |
| 6,750 % fällig am 15.07.2031                  | 1.725          | 1.787                    | 0,11                              | Hilton Grand Vacations Borrower LLC                 |                |                          |                                   | 7,375 % fällig am 01.09.2031                    | 3.350          | 3.497                    | 0,21                              |
| Endo Finance Holdings, Inc.                   |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 01.07.2031 (i)                    | 200            | 184                      | 0,01                              | 8,000 % fällig am 01.08.2029                    | 850            | 866                      | 0,05                              |
| 8,500 % fällig am 15.04.2031 (i)              | 775            | 821                      | 0,05                              | 5,000 % fällig am 01.06.2029                        | 1.700          | 1.636                    | 0,10                              | Medline Borrower LP                             |                |                          |                                   |
| Energizer Holdings, Inc.                      |                |                          |                                   | Hologic, Inc.                                       |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 01.04.2029                    | 10.925         | 10.487                   | 0,64                              |
| 6,500 % fällig am 31.12.2027                  | 375            | 380                      | 0,02                              | 3,250 % fällig am 15.02.2029                        | 1.000          | 954                      | 0,06                              | 5,250 % fällig am 01.10.2029 (i)                | 2.300          | 2.284                    | 0,14                              |
| EquipmentShare.com, Inc.                      |                |                          |                                   | Howard Midstream Energy Partners LLC                |                |                          |                                   | Merlin Entertainments Group U.S. Holdings, Inc. |                |                          |                                   |
| 9,000 % fällig am 15.05.2028                  | 175            | 185                      | 0,01                              | 7,375 % fällig am 15.07.2032                        | 5.900          | 6.209                    | 0,38                              | 7,375 % fällig am 15.02.2031                    | 2.900          | 2.593                    | 0,16                              |
| Excelerate Energy LP                          |                |                          |                                   | IHO Verwaltungs GmbH (7,750 % bar oder 8,500 % PIK) |                |                          |                                   | MGM Resorts International                       |                |                          |                                   |
| 8,000 % fällig am 15.05.2030 (i)              | 1.075          | 1.134                    | 0,07                              | 7,750 % fällig am 15.11.2030 (b)                    | 525            | 539                      | 0,03                              | 6,125 % fällig am 15.09.2029 (i)                | 550            | 560                      | 0,03                              |
| Fertitta Entertainment LLC                    |                |                          |                                   | IHO Verwaltungs GmbH (8,000 % bar oder 8,750 % PIK) |                |                          |                                   | Midwest Gaming Borrower LLC                     |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.01.2029                  | 2.000          | 1.917                    | 0,12                              | 8,000 % fällig am 15.11.2032 (b)                    | 275            | 281                      | 0,02                              | 4,875 % fällig am 01.05.2029                    | 3.600          | 3.470                    | 0,21                              |
| 6,750 % fällig am 15.01.2030 (i)              | 5.050          | 4.664                    | 0,28                              | Imola Merger Corp.                                  |                |                          |                                   | Mineral Resources Ltd.                          |                |                          |                                   |
| First Student Bidco, Inc.                     |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 15.05.2029                        | 2.125          | 2.053                    | 0,12                              | 9,250 % fällig am 01.10.2028                    | 1.000          | 1.025                    | 0,06                              |
| 4,000 % fällig am 31.07.2029                  | 3.100          | 2.916                    | 0,18                              | INEOS Finance PLC                                   |                |                          |                                   | Miter Brands Acquisition Holdco, Inc.           |                |                          |                                   |
| FMG Resources Pty. Ltd.                       |                |                          |                                   | 6,750 % fällig am 15.05.2028                        | 125            | 124                      | 0,01                              | 6,750 % fällig am 01.04.2032 (i)                | 1.550          | 1.591                    | 0,10                              |
| 4,375 % fällig am 01.04.2031                  | 1.375          | 1.286                    | 0,08                              | Ingevity Corp.                                      |                |                          |                                   | Molina Healthcare, Inc.                         |                |                          |                                   |
| 4,500 % fällig am 15.09.2027                  | 700            | 692                      | 0,04                              | 3,875 % fällig am 01.11.2028                        | 8.225          | 7.850                    | 0,48                              | 3,875 % fällig am 15.05.2032 (i)                | 3.025          | 2.755                    | 0,17                              |
| 5,875 % fällig am 15.04.2030                  | 1.375          | 1.393                    | 0,08                              | Insulet Corp.                                       |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.06.2028                    | 350            | 342                      | 0,02                              |
| Fortress Intermediate, Inc.                   |                |                          |                                   | 6,500 % fällig am 01.04.2033                        | 1.350          | 1.408                    | 0,09                              | 6,250 % fällig am 15.01.2033                    | 2.525          | 2.572                    | 0,16                              |
| 7,500 % fällig am 01.06.2031 (i)              | 4.625          | 4.851                    | 0,29                              | Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.              |                |                          |                                   | Motion Bondco DAC                               |                |                          |                                   |
| Frontier Communications Holdings LLC          |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 15.09.2028                        | 4.700          | 4.700                    | 0,29                              | 6,625 % fällig am 15.11.2027                    | 4.296          | 4.059                    | 0,25                              |
| 5,875 % fällig am 01.11.2029                  | 800            | 809                      | 0,05                              | Intelsat Jackson Holdings S.A.                      |                |                          |                                   | Murphy Oil USA, Inc.                            |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 15.01.2030                  | 1.200          | 1.217                    | 0,07                              | 6,500 % fällig am 15.03.2030 (i)                    | 1.824          | 1.864                    | 0,11                              | 3,750 % fällig am 15.02.2031                    | 2.375          | 2.194                    | 0,13                              |
| 6,750 % fällig am 01.05.2029                  | 1.200          | 1.217                    | 0,07                              | IQVIA, Inc.                                         |                |                          |                                   | NCL Corp. Ltd.                                  |                |                          |                                   |
| 8,625 % fällig am 15.03.2031                  | 900            | 957                      | 0,06                              | 5,000 % fällig am 15.05.2027                        | 525            | 524                      | 0,03                              | 5,875 % fällig am 15.03.2026                    | 758            | 762                      | 0,05                              |
| Gap, Inc.                                     |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.06.2032                        | 9.075          | 9.324                    | 0,57                              | 5,875 % fällig am 15.02.2027                    | 550            | 553                      | 0,03                              |
| 3,625 % fällig am 01.10.2029                  | 6.300          | 5.859                    | 0,36                              | Jazz Securities DAC                                 |                |                          |                                   | 6,250 % fällig am 01.03.2030                    | 500            | 505                      | 0,03                              |
| Garda World Security Corp.                    |                |                          |                                   | 4,375 % fällig am 15.01.2029                        | 1.000          | 967                      | 0,06                              | NCR Atleos Corp.                                |                |                          |                                   |
| 4,625 % fällig am 15.02.2027                  | 1.225          | 1.218                    | 0,07                              | JetBlue Airways Corp.                               |                |                          |                                   | 9,500 % fällig am 01.04.2029                    | 1.975          | 2.165                    | 0,13                              |
| 6,000 % fällig am 01.06.2029                  | 3.300          | 3.224                    | 0,20                              | 9,875 % fällig am 20.09.2031                        | 7.150          | 6.961                    | 0,42                              | NCR Voyix Corp.                                 |                |                          |                                   |
| GFL Environmental, Inc.                       |                |                          |                                   | Kaiser Aluminum Corp.                               |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 01.10.2028                    | 375            | 372                      | 0,02                              |
| 4,000 % fällig am 01.08.2028                  | 1.850          | 1.796                    | 0,11                              | 4,625 % fällig am 01.03.2028                        | 1.200          | 1.175                    | 0,07                              | 5,125 % fällig am 15.04.2029                    | 2.200          | 2.169                    | 0,13                              |
| 4,375 % fällig am 15.08.2029 (i)              | 2.700          | 2.624                    | 0,16                              | KBR, Inc.                                           |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 01.10.2030                    | 1.200          | 1.161                    | 0,07                              |
| Global Medical Response, Inc. (9,500 % PIK)   |                |                          |                                   | 4,750 % fällig am 30.09.2028                        | 350            | 337                      | 0,02                              | Neptune Bidco U.S., Inc.                        |                |                          |                                   |
| 9,500 % fällig am 31.10.2028 (b)              | 1.780          | 1.788                    | 0,11                              |                                                     |                |                          |                                   | 9,290 % fällig am 15.04.2029 (i)                | 3.375          | 3.289                    | 0,20                              |

| BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Newell Brands, Inc.<br>8,500 % fällig am 01.06.2028                        | \$ 3.400       | \$ 3.579                 | 0,22                              | Raising Cane's Restaurants LLC<br>9,375 % fällig am 01.05.2029 (i)                                              | \$ 1.975       | \$ 2.087                 | 0,13                              | Star Parent, Inc.<br>9,000 % fällig am 01.10.2030                          | \$ 600         | \$ 632                   | 0,04                              |
| Newfold Digital Holdings Group, Inc.<br>6,000 % fällig am 15.02.2029       | 7.950          | 4.651                    | 0,28                              | Rakuten Group, Inc.<br>8,125 % fällig am 15.12.2029 (e)                                                         | 425            | 417                      | 0,03                              | Station Casinos LLC<br>4,500 % fällig am 15.02.2028                        | 2.800          | 2.747                    | 0,17                              |
| 11,750 % fällig am 15.10.2028                                              | 25             | 19                       | 0,00                              | 9,750 % fällig am 15.04.2029                                                                                    | 2.900          | 3.185                    | 0,19                              | 4,625 % fällig am 01.12.2031                                               | 2.450          | 2.297                    | 0,14                              |
| Nexstar Media, Inc.<br>5,625 % fällig am 15.07.2027 (i)                    | 3.250          | 3.168                    | 0,19                              | 11,250 % fällig am 15.02.2027                                                                                   | 2.000          | 2.176                    | 0,13                              | 6,625 % fällig am 15.03.2032                                               | 1.825          | 1.867                    | 0,11                              |
| NFE Financing LLC<br>12,000 % fällig am 15.11.2029                         | 1.505          | 685                      | 0,04                              | Rand Parent LLC<br>8,500 % fällig am 15.02.2030                                                                 | 4.925          | 4.950                    | 0,30                              | Stonepeak Nile Parent LLC<br>7,250 % fällig am 15.03.2032                  | 2.000          | 2.121                    | 0,13                              |
| Nissan Motor Co. Ltd.<br>4,810 % fällig am 17.09.2030                      | 400            | 367                      | 0,02                              | Raven Acquisition Holdings LLC<br>6,875 % fällig am 15.11.2031                                                  | 5.600          | 5.614                    | 0,34                              | Sunoco LP<br>6,250 % fällig am 01.07.2033                                  | 3.750          | 3.815                    | 0,23                              |
| Noble Finance LLC<br>8,000 % fällig am 15.04.2030                          | 6.300          | 6.420                    | 0,39                              | ROBLOX Corp.<br>3,875 % fällig am 01.05.2030                                                                    | 375            | 354                      | 0,02                              | 7,000 % fällig am 01.05.2029                                               | 1.300          | 1.355                    | 0,08                              |
| Nordstrom, Inc.<br>4,250 % fällig am 01.08.2031 (i)                        | 850            | 755                      | 0,05                              | Rockies Express Pipeline LLC<br>4,800 % fällig am 15.05.2030                                                    | 2.000          | 1.940                    | 0,12                              | TEGNA, Inc.<br>4,625 % fällig am 15.03.2028                                | 6.200          | 6.049                    | 0,37                              |
| 5,000 % fällig am 15.01.2044                                               | 1.550          | 1.082                    | 0,07                              | 6,750 % fällig am 15.03.2033                                                                                    | 1.275          | 1.332                    | 0,08                              | 5,000 % fällig am 15.09.2029 (i)                                           | 1.000          | 956                      | 0,06                              |
| Northriver Midstream Finance LP<br>6,750 % fällig am 15.07.2032            | 2.225          | 2.306                    | 0,14                              | Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>5,625 % fällig am 30.09.2031                                                    | 1.625          | 1.636                    | 0,10                              | Teleflex, Inc.<br>4,625 % fällig am 15.11.2027                             | 1.275          | 1.263                    | 0,08                              |
| NOVA Chemicals Corp.<br>4,250 % fällig am 15.05.2029                       | 1.600          | 1.540                    | 0,09                              | RR Donnelley & Sons Co.<br>9,500 % fällig am 01.08.2029                                                         | 425            | 425                      | 0,03                              | Tenet Healthcare Corp.<br>4,250 % fällig am 01.06.2029                     | 2.000          | 1.941                    | 0,12                              |
| 7,000 % fällig am 01.12.2031                                               | 1.625          | 1.704                    | 0,10                              | Ryan Specialty LLC<br>5,875 % fällig am 01.08.2032                                                              | 625            | 630                      | 0,04                              | 4,375 % fällig am 15.01.2030                                               | 4.000          | 3.875                    | 0,24                              |
| Novelis Corp.<br>4,750 % fällig am 30.01.2030                              | 4.950          | 4.746                    | 0,29                              | Sabre GLBL, Inc.<br>8,625 % fällig am 01.06.2027                                                                | 85             | 87                       | 0,01                              | Tenneco, Inc.<br>8,000 % fällig am 17.11.2028                              | 300            | 297                      | 0,02                              |
| 6,875 % fällig am 30.01.2030                                               | 900            | 931                      | 0,06                              | 10,750 % fällig am 15.11.2029                                                                                   | 275            | 284                      | 0,02                              | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>5,750 % fällig am 01.12.2030 | 3.150          | 3.208                    | 0,19                              |
| NuStar Logistics LP<br>6,375 % fällig am 01.10.2030 (i)                    | 2.500          | 2.592                    | 0,16                              | Scientific Games Holdings LP<br>6,625 % fällig am 01.03.2030                                                    | 1.825          | 1.760                    | 0,11                              | 6,000 % fällig am 01.12.2032                                               | 4.025          | 4.114                    | 0,25                              |
| Olympus Water U.S. Holding Corp.<br>4,250 % fällig am 01.10.2028           | 3.375          | 3.212                    | 0,19                              | SCIH Salt Holdings, Inc.<br>4,875 % fällig am 01.05.2028                                                        | 2.200          | 2.145                    | 0,13                              | TGS ASA<br>8,500 % fällig am 15.01.2030                                    | 2.650          | 2.746                    | 0,17                              |
| ON Semiconductor Corp.<br>3,875 % fällig am 01.09.2028                     | 4.275          | 4.139                    | 0,25                              | Scripps Escrow, Inc.<br>3,875 % fällig am 15.01.2029                                                            | 1.450          | 1.264                    | 0,08                              | Tidewater, Inc.<br>9,125 % fällig am 15.07.2030 (a)                        | 1.500          | 1.544                    | 0,09                              |
| OneSky Flight LLC<br>8,875 % fällig am 15.12.2029                          | 300            | 313                      | 0,02                              | Seadrill Finance Ltd.<br>8,375 % fällig am 01.08.2030                                                           | 5.650          | 5.759                    | 0,35                              | TK Elevator U.S. Newco, Inc.<br>5,250 % fällig am 15.07.2027               | 2.350          | 2.350                    | 0,14                              |
| Opal Bidco S.A.S.<br>6,500 % fällig am 31.03.2032                          | 4.875          | 4.979                    | 0,30                              | Seagate HDD Cayman<br>4,091 % fällig am 01.06.2029                                                              | 350            | 336                      | 0,02                              | TopBuild Corp.<br>3,625 % fällig am 15.03.2029                             | 4.175          | 3.953                    | 0,24                              |
| Open Text Holdings, Inc.<br>4,125 % fällig am 15.02.2030                   | 3.975          | 3.761                    | 0,23                              | 4,125 % fällig am 15.01.2031                                                                                    | 2.375          | 2.185                    | 0,13                              | 4,125 % fällig am 15.02.2032                                               | 5.425          | 5.034                    | 0,31                              |
| Organon & Co.<br>4,125 % fällig am 30.04.2028                              | 5.800          | 5.582                    | 0,34                              | 5,750 % fällig am 01.12.2034                                                                                    | 1.800          | 1.783                    | 0,11                              | Toucan FinCo Ltd.<br>9,500 % fällig am 15.05.2030                          | 3.025          | 3.095                    | 0,19                              |
| 5,125 % fällig am 30.04.2031                                               | 2.700          | 2.345                    | 0,14                              | 9,625 % fällig am 01.12.2032                                                                                    | 2.000          | 2.256                    | 0,14                              | TransDigm, Inc.<br>6,000 % fällig am 15.01.2033                            | 2.250          | 2.264                    | 0,14                              |
| 6,750 % fällig am 15.05.2034                                               | 600            | 577                      | 0,03                              | Sensata Technologies BV<br>4,000 % fällig am 15.04.2029                                                         | 1.000          | 952                      | 0,06                              | Transocean, Inc.<br>8,000 % fällig am 01.02.2027                           | 2.675          | 2.637                    | 0,16                              |
| Parkland Corp.<br>4,500 % fällig am 01.10.2029                             | 925            | 890                      | 0,05                              | Service Corp. International<br>3,375 % fällig am 15.08.2030                                                     | 3.975          | 3.656                    | 0,22                              | 8,250 % fällig am 15.05.2029                                               | 200            | 185                      | 0,01                              |
| Performance Food Group, Inc.<br>4,250 % fällig am 01.08.2029               | 3.225          | 3.113                    | 0,19                              | 4,625 % fällig am 15.12.2027                                                                                    | 600            | 597                      | 0,04                              | 8,500 % fällig am 15.05.2031 (i)                                           | 1.075          | 960                      | 0,06                              |
| Perrigo Finance Unlimited Co.<br>6,125 % fällig am 30.09.2032              | 925            | 934                      | 0,06                              | Shift4 Payments LLC<br>6,750 % fällig am 15.08.2032 (i)                                                         | 1.900          | 1.974                    | 0,12                              | 8,750 % fällig am 15.02.2030 (i)                                           | 3.480          | 3.581                    | 0,22                              |
| PetSmart, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.02.2028                             | 1.700          | 1.659                    | 0,10                              | Shutterfly Finance LLC<br>8,500 % fällig am 01.10.2027                                                          | 141            | 132                      | 0,01                              | Travel & Leisure Co.<br>4,625 % fällig am 01.03.2030                       | 1.050          | 1.007                    | 0,06                              |
| Pike Corp.<br>5,500 % fällig am 01.09.2028                                 | 200            | 200                      | 0,01                              | Sigma Holdco BV<br>7,875 % fällig am 15.05.2026                                                                 | 2.366          | 2.368                    | 0,14                              | Trident TPI Holdings, Inc.<br>12,750 % fällig am 31.12.2028                | 4.300          | 4.567                    | 0,28                              |
| Post Holdings, Inc.<br>4,500 % fällig am 15.09.2031                        | 2.779          | 2.582                    | 0,16                              | Simmons Foods, Inc.<br>4,625 % fällig am 01.03.2029                                                             | 8.000          | 7.560                    | 0,46                              | TriNet Group, Inc.<br>3,500 % fällig am 01.03.2029                         | 1.375          | 1.293                    | 0,08                              |
| 4,625 % fällig am 15.04.2030                                               | 5.400          | 5.196                    | 0,32                              | Sinclair Television Group, Inc.<br>8,125 % fällig am 15.02.2033 (i)                                             | 1.700          | 1.719                    | 0,10                              | Trivium Packaging Finance BV<br>8,250 % fällig am 15.07.2030               | 2.625          | 2.778                    | 0,17                              |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029                                               | 3.300          | 3.288                    | 0,20                              | Sirius XM Radio LLC<br>3,125 % fällig am 01.09.2026                                                             | 600            | 589                      | 0,04                              | Twilio, Inc.<br>3,625 % fällig am 15.03.2029                               | 3.300          | 3.145                    | 0,19                              |
| 6,250 % fällig am 15.10.2034                                               | 1.450          | 1.462                    | 0,09                              | 3,875 % fällig am 01.09.2031 (i)                                                                                | 6.750          | 6.004                    | 0,36                              | U.S. Acute Care Solutions LLC<br>9,750 % fällig am 15.05.2029              | 1.150          | 1.188                    | 0,07                              |
| Precision Drilling Corp.<br>6,875 % fällig am 15.01.2029                   | 500            | 494                      | 0,03                              | 4,125 % fällig am 01.07.2030                                                                                    | 525            | 484                      | 0,03                              | U.S. Foods, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.02.2029                           | 7.000          | 6.884                    | 0,42                              |
| Prestige Brands, Inc.<br>3,750 % fällig am 01.04.2031                      | 50             | 46                       | 0,00                              | SK Invictus Intermediate SARL<br>5,000 % fällig am 30.10.2029                                                   | 825            | 800                      | 0,05                              | UKG, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.02.2031                                  | 1.975          | 2.050                    | 0,12                              |
| Prime Healthcare Services, Inc.<br>9,375 % fällig am 01.09.2029            | 4.825          | 4.792                    | 0,29                              | Snap, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.03.2033 (i)                                                                  | 7.200          | 7.393                    | 0,45                              | Under Armour, Inc.<br>3,250 % fällig am 15.06.2026                         | 175            | 173                      | 0,01                              |
| Prime Security Services Borrower LLC<br>3,375 % fällig am 31.08.2027       | 525            | 509                      | 0,03                              | Specialty Building Products Holdings LLC<br>7,750 % fällig am 15.10.2029                                        | 2.175          | 2.139                    | 0,13                              | Unisys Corp.<br>10,625 % fällig am 15.01.2031                              | 975            | 1.005                    | 0,06                              |
| Primo Water Holdings, Inc.<br>4,375 % fällig am 30.04.2029                 | 1.225          | 1.189                    | 0,07                              | Speedway Motorsports LLC<br>4,875 % fällig am 01.11.2027                                                        | 400            | 397                      | 0,02                              | United Rentals North America, Inc.<br>3,750 % fällig am 15.01.2032         | 2.200          | 2.022                    | 0,12                              |
| 6,250 % fällig am 01.04.2029                                               | 3.000          | 3.023                    | 0,18                              | Spirit Loyalty Cayman Ltd. (11,000 % bar oder 4,000 % PIK und 8,000 % bar)<br>11,000 % fällig am 12.03.2030 (b) | 6.306          | 4.296                    | 0,26                              | 3,875 % fällig am 15.02.2031                                               | 250            | 235                      | 0,01                              |
| Quikrete Holdings, Inc.<br>6,375 % fällig am 01.03.2032                    | 7.675          | 7.897                    | 0,48                              | SS&C Technologies, Inc.<br>6,500 % fällig am 01.06.2032                                                         | 2.725          | 2.831                    | 0,17                              | 4,875 % fällig am 15.01.2028                                               | 2.000          | 1.993                    | 0,12                              |
| 6,750 % fällig am 01.03.2033                                               | 1.050          | 1.084                    | 0,07                              | Stagwell Global LLC<br>5,625 % fällig am 15.08.2029 (i)                                                         | 3.900          | 3.735                    | 0,23                              | 6,125 % fällig am 15.03.2034                                               | 5.150          | 5.311                    | 0,32                              |
| QXO Building Products, Inc.<br>6,750 % fällig am 30.04.2032                | 4.075          | 4.208                    | 0,26                              | Standard Industries, Inc.<br>3,375 % fällig am 15.01.2031                                                       | 4.000          | 3.590                    | 0,22                              | Universal Entertainment Corp.<br>9,875 % fällig am 01.08.2029              | 450            | 440                      | 0,03                              |
| Radiology Partners, Inc.<br>8,500 % fällig am 15.07.2032                   | 1.125          | 1.129                    | 0,07                              | 4,375 % fällig am 15.07.2030                                                                                    | 2.500          | 2.369                    | 0,14                              | Univision Communications, Inc.<br>4,500 % fällig am 01.05.2029             | 3.850          | 3.504                    | 0,21                              |
| Radiology Partners, Inc. (9,781 % PIK)<br>9,781 % fällig am 15.02.2030 (b) | 996            | 980                      | 0,06                              | Staples, Inc.<br>10,750 % fällig am 01.09.2029                                                                  | 1.650          | 1.570                    | 0,10                              | 6,625 % fällig am 01.06.2027                                               | 2.300          | 2.296                    | 0,14                              |
|                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                                                 |                |                          |                                   | 8,000 % fällig am 15.08.2028                                               | 4.375          | 4.443                    | 0,27                              |
|                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                                                 |                |                          |                                   | 8,500 % fällig am 31.07.2031 (i)                                           | 600            | 601                      | 0,04                              |
|                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                                                 |                |                          |                                   | USA Compression Partners LP<br>6,875 % fällig am 01.09.2027                | 75             | 75                       | 0,00                              |
|                                                                            |                |                          |                                   |                                                                                                                 |                |                          |                                   | 7,125 % fällig am 15.03.2029                                               | 1.025          | 1.051                    | 0,06                              |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                       | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                  | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|--------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Valaris Ltd.<br>8,375 % fällig am 30.04.2030                       | \$ 7.875       | \$ 8.086                 | 0,49                              | 6,250 % fällig am 15.03.2033                                   | \$ 1.450       | \$ 1.460                 | 0,09                              | TerraForm Power Operating LLC<br>5,000 % fällig am 31.01.2028                 | \$ 2.325       | \$ 2.303                 | 0,14                              |
| Valvoline, Inc.<br>3,625 % fällig am 15.06.2031                    | 3.950          | 3.580                    | 0,22                              | 7,125 % fällig am 15.02.2031 (i)                               | 1.150          | 1.227                    | 0,07                              | Yinson Production Financial Services Pte Ltd.<br>9,625 % fällig am 03.05.2029 | 275            | 286                      | 0,02                              |
| Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>4,125 % fällig am 15.08.2031  | 3.025          | 2.802                    | 0,17                              | Yum! Brands, Inc.<br>3,625 % fällig am 15.03.2031              | 2.000          | 1.848                    | 0,11                              |                                                                               | 68.513         | 4,16                     |                                   |
| Venture Global LNG, Inc.<br>7,000 % fällig am 15.01.2030           | 8.575          | 8.676                    | 0,53                              | 4,625 % fällig am 31.01.2032                                   | 4.000          | 3.855                    | 0,23                              | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel                                        | 1.407.131      | 85,46                    |                                   |
| 8,375 % fällig am 01.06.2031                                       | 8.500          | 8.834                    | 0,54                              | 6,875 % fällig am 15.11.2037                                   | 1.000          | 1.076                    | 0,07                              |                                                                               |                |                          |                                   |
| 9,500 % fällig am 01.02.2029                                       | 3.600          | 3.924                    | 0,24                              | Zayo Group Holdings, Inc.<br>4,000 % fällig am 01.03.2027      | 1.875          | 1.760                    | 0,11                              |                                                                               |                |                          |                                   |
| Venture Global Plaquemines LNG LLC<br>7,500 % fällig am 01.05.2033 | 2.950          | 3.161                    | 0,19                              | 6,125 % fällig am 01.03.2028                                   | 1.105          | 955                      | 0,06                              |                                                                               |                |                          |                                   |
| Veritiv Operating Co.<br>10,500 % fällig am 30.11.2030             | 1.500          | 1.626                    | 0,10                              | ZF North America Capital, Inc.<br>6,750 % fällig am 23.04.2030 | 2.900          | 2.789                    | 0,17                              |                                                                               |                |                          |                                   |
| Vertiv Group Corp.<br>4,125 % fällig am 15.11.2028                 | 4.500          | 4.392                    | 0,27                              | Ziggo BV<br>4,875 % fällig am 15.01.2030                       | 5.100          | 4.769                    | 0,29                              |                                                                               |                |                          |                                   |
| VF Corp.<br>2,800 % fällig am 23.04.2027                           | 1.000          | 956                      | 0,06                              | ZipRecruiter, Inc.<br>5,000 % fällig am 15.01.2030 (i)         | 5.150          | 4.402                    | 0,27                              |                                                                               |                |                          |                                   |
| 2,950 % fällig am 23.04.2030                                       | 3.087          | 2.607                    | 0,16                              | ZoomInfo Technologies LLC<br>3,875 % fällig am 01.02.2029      | 300            | 282                      | 0,02                              |                                                                               |                |                          |                                   |
| Viavi Solutions, Inc.<br>3,750 % fällig am 01.10.2029              | 2.250          | 2.105                    | 0,13                              |                                                                |                | 1.111.339                | 67,50                             |                                                                               |                |                          |                                   |
| Viking Cruises Ltd.<br>5,875 % fällig am 15.09.2027                | 2.700          | 2.703                    | 0,16                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 7,000 % fällig am 15.02.2029                                       | 2.100          | 2.120                    | 0,13                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 9,125 % fällig am 15.07.2031                                       | 3.725          | 4.014                    | 0,24                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Virgin Media Secured Finance PLC<br>4,500 % fällig am 15.08.2030   | 5.000          | 4.650                    | 0,28                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 5,500 % fällig am 15.05.2029 (i)                                   | 4.000          | 3.937                    | 0,24                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Viridien<br>10,000 % fällig am 15.10.2030                          | 225            | 222                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| VistaJet Malta Finance PLC<br>6,375 % fällig am 01.02.2030 (i)     | 1.400          | 1.314                    | 0,08                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 7,875 % fällig am 01.05.2027                                       | 700            | 705                      | 0,04                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 9,500 % fällig am 01.06.2028                                       | 700            | 720                      | 0,04                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>4,250 % fällig am 31.01.2031 (i)       | 5.000          | 4.584                    | 0,28                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| VZ Secured Financing BV<br>5,000 % fällig am 15.01.2032            | 100            | 89                       | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Walgreen Co.<br>4,400 % fällig am 15.09.2042                       | 450            | 415                      | 0,03                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Walgreens Boots Alliance, Inc.<br>4,100 % fällig am 15.04.2050     | 400            | 348                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 4,650 % fällig am 01.06.2046                                       | 175            | 164                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 4,800 % fällig am 18.11.2044                                       | 150            | 143                      | 0,01                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 8,125 % fällig am 15.08.2029                                       | 4.125          | 4.378                    | 0,27                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Warnermedia Holdings, Inc.<br>3,755 % fällig am 15.03.2027         | 325            | 319                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 4,279 % fällig am 15.03.2032                                       | 700            | 592                      | 0,04                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 5,050 % fällig am 15.03.2042                                       | 525            | 356                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Waste Pro USA, Inc.<br>7,000 % fällig am 01.02.2033                | 950            | 989                      | 0,06                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Wayfair LLC<br>7,250 % fällig am 31.10.2029                        | 1.575          | 1.580                    | 0,10                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 7,750 % fällig am 15.09.2030                                       | 1.175          | 1.185                    | 0,07                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Weatherford International Ltd.<br>8,625 % fällig am 30.04.2030     | 1.875          | 1.934                    | 0,12                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Western Digital Corp.<br>2,850 % fällig am 01.02.2029              | 1.700          | 1.578                    | 0,10                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 3,100 % fällig am 01.02.2032                                       | 2.200          | 1.948                    | 0,12                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Whirlpool Corp.<br>6,125 % fällig am 15.06.2030                    | 275            | 278                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| White Cap Buyer LLC<br>6,875 % fällig am 15.10.2028                | 675            | 674                      | 0,04                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Williams Scotsman, Inc.<br>4,625 % fällig am 15.08.2028            | 2.525          | 2.483                    | 0,15                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| 6,625 % fällig am 15.06.2029                                       | 400            | 411                      | 0,02                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Windstream Services LLC<br>8,250 % fällig am 01.10.2031            | 6.325          | 6.629                    | 0,40                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Wyndham Hotels & Resorts, Inc.<br>4,375 % fällig am 15.08.2028     | 800            | 783                      | 0,05                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Wynn Las Vegas LLC<br>5,250 % fällig am 15.05.2027                 | 3.000          | 3.004                    | 0,18                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |
| Wynn Resorts Finance LLC<br>5,125 % fällig am 01.10.2029           | 3.000          | 2.980                    | 0,18                              |                                                                |                |                          |                                   |                                                                               |                |                          |                                   |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent              | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapital-<br>betrag | Besichert durch                                  | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensionsge-<br>schäfte, zum<br>Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------------------|--------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| DEU                     | 4,470 %         | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 69.200          | U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig am 15.05.2040 | \$ (71.312)                | \$ 69.200                           | \$ 69.209                                                           | 4,20                         |
| FICC                    | 4,400           | 30.06.2025            | 01.07.2025            | 13.900             | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027 | (14.291)                   | 13.900                              | 13.902                                                              | 0,84                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                    |                                                  | \$ (85.603)                | \$ 83.100                           | \$ 83.111                                                           | 5,04                         |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**FUTURES**

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der<br>Kontrakte | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------|-------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Euro-Bund September Futures                                    | Short | 09.2025     | 143                     | \$ 159                                          | 0,01                         |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 336                     | 270                                             | 0,02                         |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025     | 216                     | 186                                             | 0,01                         |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Long  | 09.2025     | 371                     | 757                                             | 0,05                         |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Long  | 09.2025     | 200                     | 458                                             | 0,03                         |
| U.S. Treasury Long-Term Bond September Futures                 | Long  | 09.2025     | 25                      | 70                                              | 0,00                         |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Long  | 09.2025     | 51                      | 182                                             | 0,01                         |
|                                                                |       |             |                         | \$ 2.082                                        | 0,13                         |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |             |                         | \$ 2.082                                        | 0,13                         |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)**

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Referenzeinheit    | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|--------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Telecom Italia SpA | 1,000 %                        | 20.12.2029            | € 800                          | \$ 29                                           | 0,00                         |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>**

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.HY-43 5-Year Index | 5,000 %                        | 20.12.2029            | \$ 42.175                      | \$ 441                                          | 0,03                         |
| CDX.HY-44 5-Year Index | 5,000                          | 20.06.2030            | 80.975                         | 1.030                                           | 0,06                         |
|                        |                                |                       |                                | \$ 1.471                                        | 0,09                         |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex        | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250 %            | 19.03.2032            | \$ 2.900        | \$ (85)                                         | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,250              | 18.06.2055            | 4.075           | 30                                              | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,620              | 30.11.2029            | 25.193          | (324)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2029            | 31.150          | 675                                             | 0,04                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2031            | 2.850           | 88                                              | 0,01                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 15.05.2032            | 34.206          | (381)                                           | (0,02)                       |
| Zahlung                                        | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS | 3,750              | 18.12.2033            | 6.925           | 47                                              | 0,00                         |
|                                                |                               |                    |                       |                 | \$ 50                                           | 0,00                         |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                               |                    |                       |                 | \$ 1.550                                        | 0,09                         |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnahmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Basiswertpapier erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

### DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

#### DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 12                   | \$ 14                    | \$ 0                             | \$ (1)                             | \$ (1)                                               | 0,00                      |
| BOA        | 07.2025               | \$ 34.014              | \$ 38.673                | 0                                | (1.253)                            | (1.253)                                              | (0,08)                    |
| BPS        | 07.2025               | 3                      | 3                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| DUB        | 07.2025               | \$ 39.473              | € 34.026                 | 468                              | 0                                  | 468                                                  | 0,03                      |
|            | 08.2025               | € 33.951               | \$ 39.473                | 0                                | (467)                              | (467)                                                | (0,03)                    |
| MYI        | 07.2025               | 6                      | 7                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 25                  | € 21                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | 72                     | £ 53                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| SOG        | 07.2025               | € 8                    | \$ 9                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 468                           | \$ (1.721)                         | \$ (1.253)                                           | (0,08)                    |

#### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRÄKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 101.609              | \$ 118.972               | \$ 0                             | \$ (302)                           | \$ (302)                                             | (0,02)                    |
|            | 07.2025               | \$ 99.271              | € 87.370                 | 3.288                            | 0                                  | 3.288                                                | 0,20                      |
|            | 08.2025               | 119.233                | 101.609                  | 301                              | 0                                  | 301                                                  | 0,02                      |
| BOA        | 07.2025               | 111.228                | 97.821                   | 3.600                            | 0                                  | 3.600                                                | 0,22                      |
| BPS        | 07.2025               | 428                    | 371                      | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | 118.571                | 104.358                  | 3.929                            | 0                                  | 3.929                                                | 0,24                      |
| CBK        | 07.2025               | € 634                  | \$ 733                   | 0                                | (12)                               | (12)                                                 | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 5.272               | € 4.604                  | 132                              | 0                                  | 132                                                  | 0,01                      |
| DUB        | 07.2025               | € 101.303              | \$ 117.521               | 0                                | (1.393)                            | (1.393)                                              | (0,08)                    |
|            | 08.2025               | \$ 117.521             | € 101.080                | 1.391                            | 0                                  | 1.391                                                | 0,08                      |
| MBC        | 07.2025               | € 58                   | € 67                     | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 1.912               | € 1.644                  | 18                               | 0                                  | 18                                                   | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 12.666                        | \$ (1.708)                         | \$ 10.958                                            | 0,67                      |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des Netto-<br>vermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------------------|
| AZD        | 07.2025               | £ 5.847                | \$ 8.023                 | \$ 11                            | \$ 0                               | \$ 11                                                | 0,00                      |
|            | 08.2025               | \$ 8.024               | £ 5.847                  | 0                                | (11)                               | (11)                                                 | 0,00                      |
| BOA        | 07.2025               | 10                     | 7                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                      |
| BRC        | 07.2025               | £ 6.342                | \$ 8.629                 | 0                                | (62)                               | (62)                                                 | (0,01)                    |
|            | 07.2025               | \$ 7.569               | £ 5.606                  | 113                              | 0                                  | 113                                                  | 0,01                      |
|            | 08.2025               | 8.624                  | 6.337                    | 62                               | 0                                  | 62                                                   | 0,00                      |
| CBK        | 07.2025               | 82                     | 60                       | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                      |
| JPM        | 07.2025               | 8.398                  | 6.234                    | 144                              | 0                                  | 144                                                  | 0,01                      |
| MBC        | 07.2025               | 497                    | 367                      | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                      |
| SSB        | 07.2025               | £ 6.280                | \$ 8.612                 | 5                                | 0                                  | 5                                                    | 0,00                      |
|            | 07.2025               | \$ 8.390               | £ 6.196                  | 101                              | 0                                  | 101                                                  | 0,01                      |
|            | 08.2025               | 8.613                  | 6.280                    | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                      |
|            |                       |                        |                          | \$ 443                           | \$ (78)                            | \$ 365                                               | 0,02                      |

Summe Freiverkehrsfinanzderivate

\$ 10.070 0,61

Summe Anlagen

\$ 1.736.955 105,49

Sonstige Aktiva und Passiva

\$ (90.469) (5,49)

Nettovermögen

\$ 1.646.486 100,00

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

μ Der gesamte Betrag oder ein Teil davon stellt ungedeckte Darlehenszusagen dar. Der Zinssatz für den ungedeckten Anteil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.



- (e) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.
- (f) Mit dem Fonds verbunden.
- (g) Bedingt wandelbares Wertpapier.
- (h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2024: 0,52 %):

| Emittentenbeschreibung                           | Kaufdatum  | Kosten   | Marktwert | % des Nettovermögens |
|--------------------------------------------------|------------|----------|-----------|----------------------|
| Altice France S.A. 11,500 % fällig am 01.02.2027 | 20.12.2023 | \$ 863   | \$ 910    | 0,06                 |
| Clover Holdings, Inc.                            | 09.12.2024 | 34       | 39        | 0,00                 |
| DreamWell Ltd.                                   | 24.04.2024 | 1.316    | 7         | 0,00                 |
| Serta Simmons Bedding LLC                        | 29.06.2023 | 1.317    | 0         | 0,00                 |
| Spirit Aviation Holdings, Inc. - Exp. 11.03.2035 | 17.03.2025 | 621      | 354       | 0,02                 |
|                                                  |            | \$ 4.151 | \$ 1.310  | 0,08                 |

- (i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 1.183 USD (31. Dezember 2024: null USD) als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 19.687 USD (31. Dezember 2024: 10.768 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2024: 4.680 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

#### Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 257                                                                      | \$ 1.514.942                                                    | \$ 4.781                                                     | \$ 1.519.980        |
| Investmentfonds               | 120.173                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 120.173             |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 83.100                                                          | 0                                                            | 83.100              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 159                                                                         | 13.543                                                          | 0                                                            | 13.702              |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 120.589</b>                                                           | <b>\$ 1.611.585</b>                                             | <b>\$ 4.781</b>                                              | <b>\$ 1.736.955</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert           |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|---------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 229                                                                      | \$ 1.575.231                                                    | \$ 17.683                                                    | \$ 1.593.143        |
| Investmentfonds               | 76.727                                                                      | 16.617                                                          | 0                                                            | 93.344              |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 328                                                                         | (4.989)                                                         | 0                                                            | (4.661)             |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 77.284</b>                                                            | <b>\$ 1.586.859</b>                                             | <b>\$ 17.683</b>                                             | <b>\$ 1.681.826</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

#### Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|------------|------------|------------------|------------------|--------------|------------------------------------------|----------------------|
| BOS        | 3,750 %    | 23.06.2025       | 01.08.2025       | \$ (4.402)   | \$ (4.406)                               | (0,27)               |
|            | 4,000      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (2.387)      | (2.389)                                  | (0,15)               |
|            | 4,100      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (4.049)      | (4.053)                                  | (0,25)               |
|            | 4,150      | 18.06.2025       | 01.08.2025       | (1.990)      | (1.993)                                  | (0,12)               |
|            | 4,150      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (1.016)      | (1.017)                                  | (0,06)               |
|            | 4,200      | 18.06.2025       | 01.08.2025       | (2.454)      | (2.458)                                  | (0,15)               |
|            | 4,200      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (2.139)      | (2.141)                                  | (0,13)               |
|            | 4,230      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (611)        | (611)                                    | (0,04)               |
|            | 4,240      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (809)        | (810)                                    | (0,05)               |
|            | 4,250      | 18.06.2025       | 01.08.2025       | (1.476)      | (1.478)                                  | (0,09)               |
|            | 4,250      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (24.392)     | (24.415)                                 | (1,48)               |
|            | 4,260      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (2.000)      | (2.002)                                  | (0,12)               |
|            | 4,270      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (16.910)     | (16.926)                                 | (1,03)               |
|            | 4,280      | 18.06.2025       | 01.08.2025       | (1.032)      | (1.034)                                  | (0,06)               |
|            | 4,280      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (8.733)      | (8.742)                                  | (0,53)               |
|            | 4,290      | 18.06.2025       | 01.08.2025       | (1.052)      | (1.054)                                  | (0,06)               |
|            | 4,290      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (7.522)      | (7.529)                                  | (0,46)               |
|            | 4,300      | 18.06.2025       | 01.08.2025       | (3.760)      | (3.766)                                  | (0,23)               |
|            | 4,300      | 23.06.2025       | 01.08.2025       | (6.339)      | (6.345)                                  | (0,39)               |



| Kontrahent                         | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten<br>aus Pensions-<br>geschäften | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|--------------|--------------------------------------------------|------------------------------|
| BPS                                | 4,100 %    | 30.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | \$ (476)     | \$ (478)                                         | (0,03)                       |
|                                    | 4,280      | 30.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (5.345)      | (5.365)                                          | (0,33)                       |
| BRC                                | 3,250      | 16.06.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.139)      | (1.140)                                          | (0,07)                       |
|                                    | 4,000      | 21.05.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (2.792)      | (2.805)                                          | (0,17)                       |
|                                    | 4,250      | 15.04.2025            | TBD <sup>(1)</sup>    | (1.059)      | (1.069)                                          | (0,06)                       |
| MEI                                | 1,000      | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (1.027)      | (1.027)                                          | (0,06)                       |
|                                    | 2,750      | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (907)        | (907)                                            | (0,05)                       |
|                                    | 4,000      | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (691)        | (691)                                            | (0,04)                       |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |              | \$ (106.651)                                     | (6,48)                       |

<sup>(1)</sup> Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

#### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für Derivative OTC-Finanzinstrumente

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der Derivative OTC-Finanzinstrumente und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Jun. 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 3.286                            | \$ (2.820)                            | \$ 466                              | \$ k. A.                            | \$ k. A.                              | \$ k. A.                            |
| BOA        | 2.347                               | (2.240)                               | 107                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| BPS        | 7                                   | 0                                     | 7                                   | (49)                                | 0                                     | (49)                                |
| BRC        | 4.042                               | (3.760)                               | 282                                 | (114)                               | 0                                     | (114)                               |
| CBK        | 121                                 | 0                                     | 121                                 | 40                                  | 0                                     | 40                                  |
| DUB        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | (2.308)                             | 2.050                                 | (258)                               |
| JPM        | 144                                 | 0                                     | 144                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MBC        | 23                                  | 0                                     | 23                                  | (1.163)                             | 820                                   | (343)                               |
| MYI        | 0                                   | (10)                                  | (10)                                | 3                                   | 0                                     | 3                                   |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 2                                   | 0                                     | 2                                   |
| SCX        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (2.081)                             | 1.810                                 | (271)                               |
| SSB        | 101                                 | 0                                     | 101                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 13,45             | 15,56             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 71,10             | 75,14             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 0,00              | 0,00              |
| Investmentfonds                                                        | 6,68              | 5,33              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 4,62              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,12              | 0,02              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,13              | 0,11              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,76              | 0,05              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 3,14              | 3,79              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                                                     | 3,70              | 4,98              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                                                       | 85,46             | 84,46             |
| US-Schatzobligationen                                                                  | 3,04              | 2,92              |
| Stammaktien                                                                            | 0,03              | 0,57              |
| Optionsscheine                                                                         | 0,09              | 0,00              |
| Vorzugswertpapiere                                                                     | 0,00              | 0,00              |
| Investmentfonds                                                                        | 7,30              | 5,45              |
| Pensionsgeschäfte                                                                      | 5,04              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                                    |                   |                   |
| Futures                                                                                | 0,13              | (0,02)            |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,00              | 0,02              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,09              | (0,02)            |
| Zinsswaps                                                                              | 0,00              | 0,08              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,08)            | 0,05              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 0,69              | (0,38)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (5,49)            | 1,89              |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

| BESCHREIBUNG                       | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG | PARI<br>(000\$)                     | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG   | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$)                              | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |       |        |      |
|------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|--------------|-------------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|----------------|-----------------|--------------------------------------------------------|-----------------------------------|-------|--------|------|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE           |                 |                           |                                   |              |                                     |                           |                                   |                |                 |                                                        |                                   |       |        |      |
| KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG |                 |                           |                                   |              |                                     |                           |                                   |                |                 |                                                        |                                   |       |        |      |
| Republic of Panama                 |                 |                           |                                   | Barclays PLC |                                     |                           |                                   | EPR Properties |                 |                                                        |                                   |       |        |      |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027       | €               | 800                       | \$ 946                            | 0,20         | 4,972 % fällig am 16.05.2029        | \$                        | 500                               | \$ 505         | 0,11            | 3,600 % fällig am 15.11.2031                           | \$                                | 400   | \$ 364 | 0,08 |
| Stonepeak Nile Parent LLC          |                 |                           |                                   |              | 5,304 % fällig am 09.08.2026        |                           | 400                               | 400            | 0,08            | 4,500 % fällig am 01.06.2027                           |                                   | 450   | 448    | 0,09 |
| 9,250 % fällig am 09.04.2032       | \$              | 300                       | 301                               | 0,06         | 5,690 % fällig am 12.03.2030        |                           | 1.400                             | 1.449          | 0,31            | 4,750 % fällig am 15.12.2026                           |                                   | 100   | 100    | 0,02 |
|                                    |                 |                           | 1.247                             | 0,26         | 5,851 % fällig am 21.03.2035        | £                         | 1.300                             | 1.801          | 0,38            | 4,950 % fällig am 15.04.2028                           |                                   | 500   | 499    | 0,11 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,692 % fällig am 13.09.2034        | \$                        | 300                               | 328            | 0,07            | Equitable Holdings, Inc.                               |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | BGC Group, Inc.                     |                           |                                   |                |                 | 6,700 % fällig am 28.03.2055                           |                                   | 600   | 616    | 0,13 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 4,375 % fällig am 15.12.2025        |                           | 1.100                             | 1.097          | 0,23            | Erste Group Bank AG                                    |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Blackstone Holdings Finance Co. LLC |                           |                                   |                |                 | 8,500 % fällig am 15.10.2028 (d)(f)                    | €                                 | 200   | 264    | 0,06 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 2,000 % fällig am 30.01.2032        |                           | 200                               | 168            | 0,04            | Essex Portfolio LP                                     |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Blackstone Secured Lending Fund     |                           |                                   |                |                 | 5,375 % fällig am 01.04.2035                           | \$                                | 100   | 102    | 0,02 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,875 % fällig am 15.11.2027        |                           | 500                               | 511            | 0,11            | 5,500 % fällig am 01.04.2034                           |                                   | 400   | 409    | 0,09 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Blue Owl Finance LLC                |                           |                                   |                |                 | Extra Space Storage LP                                 |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,250 % fällig am 18.04.2034        |                           | 800                               | 824            | 0,17            | 2,350 % fällig am 15.03.2032                           |                                   | 400   | 340    | 0,07 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | BNP Paribas S.A.                    |                           |                                   |                |                 | 3,875 % fällig am 15.12.2027                           |                                   | 372   | 368    | 0,08 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 1,904 % fällig am 30.09.2028        |                           | 200                               | 189            | 0,04            | F&G Global Funding                                     |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 7,375 % fällig am 11.06.2030 (d)(f) | €                         | 800                               | 1.036          | 0,22            | 5,875 % fällig am 16.01.2030                           |                                   | 100   | 103    | 0,02 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 7,375 % fällig am 10.09.2034 (d)(f) | \$                        | 200                               | 204            | 0,04            | Fairfax Financial Holdings Ltd.                        |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | BPCE S.A.                           |                           |                                   |                |                 | 2,750 % fällig am 29.03.2028                           | €                                 | 200   | 234    | 0,05 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,716 % fällig am 18.01.2030        |                           | 250                               | 257            | 0,05            | 4,625 % fällig am 29.04.2030                           | \$                                | 900   | 896    | 0,19 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,936 % fällig am 30.05.2035        |                           | 650                               | 666            | 0,14            | 4,850 % fällig am 17.04.2028                           |                                   | 100   | 101    | 0,02 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,612 % fällig am 19.10.2027        |                           | 200                               | 205            | 0,04            | Fifth Third Bancorp                                    |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 7,003 % fällig am 19.10.2034        |                           | 250                               | 275            | 0,06            | 4,772 % fällig am 28.07.2030 (g)                       |                                   | 800   | 805    | 0,17 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Brookfield Finance, Inc.            |                           |                                   |                |                 | Ford Motor Credit Co. LLC                              |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 3,500 % fällig am 30.03.2051        |                           | 400                               | 272            | 0,06            | 4,125 % fällig am 17.08.2027                           |                                   | 1.775 | 1.736  | 0,37 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 3,900 % fällig am 25.01.2028        |                           | 1.400                             | 1.384          | 0,29            | 5,125 % fällig am 05.11.2026                           |                                   | 200   | 200    | 0,04 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Brown & Brown, Inc.                 |                           |                                   |                |                 | 5,918 % fällig am 20.03.2028                           |                                   | 300   | 303    | 0,06 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,650 % fällig am 11.06.2034        |                           | 400                               | 411            | 0,09            | 7,350 % fällig am 04.11.2027                           |                                   | 355   | 369    | 0,08 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | CaixaBank S.A.                      |                           |                                   |                |                 | Fortitude Group Holdings LLC                           |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,673 % fällig am 15.03.2030        |                           | 200                               | 207            | 0,04            | 6,250 % fällig am 01.04.2030                           |                                   | 200   | 206    | 0,04 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Cantor Fitzgerald LP                |                           |                                   |                |                 | Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 7,200 % fällig am 12.12.2028        |                           | 600                               | 637            | 0,13            | 7,875 % fällig am 01.12.2030                           |                                   | 300   | 319    | 0,07 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Capital One Financial Corp.         |                           |                                   |                |                 | FS KKR Capital Corp.                                   |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,312 % fällig am 08.06.2029        |                           | 200                               | 210            | 0,04            | 6,875 % fällig am 15.08.2029                           |                                   | 200   | 205    | 0,04 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Cathaylife Singapore Pte Ltd.       |                           |                                   |                |                 | 7,875 % fällig am 15.01.2029                           |                                   | 700   | 739    | 0,16 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,950 % fällig am 05.07.2034        |                           | 200                               | 206            | 0,04            | GA Global Funding Trust                                |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | CBRE Services, Inc.                 |                           |                                   |                |                 | 5,400 % fällig am 13.01.2030                           |                                   | 400   | 411    | 0,09 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,950 % fällig am 15.08.2034        |                           | 400                               | 421            | 0,09            | Gaci First Investment Co.                              |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Charles Schwab Corp.                |                           |                                   |                |                 | 5,125 % fällig am 14.02.2053                           |                                   | 600   | 515    | 0,11 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,643 % fällig am 19.05.2029        |                           | 600                               | 622            | 0,13            | GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                             |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,196 % fällig am 17.11.2029        |                           | 1.100                             | 1.168          | 0,25            | 3,400 % fällig am 30.09.2026                           |                                   | 500   | 493    | 0,10 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | CI Financial Corp.                  |                           |                                   |                |                 | Global Atlantic Fin Co.                                |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 4,750 % fällig am 03.04.2028        | CAD                       | 500                               | 367            | 0,08            | 4,400 % fällig am 15.10.2029                           |                                   | 800   | 777    | 0,16 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,000 % fällig am 20.09.2027        |                           | 300                               | 226            | 0,05            | GLP Capital LP                                         |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 7,500 % fällig am 30.05.2029        | \$                        | 600                               | 633            | 0,13            | 3,250 % fällig am 15.01.2032                           |                                   | 700   | 617    | 0,13 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Citadel Finance LLC                 |                           |                                   |                |                 | 4,000 % fällig am 15.01.2031                           |                                   | 300   | 283    | 0,06 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,900 % fällig am 10.02.2030        |                           | 1.000                             | 1.010          | 0,21            | 5,625 % fällig am 15.09.2034                           |                                   | 700   | 698    | 0,15 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Citadel LP                          |                           |                                   |                |                 | 5,750 % fällig am 01.06.2028                           |                                   | 700   | 718    | 0,15 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,000 % fällig am 23.01.2030        |                           | 250                               | 259            | 0,05            | 6,250 % fällig am 15.09.2054                           |                                   | 600   | 586    | 0,12 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Citibank N.A.                       |                           |                                   |                |                 | Goldman Sachs Group, Inc.                              |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,570 % fällig am 30.04.2034        |                           | 1.750                             | 1.824          | 0,38            | 2,383 % fällig am 21.07.2032                           |                                   | 1.500 | 1.310  | 0,28 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Citigroup, Inc.                     |                           |                                   |                |                 | 2,615 % fällig am 22.04.2032                           |                                   | 1.200 | 1.067  | 0,22 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 2,976 % fällig am 05.11.2030        |                           | 877                               | 821            | 0,17            | 5,016 % fällig am 23.10.2035                           |                                   | 1.600 | 1.581  | 0,33 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 3,520 % fällig am 27.10.2028        |                           | 400                               | 392            | 0,08            | 5,330 % fällig am 23.07.2035                           |                                   | 1.100 | 1.110  | 0,23 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Commonwealth Bank of Australia      |                           |                                   |                |                 | 5,734 % fällig am 28.01.2056                           |                                   | 1.500 | 1.501  | 0,32 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 3,784 % fällig am 14.03.2032 (f)    |                           | 400                               | 371            | 0,08            | 6,484 % fällig am 24.10.2029                           |                                   | 1.800 | 1.910  | 0,40 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Cooperatieve Rabobank UA            |                           |                                   |                |                 | Goodman U.S. Finance Three LLC                         |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(f) | €                         | 800                               | 938            | 0,20            | 3,700 % fällig am 15.03.2028                           |                                   | 1.100 | 1.079  | 0,23 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 5,447 % fällig am 05.03.2030        | \$                        | 200                               | 206            | 0,04            | Great-West Lifeco Finance LP                           |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Corebridge Financial, Inc.          |                           |                                   |                |                 | 4,581 % fällig am 17.05.2048                           |                                   | 300   | 254    | 0,05 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 6,375 % fällig am 15.09.2054        |                           | 500                               | 500            | 0,11            | HA Sustainable Infrastructure Capital, Inc.            |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Corebridge Global Funding           |                           |                                   |                |                 | 6,375 % fällig am 01.07.2034                           |                                   | 100   | 100    | 0,02 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 4,650 % fällig am 20.08.2027        |                           | 400                               | 403            | 0,09            | Hanover Insurance Group, Inc.                          |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Credit Agricole S.A.                |                           |                                   |                |                 | 4,500 % fällig am 15.04.2026                           |                                   | 800   | 798    | 0,17 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f) | €                         | 400                               | 507            | 0,11            | HAT Holdings LLC                                       |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Crown Castle, Inc.                  |                           |                                   |                |                 | 3,375 % fällig am 15.06.2026                           |                                   | 700   | 686    | 0,14 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 2,500 % fällig am 15.07.2031        | \$                        | 500                               | 437            | 0,09            | 8,000 % fällig am 15.06.2027                           |                                   | 400   | 417    | 0,09 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 3,100 % fällig am 15.11.2029        |                           | 900                               | 845            | 0,18            | Highwoods Realty LP                                    |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Digital Dutch Finco BV              |                           |                                   |                |                 | 4,200 % fällig am 15.04.2029                           |                                   | 200   | 195    | 0,04 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 1,500 % fällig am 15.03.2030        | €                         | 800                               | 868            | 0,18            | HLD Europe S.C.A.                                      |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Discover Financial Services         |                           |                                   |                |                 | 4,125 % fällig am 02.04.2030                           | €                                 | 500   | 600    | 0,13 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 7,964 % fällig am 02.11.2034        | \$                        | 300                               | 349            | 0,07            | Host Hotels & Resorts LP                               |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | DOC DR LLC                          |                           |                                   |                |                 | 3,500 % fällig am 15.09.2030                           | \$                                | 700   | 650    | 0,14 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 4,300 % fällig am 15.03.2027        |                           | 300                               | 299            | 0,06            | HSBC Holdings PLC                                      |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              | Encore Capital Group, Inc.          |                           |                                   |                |                 | 7,390 % fällig am 03.11.2028                           |                                   | 875   | 929    | 0,20 |
|                                    |                 |                           |                                   |              | 8,500 % fällig am 15.05.2030        |                           | 100                               | 107            | 0,02            | Hudson Pacific Properties LP                           |                                   |       |        |      |
|                                    |                 |                           |                                   |              |                                     |                           |                                   |                |                 | 4,650 % fällig am 01.04.2029 (g)                       |                                   | 200   | 180    | 0,04 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S)                                                                | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |                                                              |    |       |    |       |      |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------|----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|--------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------|----|-------|----|-------|------|
| Huntington Bancshares, Inc.<br>6,208 % fällig am 21.08.2029               | \$             | 400                      | \$                                | 420          | 0,09           | Mutual of Omaha Cos. Global Funding<br>5,350 % fällig am 09.04.2027                     | \$                                | 300          | \$             | 305                      | 0,06                              | Sun Communities Operating LP<br>2,700 % fällig am 15.07.2031 | \$ | 500   | \$ | 443   | 0,09 |
| IHG Finance LLC<br>4,375 % fällig am 28.11.2029                           | €              | 500                      |                                   | 616          | 0,13           | 5,450 % fällig am 12.12.2028                                                            |                                   | 400          |                | 411                      | 0,09                              | TP ICAP Finance PLC<br>6,375 % fällig am 12.06.2032          | £  | 400   |    | 557   | 0,12 |
| ING Groep NV<br>7,250 % fällig am 16.11.2034 (d)(f)                       | \$             | 700                      |                                   | 713          | 0,15           | Nationwide Building Society<br>6,557 % fällig am 18.10.2027                             |                                   | 200          |                | 205                      | 0,04                              | Trust Fibra Uno<br>7,375 % fällig am 13.02.2034              | \$ | 400   |    | 408   | 0,09 |
| Intercontinental Exchange, Inc.<br>3,000 % fällig am 15.09.2060           |                | 400                      |                                   | 242          | 0,05           | NatWest Group PLC<br>4,892 % fällig am 18.05.2029                                       |                                   | 500          |                | 505                      | 0,11                              | UBS Group AG<br>3,126 % fällig am 13.08.2030                 |    | 900   |    | 849   | 0,18 |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>6,625 % fällig am 20.06.2033                       |                | 200                      |                                   | 217          | 0,05           | 5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f)                                                     | £                                 | 600          |                | 806                      | 0,17                              | 5,959 % fällig am 12.01.2034                                 |    | 1.400 |    | 1.474 | 0,31 |
| 7,200 % fällig am 28.11.2033                                              |                | 200                      |                                   | 225          | 0,05           | 7,300 % fällig am 19.11.2034 (d)(f)                                                     | \$                                | 200          |                | 199                      | 0,04                              | 6,537 % fällig am 12.08.2033                                 |    | 2.750 |    | 2.992 | 0,63 |
| 7,778 % fällig am 20.06.2054                                              |                | 400                      |                                   | 449          | 0,09           | Neuberger Berman Group LLC<br>4,500 % fällig am 15.03.2027                              |                                   | 1.000        |                | 999                      | 0,21                              | 6,850 % fällig am 10.09.2029 (d)(f)                          |    | 300   |    | 302   | 0,06 |
| 7,800 % fällig am 28.11.2053                                              |                | 900                      |                                   | 1.053        | 0,22           | Newmark Group, Inc.<br>7,500 % fällig am 12.01.2029                                     |                                   | 500          |                | 529                      | 0,11                              | UDR, Inc.<br>3,100 % fällig am 01.11.2034                    |    | 300   |    | 253   | 0,05 |
| 8,248 % fällig am 21.11.2033                                              |                | 200                      |                                   | 232          | 0,05           | Nippon Life Insurance Co.<br>6,250 % fällig am 13.09.2053                               |                                   | 200          |                | 206                      | 0,04                              | UniCredit SpA<br>7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f)         | €  | 500   |    | 610   | 0,13 |
| Invitation Homes Operating Partnership LP<br>2,300 % fällig am 15.11.2028 |                | 500                      |                                   | 468          | 0,10           | NLG Global Funding<br>5,400 % fällig am 23.01.2030                                      |                                   | 500          |                | 515                      | 0,11                              | Unum Group<br>6,000 % fällig am 15.06.2054                   | \$ | 100   |    | 99    | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 01.02.2035                                              |                | 300                      |                                   | 291          | 0,06           | NN Group NV<br>5,750 % fällig am 11.09.2034 (d)(f)                                      | €                                 | 1.600        |                | 1.862                    | 0,39                              | VICI Properties LP<br>3,875 % fällig am 15.02.2029           |    | 300   |    | 290   | 0,06 |
| Itau Unibanco Holding S.A.<br>6,000 % fällig am 27.02.2030                |                | 1.000                    |                                   | 1.026        | 0,22           | Nomura Holdings, Inc.<br>2,679 % fällig am 16.07.2030                                   | \$                                | 800          |                | 726                      | 0,15                              | 4,125 % fällig am 15.08.2030                                 |    | 400   |    | 384   | 0,08 |
| JAB Holdings BV<br>2,200 % fällig am 23.11.2030                           |                | 535                      |                                   | 462          | 0,10           | 5,591 % fällig am 02.07.2027                                                            |                                   | 500          |                | 504                      | 0,11                              | 4,500 % fällig am 15.01.2028                                 |    | 100   |    | 100   | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 28.05.2051                                              |                | 600                      |                                   | 397          | 0,08           | 5,594 % fällig am 02.07.2027                                                            |                                   | 600          |                | 613                      | 0,13                              | 5,125 % fällig am 15.11.2031                                 |    | 100   |    | 100   | 0,02 |
| Jefferies Financial Group, Inc.<br>5,875 % fällig am 21.07.2028           |                | 185                      |                                   | 192          | 0,04           | 7,000 % fällig am 15.07.2030<br>(a)(d)(f)                                               |                                   | 400          |                | 406                      | 0,09                              | 5,125 % fällig am 15.05.2032                                 |    | 800   |    | 798   | 0,17 |
| JPMorgan Chase & Co.<br>2,182 % fällig am 01.06.2028                      |                | 500                      |                                   | 481          | 0,10           | Nykredit Realkredit A/S<br>1,500 % fällig am 01.10.2052                                 | DKK                               | 2.838        |                | 361                      | 0,08                              | 5,625 % fällig am 01.04.2035                                 |    | 100   |    | 101   | 0,02 |
| 2,545 % fällig am 08.11.2032                                              |                | 900                      |                                   | 793          | 0,17           | Omega Healthcare Investors, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.01.2028                        | \$                                | 100          |                | 101                      | 0,02                              | 5,750 % fällig am 01.02.2027                                 |    | 100   |    | 101   | 0,02 |
| 2,580 % fällig am 22.04.2032                                              |                | 5.100                    |                                   | 4.556        | 0,97           | OneMain Finance Corp.<br>7,875 % fällig am 15.03.2030                                   |                                   | 500          |                | 532                      | 0,11                              | 5,750 % fällig am 01.04.2034                                 |    | 400   |    | 409   | 0,09 |
| 3,509 % fällig am 23.01.2029                                              |                | 1.505                    |                                   | 1.474        | 0,31           | Pacific Life Global Funding<br>4,955 % fällig am 27.01.2028                             |                                   | 1.000        |                | 999                      | 0,21                              | Vonovia SE<br>0,000 % fällig am 01.12.2025(b)                | €  | 1.200 |    | 1.395 | 0,29 |
| 5,012 % fällig am 23.01.2030                                              |                | 400                      |                                   | 407          | 0,09           | Phillips Edison Grocery Center Operating Partnership LP<br>5,750 % fällig am 15.07.2034 |                                   | 300          |                | 309                      | 0,07                              | Voya Financial, Inc.<br>5,000 % fällig am 20.09.2034         | \$ | 100   |    | 98    | 0,02 |
| 5,140 % fällig am 24.01.2031                                              |                | 300                      |                                   | 308          | 0,07           | Protective Life Global Funding<br>5,432 % fällig am 14.01.2032                          |                                   | 700          |                | 723                      | 0,15                              | Wells Fargo & Co.<br>2,393 % fällig am 02.06.2028            |    | 1.000 |    | 964   | 0,20 |
| 5,294 % fällig am 22.07.2035                                              |                | 400                      |                                   | 407          | 0,09           | Radian Group, Inc.<br>6,200 % fällig am 15.05.2029                                      |                                   | 300          |                | 312                      | 0,07                              | 3,196 % fällig am 17.06.2027                                 |    | 3.500 |    | 3.459 | 0,73 |
| 5,350 % fällig am 01.06.2034                                              |                | 800                      |                                   | 823          | 0,17           | Realty Income Corp.<br>3,375 % fällig am 20.06.2031                                     | €                                 | 400          |                | 468                      | 0,10                              | 4,897 % fällig am 25.07.2033                                 |    | 2.100 |    | 2.101 | 0,44 |
| 5,766 % fällig am 22.04.2035                                              |                | 1.000                    |                                   | 1.051        | 0,22           | RGA Global Funding<br>5,250 % fällig am 09.01.2030                                      | \$                                | 100          |                | 103                      | 0,02                              | 5,420 % fällig am 22.04.2028                                 |    | 1.900 |    | 1.913 | 0,40 |
| 6,087 % fällig am 23.10.2029                                              |                | 500                      |                                   | 526          | 0,11           | 5,500 % fällig am 11.01.2031                                                            |                                   | 100          |                | 103                      | 0,02                              | Welltower OP LLC<br>4,500 % fällig am 01.07.2030             |    | 800   |    | 804   | 0,17 |
| 7,036 % fällig am 01.10.2025 (d)                                          |                | 2.900                    |                                   | 2.919        | 0,61           | 6,000 % fällig am 21.11.2028                                                            |                                   | 700          |                | 735                      | 0,15                              | Weyerhaeuser Co.<br>4,000 % fällig am 15.04.2030             |    | 1.300 |    | 1.269 | 0,27 |
| KBC Group NV<br>6,250 % fällig am 17.09.2031 (d)(f)                       | €              | 200                      |                                   | 241          | 0,05           | Sabra Health Care LP<br>5,125 % fällig am 15.08.2026                                    |                                   | 300          |                | 300                      | 0,06                              | 4,750 % fällig am 15.05.2026                                 |    | 600   |    | 601   | 0,13 |
| Kilroy Realty LP<br>3,050 % fällig am 15.02.2030                          | \$             | 1.300                    |                                   | 1.177        | 0,25           | Sammons Financial Group, Inc.<br>6,875 % fällig am 15.04.2034                           |                                   | 700          |                | 751                      | 0,16                              | 7,375 % fällig am 15.03.2032                                 |    | 343   |    | 387   | 0,08 |
| KKR Group Finance Co. LLC<br>3,625 % fällig am 25.02.2050                 |                | 1.100                    |                                   | 775          | 0,16           | Santander Holdings USA, Inc.<br>5,473 % fällig am 20.03.2029                            |                                   | 500          |                | 509                      | 0,11                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>5,500 % fällig am 01.08.2030 (a)  |                | 200                      |                                   | 201          | 0,04           | 6,499 % fällig am 09.03.2029                                                            |                                   | 525          |                | 548                      | 0,12                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Lazard Group LLC<br>3,625 % fällig am 01.03.2027                          |                | 100                      |                                   | 98           | 0,02           | Santander UK Group Holdings PLC<br>1,532 % fällig am 21.08.2026                         |                                   | 1.700        |                | 1.692                    | 0,36                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| 4,500 % fällig am 19.09.2028                                              |                | 200                      |                                   | 199          | 0,04           | 5,694 % fällig am 15.04.2031                                                            |                                   | 600          |                | 619                      | 0,13                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| 6,000 % fällig am 15.03.2031                                              |                | 100                      |                                   | 105          | 0,02           | SBA Tower Trust<br>1,884 % fällig am 15.07.2050                                         |                                   | 1.000        |                | 984                      | 0,21                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Lloyds Banking Group PLC<br>5,985 % fällig am 07.08.2027                  |                | 500                      |                                   | 508          | 0,11           | Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.<br>5,125 % fällig am 29.10.2022^                 |                                   | 2.100        |                | 126                      | 0,03                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| 6,068 % fällig am 13.06.2036                                              |                | 700                      |                                   | 720          | 0,15           | 5,250 % fällig am 23.05.2023^(f)                                                        |                                   | 600          |                | 36                       | 0,01                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| 8,500 % fällig am 27.09.2027 (d)(f)                                       | £              | 600                      |                                   | 864          | 0,18           | SELP Finance SARL<br>3,750 % fällig am 10.08.2027                                       | €                                 | 300          |                | 358                      | 0,08                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Lseg U.S. Fin Corp.<br>5,297 % fällig am 28.03.2034                       | \$             | 900                      |                                   | 925          | 0,19           | Sixth Street Lending Partners<br>6,500 % fällig am 11.03.2029                           | \$                                | 800          |                | 826                      | 0,17                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Marex Group PLC<br>5,829 % fällig am 08.05.2028                           |                | 1.100                    |                                   | 1.114        | 0,23           | SLM Corp.<br>3,125 % fällig am 02.11.2026                                               |                                   | 300          |                | 294                      | 0,06                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Marsh & McLennan Cos., Inc.<br>5,000 % fällig am 15.03.2035               |                | 800                      |                                   | 800          | 0,17           | Stifel Financial Corp.<br>4,000 % fällig am 15.05.2030                                  |                                   | 500          |                | 481                      | 0,10                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| 5,700 % fällig am 15.09.2053                                              |                | 600                      |                                   | 603          | 0,13           | Store Capital LLC<br>4,500 % fällig am 15.03.2028                                       |                                   | 200          |                | 198                      | 0,04                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Meiji Yasuda Life Insurance Co.<br>6,100 % fällig am 11.06.2055           |                | 400                      |                                   | 400          | 0,08           | Store Capital LLC<br>5,400 % fällig am 30.04.2030                                       |                                   | 300          |                | 304                      | 0,06                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Mercury General Corp.<br>4,400 % fällig am 15.03.2027                     |                | 93                       |                                   | 92           | 0,02           | Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>5,424 % fällig am 09.07.2031                   |                                   | 1.300        |                | 1.350                    | 0,28                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.<br>2,309 % fällig am 20.07.2032      |                | 2.600                    |                                   | 2.266        | 0,48           | 5,558 % fällig am 09.07.2034                                                            |                                   | 500          |                | 517                      | 0,11                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| 5,406 % fällig am 19.04.2034                                              |                | 300                      |                                   | 308          | 0,07           | 5,710 % fällig am 13.01.2030                                                            |                                   | 1.100        |                | 1.154                    | 0,24                              |                                                              |    |       |    |       |      |
| 5,426 % fällig am 17.04.2035                                              |                | 400                      |                                   | 409          | 0,09           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| 5,441 % fällig am 22.02.2034                                              |                | 300                      |                                   | 309          | 0,07           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| Mizuho Financial Group, Inc.<br>3,153 % fällig am 16.07.2030              |                | 1.873                    |                                   | 1.774        | 0,37           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| Morgan Stanley<br>4,654 % fällig am 18.10.2030                            |                | 900                      |                                   | 902          | 0,19           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| 4,889 % fällig am 20.07.2033                                              |                | 1.400                    |                                   | 1.402        | 0,30           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| 5,042 % fällig am 19.07.2030                                              |                | 250                      |                                   | 254          | 0,05           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| 5,250 % fällig am 21.04.2034                                              |                | 4.100                    |                                   | 4.172        | 0,88           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| 5,831 % fällig am 19.04.2035                                              |                | 1.000                    |                                   | 1.048        | 0,22           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
| 6,407 % fällig am 01.11.2029                                              |                | 1.400                    |                                   | 1.483        | 0,31           |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |
|                                                                           |                |                          |                                   |              |                |                                                                                         |                                   |              |                |                          |                                   |                                                              |    |       |    |       |      |

| BESCHREIBUNG                                                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                             | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Amrize Finance U.S. LLC<br>5,400 % fällig am 07.04.2035                   | \$ 700         | \$ 711                   | 0,15                              | Cheniery Energy, Inc.<br>4,625 % fällig am 15.10.2028                    | \$ 400         | \$ 400                   | 0,08                              | Greene King Finance PLC<br>5,318 % fällig am 15.09.2031                        | £ 92           | \$ 127                   | 0,03                              |
| AppLovin Corp.<br>5,125 % fällig am 01.12.2029                            | 200            | 203                      | 0,04                              | Choice Hotels International, Inc.<br>5,850 % fällig am 01.08.2034        | 200            | 202                      | 0,04                              | Greensaif Pipelines Bidco SARL<br>6,103 % fällig am 23.08.2042                 | \$ 400         | 401                      | 0,08                              |
| Ashtead Capital, Inc.<br>4,000 % fällig am 01.05.2028                     | 400            | 394                      | 0,08                              | Chord Energy Corp.<br>6,750 % fällig am 15.03.2033                       | 200            | 204                      | 0,04                              | 6,129 % fällig am 23.02.2038                                                   | 300            | 310                      | 0,07                              |
| 5,800 % fällig am 15.04.2034                                              | 400            | 410                      | 0,09                              | Cigna Group<br>4,375 % fällig am 15.10.2028                              | 1.400          | 1.402                    | 0,30                              | Haleon U.S. Capital LLC<br>3,375 % fällig am 24.03.2029                        | 2.400          | 2.321                    | 0,49                              |
| Astrazeneca Finance LLC<br>5,000 % fällig am 26.02.2034                   | 600            | 612                      | 0,13                              | Constellation Brands, Inc.<br>4,900 % fällig am 01.05.2033               | 1.000          | 991                      | 0,21                              | 3,625 % fällig am 24.03.2032                                                   | 750            | 702                      | 0,15                              |
| AstraZeneca PLC<br>4,000 % fällig am 17.01.2029                           | 300            | 299                      | 0,06                              | Coterra Energy, Inc.<br>5,600 % fällig am 15.03.2034                     | 500            | 505                      | 0,11                              | HCA, Inc.<br>3,500 % fällig am 01.09.2030                                      | 1.000          | 946                      | 0,20                              |
| AutoZone, Inc.<br>6,250 % fällig am 01.11.2028                            | 500            | 530                      | 0,11                              | CVS Health Corp.<br>5,125 % fällig am 21.02.2030                         | 1.000          | 1.018                    | 0,21                              | 3,500 % fällig am 15.07.2051                                                   | 700            | 464                      | 0,10                              |
| Bacardi Ltd.<br>5,250 % fällig am 15.01.2029                              | 1.100          | 1.116                    | 0,24                              | CVS Pass-Through Trust<br>5,789 % fällig am 10.01.2026                   | 8              | 8                        | 0,00                              | 5,200 % fällig am 01.06.2028                                                   | 100            | 102                      | 0,02                              |
| BAE Systems PLC<br>3,400 % fällig am 15.04.2030                           | 200            | 191                      | 0,04                              | 6,036 % fällig am 10.12.2028                                             | 88             | 89                       | 0,02                              | 5,500 % fällig am 01.06.2033                                                   | 900            | 922                      | 0,19                              |
| Baptist Healthcare System Obligated Group<br>3,540 % fällig am 15.08.2050 | 300            | 206                      | 0,04                              | DCP Midstream Operating LP<br>5,125 % fällig am 15.05.2029               | 1.000          | 1.016                    | 0,21                              | 5,625 % fällig am 01.09.2028                                                   | 200            | 206                      | 0,04                              |
| Bayer U.S. Finance LLC<br>4,250 % fällig am 15.12.2025                    | 1.100          | 1.097                    | 0,23                              | Delta Air Lines Pass-Through Trust<br>2,000 % fällig am 10.12.2029       | 771            | 726                      | 0,15                              | Health & Happiness International Holdings Ltd.<br>9,125 % fällig am 24.07.2028 | 900            | 919                      | 0,19                              |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028                                              | 400            | 396                      | 0,08                              | Diamondback Energy, Inc.<br>5,400 % fällig am 18.04.2034                 | 400            | 401                      | 0,08                              | Heathrow Finance PLC<br>4,125 % fällig am 01.09.2029                           | £ 100          | 126                      | 0,03                              |
| 6,125 % fällig am 21.11.2026                                              | 400            | 407                      | 0,09                              | 5,750 % fällig am 18.04.2054                                             | 100            | 93                       | 0,02                              | Hyatt Hotels Corp.<br>5,750 % fällig am 30.03.2032                             | \$ 300         | 308                      | 0,07                              |
| Becton Dickinson & Co.<br>3,828 % fällig am 07.06.2032                    | € 300          | 360                      | 0,08                              | DSV Finance BV<br>2,875 % fällig am 06.11.2026                           | € 1.200        | 1.417                    | 0,30                              | Hyundai Capital America<br>5,100 % fällig am 24.06.2030                        | 700            | 708                      | 0,15                              |
| 5,081 % fällig am 07.06.2029                                              | \$ 800         | 818                      | 0,17                              | DT Midstream, Inc.<br>5,800 % fällig am 15.12.2034                       | \$ 250         | 255                      | 0,05                              | 5,509 % fällig am 04.08.2025                                                   | 300            | 300                      | 0,06                              |
| 5,110 % fällig am 08.02.2034                                              | 500            | 501                      | 0,11                              | Dynob Nobel, Inc.<br>3,950 % fällig am 03.08.2027                        | 500            | 491                      | 0,10                              | Illumina, Inc.<br>5,750 % fällig am 13.12.2027                                 | 548            | 562                      | 0,12                              |
| Berry Global, Inc.<br>1,570 % fällig am 15.01.2026                        | 1.500          | 1.473                    | 0,31                              | Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.<br>3,900 % fällig am 15.11.2049 | 1.400          | 1.011                    | 0,21                              | Infor LLC<br>1,750 % fällig am 15.07.2025                                      | 600            | 599                      | 0,13                              |
| BMW U.S. Capital LLC<br>3,625 % fällig am 18.04.2029                      | 500            | 485                      | 0,10                              | Ecopetrol S.A.<br>8,875 % fällig am 13.01.2033                           | 300            | 310                      | 0,07                              | IRB Infrastructure Developers Ltd.<br>7,110 % fällig am 11.03.2032             | 400            | 401                      | 0,08                              |
| 4,650 % fällig am 19.03.2027                                              | 200            | 201                      | 0,04                              | Elevance Health, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.02.2033                    | 1.800          | 1.789                    | 0,38                              | Jabil, Inc.<br>5,450 % fällig am 01.02.2029                                    | 200            | 205                      | 0,04                              |
| Boeing Co.<br>2,196 % fällig am 04.02.2026                                | 100            | 98                       | 0,02                              | Eli Lilly & Co.<br>4,600 % fällig am 14.08.2034                          | 500            | 496                      | 0,10                              | JDE Peet's NV<br>2,250 % fällig am 24.09.2031                                  | 600            | 512                      | 0,11                              |
| 5,805 % fällig am 01.05.2050                                              | 100            | 96                       | 0,02                              | Enbridge, Inc.<br>5,250 % fällig am 05.04.2027                           | 400            | 406                      | 0,09                              | 4,125 % fällig am 23.01.2030                                                   | € 400          | 489                      | 0,10                              |
| 5,930 % fällig am 01.05.2060                                              | 700            | 666                      | 0,14                              | Energy Transfer LP<br>4,400 % fällig am 15.03.2027                       | 1.400          | 1.400                    | 0,29                              | JetBlue Pass-Through Trust<br>2,750 % fällig am 15.11.2033                     | \$ 223         | 196                      | 0,04                              |
| 6,259 % fällig am 01.05.2027                                              | 400            | 412                      | 0,09                              | 5,750 % fällig am 15.02.2033                                             | 400            | 415                      | 0,09                              | 4,000 % fällig am 15.05.2034                                                   | 71             | 66                       | 0,01                              |
| 6,298 % fällig am 01.05.2029                                              | 1.000          | 1.057                    | 0,22                              | 5,950 % fällig am 01.10.2043                                             | 100            | 95                       | 0,02                              | Keurig Dr Pepper, Inc.<br>5,050 % fällig am 15.03.2029                         | 1.000          | 1.023                    | 0,22                              |
| 7,008 % fällig am 01.05.2064                                              | 1.200          | 1.319                    | 0,28                              | 5,950 % fällig am 15.05.2054                                             | 1.400          | 1.333                    | 0,28                              | Kinder Morgan, Inc.<br>4,800 % fällig am 01.02.2033                            | 300            | 295                      | 0,06                              |
| Booz Allen Hamilton, Inc.<br>5,950 % fällig am 04.08.2033                 | 300            | 308                      | 0,07                              | 6,500 % fällig am 01.02.2042                                             | 100            | 104                      | 0,02                              | 5,200 % fällig am 01.06.2033                                                   | 1.000          | 1.005                    | 0,21                              |
| 5,950 % fällig am 15.04.2035                                              | 200            | 203                      | 0,04                              | Eni SpA<br>5,950 % fällig am 15.05.2054                                  | 800            | 775                      | 0,16                              | 5,950 % fällig am 01.08.2054                                                   | 300            | 295                      | 0,06                              |
| Boston Scientific Corp.<br>2,650 % fällig am 01.06.2030                   | 200            | 185                      | 0,04                              | Enterprise Products Operating LLC<br>4,950 % fällig am 15.02.2035        | 500            | 499                      | 0,11                              | Kraft Heinz Foods Co.<br>6,875 % fällig am 26.01.2039                          | 550            | 609                      | 0,13                              |
| 6,500 % fällig am 15.11.2035                                              | 500            | 561                      | 0,12                              | 5,200 % fällig am 15.01.2036                                             | 700            | 705                      | 0,15                              | Las Vegas Sands Corp.<br>3,900 % fällig am 08.08.2029                          | 1.400          | 1.334                    | 0,28                              |
| British Airways Pass-Through Trust<br>4,125 % fällig am 20.03.2033        | 209            | 200                      | 0,04                              | 5,700 % fällig am 15.02.2042                                             | 300            | 303                      | 0,06                              | 6,000 % fällig am 15.08.2029                                                   | 800            | 823                      | 0,17                              |
| 4,250 % fällig am 15.05.2034                                              | 178            | 171                      | 0,04                              | EQT Corp.<br>5,750 % fällig am 01.02.2034                                | 300            | 310                      | 0,07                              | Leidos, Inc.<br>4,375 % fällig am 15.05.2030                                   | 600            | 591                      | 0,12                              |
| Broadcom, Inc.<br>2,600 % fällig am 15.02.2033                            | 400            | 342                      | 0,07                              | 6,375 % fällig am 01.04.2029                                             | 200            | 206                      | 0,04                              | Live Nation Entertainment, Inc.<br>3,750 % fällig am 15.01.2028                | 500            | 485                      | 0,10                              |
| 3,469 % fällig am 15.04.2034                                              | 569            | 508                      | 0,11                              | Equifax, Inc.<br>5,100 % fällig am 01.06.2028                            | 500            | 510                      | 0,11                              | Marathon Petroleum Corp.<br>5,150 % fällig am 01.03.2030                       | 200            | 204                      | 0,04                              |
| 5,150 % fällig am 15.11.2031                                              | 1.000          | 1.029                    | 0,22                              | Essent Group Ltd.<br>6,250 % fällig am 01.07.2029                        | 200            | 207                      | 0,04                              | Marriott International, Inc.<br>3,500 % fällig am 15.10.2032                   | 200            | 182                      | 0,04                              |
| 5,200 % fällig am 15.04.2032                                              | 1.000          | 1.029                    | 0,22                              | Expand Energy Corp.<br>5,700 % fällig am 15.01.2035                      | 700            | 711                      | 0,15                              | 5,100 % fällig am 15.04.2032                                                   | 400            | 405                      | 0,09                              |
| Cameron LNG LLC<br>3,302 % fällig am 15.01.2035                           | 1.400          | 1.201                    | 0,25                              | Ferguson Finance PLC<br>3,250 % fällig am 02.06.2030                     | 300            | 283                      | 0,06                              | Mars, Inc.<br>5,700 % fällig am 01.05.2055                                     | 800            | 799                      | 0,17                              |
| Canadian Natural Resources Ltd.<br>5,400 % fällig am 15.12.2034           | 400            | 398                      | 0,08                              | Flex Intermediate Holdco LLC<br>3,363 % fällig am 30.06.2031             | 1.500          | 1.334                    | 0,28                              | Marvell Technology, Inc.<br>4,875 % fällig am 22.06.2028                       | 200            | 202                      | 0,04                              |
| 6,250 % fällig am 15.03.2038                                              | 300            | 311                      | 0,07                              | Flex Ltd.<br>5,250 % fällig am 15.01.2032                                | 200            | 202                      | 0,04                              | Masdar Abu Dhabi Future Energy Co.<br>5,250 % fällig am 25.07.2034             | 400            | 405                      | 0,09                              |
| 6,450 % fällig am 30.06.2033                                              | 100            | 107                      | 0,02                              | Flora Food Management BV<br>6,875 % fällig am 02.07.2029                 | € 500          | 597                      | 0,13                              | Mattel, Inc.<br>3,375 % fällig am 01.04.2026                                   | 500            | 494                      | 0,10                              |
| Canadian Pacific Railway Co.<br>2,450 % fällig am 02.12.2031              | 800            | 703                      | 0,15                              | Fox Corp.<br>6,500 % fällig am 13.10.2033 (g)                            | \$ 400         | 433                      | 0,09                              | Medtronic, Inc.<br>3,875 % fällig am 15.10.2036                                | € 400          | 482                      | 0,10                              |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026                                              | 300            | 296                      | 0,06                              | Gatwick Funding Ltd.<br>6,125 % fällig am 02.03.2028                     | £ 200          | 277                      | 0,06                              | Meta Platforms, Inc.<br>5,400 % fällig am 15.08.2054                           | \$ 800         | 781                      | 0,16                              |
| Carnival Corp.<br>4,000 % fällig am 01.08.2028                            | 500            | 490                      | 0,10                              |                                                                          |                |                          |                                   | 5,600 % fällig am 15.05.2053                                                   | 800            | 801                      | 0,17                              |
| 7,000 % fällig am 15.08.2029                                              | 200            | 211                      | 0,04                              |                                                                          |                |                          |                                   | Micron Technology, Inc.<br>4,663 % fällig am 15.02.2030                        | 950            | 948                      | 0,20                              |
| CDW LLC<br>3,569 % fällig am 01.12.2031                                   | 900            | 829                      | 0,17                              |                                                                          |                |                          |                                   | Mitchells & Butlers Finance PLC<br>6,013 % fällig am 15.12.2030                | £ 298          | 412                      | 0,09                              |
| Centene Corp.<br>2,450 % fällig am 15.07.2028                             | 1.200          | 1.115                    | 0,23                              |                                                                          |                |                          |                                   | Mondelez International, Inc.<br>4,625 % fällig am 03.07.2031                   | CAD 600        | 456                      | 0,10                              |
| 2,500 % fällig am 01.03.2031                                              | 783            | 675                      | 0,14                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |
| 2,625 % fällig am 01.08.2031                                              | 117            | 100                      | 0,02                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |
| CGI, Inc.<br>4,950 % fällig am 14.03.2030                                 | 200            | 202                      | 0,04                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |
| Cheniere Energy Partners LP<br>3,250 % fällig am 31.01.2032               | 600            | 538                      | 0,11                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 01.03.2031                                              | 1.200          | 1.142                    | 0,24                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |
| 5,550 % fällig am 30.10.2035 (a)                                          | 600            | 605                      | 0,13                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 15.08.2034                                              | 300            | 308                      | 0,07                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |
| 5,950 % fällig am 30.06.2033 (g)                                          | 600            | 627                      | 0,13                              |                                                                          |                |                          |                                   |                                                                                |                |                          |                                   |



# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                              | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|--------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>Motorola Solutions, Inc.</b>           |                |                          |                                   | <b>T-Mobile USA, Inc.</b>                      |                |                          |                                   | <b>VERSORGUNGSUNTERNEHMEN</b>                    |                |                          |                                   |
| 2,300 % fällig am 15.11.2030              | \$ 300         | \$ 266                   | 0,06                              | 2,550 % fällig am 15.02.2031                   | \$ 4.300       | \$ 3.851                 | 0,81                              | <b>AEP Texas, Inc.</b>                           |                |                          |                                   |
| <b>MPLX LP</b>                            |                |                          |                                   | 2,875 % fällig am 15.02.2031                   | 365            | 332                      | 0,07                              | 5,400 % fällig am 01.06.2033                     | \$ 800         | \$ 812                   | 0,17                              |
| 4,000 % fällig am 15.03.2028              | 600            | 594                      | 0,13                              | 4,700 % fällig am 15.01.2035                   | 1.400          | 1.357                    | 0,29                              | <b>AES Corp.</b>                                 |                |                          |                                   |
| <b>MSCI, Inc.</b>                         |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 15.01.2055                   | 1.100          | 1.044                    | 0,22                              | 2,450 % fällig am 15.01.2031                     | 300            | 262                      | 0,06                              |
| 3,250 % fällig am 15.08.2033              | 200            | 175                      | 0,04                              | <b>Tapestry, Inc.</b>                          |                |                          |                                   | 3,950 % fällig am 15.07.2030                     | 1.300          | 1.237                    | 0,26                              |
| 3,875 % fällig am 15.02.2031              | 300            | 283                      | 0,06                              | 5,100 % fällig am 11.03.2030                   | 400            | 405                      | 0,09                              | 6,950 % fällig am 15.07.2055                     | 600            | 587                      | 0,12                              |
| <b>NetApp, Inc.</b>                       |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 11.03.2035                   | 200            | 201                      | 0,04                              | 7,600 % fällig am 15.01.2055                     | 525            | 542                      | 0,11                              |
| 5,700 % fällig am 17.03.2035              | 400            | 411                      | 0,09                              | <b>Targa Resources Corp.</b>                   |                |                          |                                   | <b>Ameren Illinois Co.</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Netflix, Inc.</b>                      |                |                          |                                   | 5,200 % fällig am 15.10.2027                   | 500            | 507                      | 0,11                              | 3,250 % fällig am 15.03.2050                     | 400            | 272                      | 0,06                              |
| 4,875 % fällig am 15.06.2030              | 400            | 409                      | 0,09                              | 6,125 % fällig am 15.03.2033                   | 200            | 211                      | 0,04                              | <b>Anglian Water Services Financing PLC</b>      |                |                          |                                   |
| <b>Northern Star Resources Ltd.</b>       |                |                          |                                   | <b>Tennessee Gas Pipeline Co. LLC</b>          |                |                          |                                   | 6,000 % fällig am 20.06.2039                     | £ 100          | 134                      | 0,03                              |
| 6,125 % fällig am 11.04.2033              | 1.100          | 1.147                    | 0,24                              | 7,000 % fällig am 15.10.2028                   | 900            | 969                      | 0,20                              | <b>Appalachian Power Co.</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>NVR, Inc.</b>                          |                |                          |                                   | <b>Time Warner Cable LLC</b>                   |                |                          |                                   | 7,000 % fällig am 01.04.2038                     | \$ 900         | 1.002                    | 0,21                              |
| 3,000 % fällig am 15.05.2030              | 1.300          | 1.211                    | 0,26                              | 5,875 % fällig am 15.11.2040                   | 1.400          | 1.345                    | 0,28                              | <b>Arizona Public Service Co.</b>                |                |                          |                                   |
| <b>Occidental Petroleum Corp.</b>         |                |                          |                                   | <b>Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC</b>  |                |                          |                                   | 5,500 % fällig am 01.09.2035                     | 200            | 200                      | 0,04                              |
| 5,550 % fällig am 01.10.2034              | 400            | 393                      | 0,08                              | 4,000 % fällig am 15.03.2028                   | 900            | 892                      | 0,19                              | <b>AT&amp;T, Inc.</b>                            |                |                          |                                   |
| 6,050 % fällig am 01.10.2054              | 400            | 367                      | 0,08                              | <b>Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.</b> |                |                          |                                   | 2,300 % fällig am 01.06.2027                     | 500            | 482                      | 0,10                              |
| 8,875 % fällig am 15.07.2030              | 400            | 457                      | 0,10                              | 5,623 % fällig am 28.08.2034 AUD               | 1.400          | 928                      | 0,20                              | 3,500 % fällig am 15.09.2053                     | 2.800          | 1.897                    | 0,40                              |
| <b>Oracle Corp.</b>                       |                |                          |                                   | <b>United Airlines Pass-Through Trust</b>      |                |                          |                                   | <b>Black Hills Corp.</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,000 % fällig am 15.07.2046              | 500            | 386                      | 0,08                              | 2,700 % fällig am 01.11.2033                   | \$ 303         | 271                      | 0,06                              | 6,000 % fällig am 15.01.2035                     | 350            | 363                      | 0,08                              |
| 4,000 % fällig am 15.11.2047              | 600            | 460                      | 0,10                              | 2,875 % fällig am 07.04.2030                   | 336            | 317                      | 0,07                              | 6,150 % fällig am 15.05.2034                     | 200            | 210                      | 0,04                              |
| 4,650 % fällig am 06.05.2030              | 900            | 909                      | 0,19                              | 3,100 % fällig am 07.04.2030                   | 187            | 175                      | 0,04                              | <b>Capital Power U.S. Holdings, Inc.</b>         |                |                          |                                   |
| 5,375 % fällig am 27.09.2054              | 800            | 732                      | 0,15                              | 3,700 % fällig am 01.09.2031                   | 408            | 381                      | 0,08                              | 5,257 % fällig am 01.06.2028                     | 500            | 507                      | 0,11                              |
| 5,500 % fällig am 27.09.2064              | 400            | 365                      | 0,08                              | 3,750 % fällig am 03.03.2028                   | 472            | 464                      | 0,10                              | <b>CenterPoint Energy Houston Electric LLC</b>   |                |                          |                                   |
| 6,150 % fällig am 09.11.2029              | 300            | 320                      | 0,07                              | 4,000 % fällig am 11.10.2027                   | 137            | 135                      | 0,03                              | 5,050 % fällig am 01.03.2035                     | 500            | 500                      | 0,11                              |
| 6,250 % fällig am 09.11.2032              | 1.000          | 1.083                    | 0,23                              | 4,550 % fällig am 25.02.2033                   | 66             | 62                       | 0,01                              | 5,300 % fällig am 01.04.2053                     | 500            | 477                      | 0,10                              |
| <b>Paramount Global</b>                   |                |                          |                                   | 5,450 % fällig am 15.08.2038                   | 297            | 301                      | 0,06                              | <b>Cleveland Electric Illuminating Co.</b>       |                |                          |                                   |
| 4,950 % fällig am 15.01.2031              | 500            | 486                      | 0,10                              | <b>United Rentals North America, Inc.</b>      |                |                          |                                   | 3,500 % fällig am 01.04.2028                     | 1.461          | 1.422                    | 0,30                              |
| <b>Petroleos Mexicanos</b>                |                |                          |                                   | 3,875 % fällig am 15.11.2027                   | 200            | 196                      | 0,04                              | <b>Columbia Pipelines Operating Co. LLC</b>      |                |                          |                                   |
| 6,840 % fällig am 23.01.2030              | 300            | 290                      | 0,06                              | <b>UnitedHealth Group, Inc.</b>                |                |                          |                                   | 6,036 % fällig am 15.11.2033                     | 300            | 315                      | 0,07                              |
| <b>Philip Morris International, Inc.</b>  |                |                          |                                   | 4,950 % fällig am 15.01.2032                   | 1.062          | 1.076                    | 0,23                              | <b>Connecticut Light and Power Co.</b>           |                |                          |                                   |
| 3,250 % fällig am 06.06.2032              | € 400          | 462                      | 0,10                              | 5,200 % fällig am 15.04.2063                   | 900            | 803                      | 0,17                              | 4,900 % fällig am 01.07.2033                     | 1.000          | 1.001                    | 0,21                              |
| 5,250 % fällig am 13.02.2034              | \$ 400         | 408                      | 0,09                              | 5,625 % fällig am 15.07.2054                   | 500            | 485                      | 0,10                              | <b>Consolidated Edison Co. of New York, Inc.</b> |                |                          |                                   |
| 5,750 % fällig am 17.11.2032              | 600            | 635                      | 0,13                              | 5,750 % fällig am 15.07.2064                   | 300            | 292                      | 0,06                              | 5,300 % fällig am 01.03.2035                     | 900            | 923                      | 0,19                              |
| <b>Plains All American Pipeline LP</b>    |                |                          |                                   | <b>Universal Music Group NV</b>                |                |                          |                                   | <b>Dominion Energy, Inc.</b>                     |                |                          |                                   |
| 5,950 % fällig am 15.06.2035              | 400            | 411                      | 0,09                              | 3,750 % fällig am 30.06.2032                   | € 1.800        | 2.168                    | 0,46                              | 5,450 % fällig am 15.03.2035                     | 800            | 807                      | 0,17                              |
| <b>Rogers Communications, Inc.</b>        |                |                          |                                   | <b>Vale Overseas Ltd.</b>                      |                |                          |                                   | <b>DTE Energy Co.</b>                            |                |                          |                                   |
| 5,000 % fällig am 15.02.2029              | 513            | 520                      | 0,11                              | 6,400 % fällig am 28.06.2054                   | \$ 500         | 492                      | 0,10                              | 2,950 % fällig am 01.03.2030                     | 600            | 560                      | 0,12                              |
| <b>Royal Caribbean Cruises Ltd.</b>       |                |                          |                                   | <b>Var Energi ASA</b>                          |                |                          |                                   | 5,100 % fällig am 01.03.2029                     | 200            | 204                      | 0,04                              |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028              | 200            | 195                      | 0,04                              | 5,500 % fällig am 04.05.2029                   | € 700          | 882                      | 0,19                              | 5,850 % fällig am 01.06.2034                     | 400            | 419                      | 0,09                              |
| 5,500 % fällig am 01.04.2028              | 500            | 507                      | 0,11                              | <b>Venture Global Calcasieu Pass LLC</b>       |                |                          |                                   | <b>Duke Energy Carolinas LLC</b>                 |                |                          |                                   |
| 5,625 % fällig am 30.09.2031              | 200            | 201                      | 0,04                              | 6,250 % fällig am 15.01.2030                   | \$ 2.000       | 2.064                    | 0,43                              | 6,000 % fällig am 15.01.2038                     | 50             | 53                       | 0,01                              |
| <b>Royalty Pharma PLC</b>                 |                |                          |                                   | <b>Venture Global LNG, Inc.</b>                |                |                          |                                   | <b>Duke Energy Corp.</b>                         |                |                          |                                   |
| 3,550 % fällig am 02.09.2050              | 711            | 482                      | 0,10                              | 7,000 % fällig am 15.01.2030                   | 400            | 405                      | 0,09                              | 3,750 % fällig am 01.04.2031                     | € 2.000        | 2.385                    | 0,50                              |
| <b>RTX Corp.</b>                          |                |                          |                                   | <b>Verisk Analytics, Inc.</b>                  |                |                          |                                   | <b>Duke Energy Ohio, Inc.</b>                    |                |                          |                                   |
| 6,100 % fällig am 15.03.2034              | 600            | 649                      | 0,14                              | 4,125 % fällig am 15.03.2029                   | 200            | 199                      | 0,04                              | 5,650 % fällig am 01.04.2053                     | \$ 1.500       | 1.480                    | 0,31                              |
| 6,400 % fällig am 15.03.2054              | 500            | 549                      | 0,12                              | <b>VMware LLC</b>                              |                |                          |                                   | <b>Edison International</b>                      |                |                          |                                   |
| <b>Santos Finance Ltd.</b>                |                |                          |                                   | 3,900 % fällig am 21.08.2027                   | 500            | 496                      | 0,10                              | 5,450 % fällig am 15.06.2029                     | 1.600          | 1.583                    | 0,33                              |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029              | 1.600          | 1.615                    | 0,34                              | 4,650 % fällig am 15.05.2027                   | 350            | 352                      | 0,07                              | <b>Electricite de France S.A.</b>                |                |                          |                                   |
| <b>Saudi Arabian Oil Co.</b>              |                |                          |                                   | 4,700 % fällig am 15.05.2030                   | 900            | 904                      | 0,19                              | 4,625 % fällig am 07.05.2045                     | € 500          | 575                      | 0,12                              |
| 5,750 % fällig am 17.07.2054              | 600            | 564                      | 0,12                              | <b>VOC Escrow Ltd.</b>                         |                |                          |                                   | 4,875 % fällig am 21.09.2038                     | \$ 600         | 555                      | 0,12                              |
| <b>Skyworks Solutions, Inc.</b>           |                |                          |                                   | 5,000 % fällig am 15.02.2028                   | 200            | 199                      | 0,04                              | <b>EnBW International Finance BV</b>             |                |                          |                                   |
| 3,000 % fällig am 01.06.2031              | 100            | 88                       | 0,02                              | <b>Warnermedia Holdings, Inc.</b>              |                |                          |                                   | 6,048 % fällig am 30.10.2034 AUD                 | 800            | 548                      | 0,12                              |
| <b>Smurfit Kappa Treasury ULC</b>         |                |                          |                                   | 5,050 % fällig am 15.03.2042                   | 1.380          | 934                      | 0,20                              | <b>Enel Finance International NV</b>             |                |                          |                                   |
| 5,200 % fällig am 15.01.2030              | 800            | 816                      | 0,17                              | <b>Waste Connections, Inc.</b>                 |                |                          |                                   | 1,625 % fällig am 12.07.2026                     | \$ 600         | 582                      | 0,12                              |
| <b>Spirit AeroSystems, Inc.</b>           |                |                          |                                   | 4,200 % fällig am 15.01.2033                   | 900            | 871                      | 0,18                              | <b>Entergy Corp.</b>                             |                |                          |                                   |
| 9,375 % fällig am 30.11.2029              | 200            | 212                      | 0,04                              | <b>Wessex Water Services Finance PLC</b>       |                |                          |                                   | 1,900 % fällig am 15.06.2028                     | 200            | 187                      | 0,04                              |
| 9,750 % fällig am 15.11.2030              | 400            | 442                      | 0,09                              | 6,125 % fällig am 19.09.2034                   | £ 1.200        | 1.665                    | 0,35                              | <b>Entergy Texas, Inc.</b>                       |                |                          |                                   |
| <b>Spirit Airlines Pass-Through Trust</b> |                |                          |                                   | <b>Williams Cos., Inc.</b>                     |                |                          |                                   | 5,250 % fällig am 15.04.2035                     | 1.000          | 1.009                    | 0,21                              |
| 3,650 % fällig am 15.08.2031              | 375            | 325                      | 0,07                              | 5,300 % fällig am 30.09.2035                   | \$ 700         | 701                      | 0,15                              | 5,550 % fällig am 15.09.2054                     | 200            | 191                      | 0,04                              |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029              | 245            | 226                      | 0,05                              | 5,600 % fällig am 15.03.2035                   | 500            | 514                      | 0,11                              | <b>EP Infrastructure A/S</b>                     |                |                          |                                   |
| <b>Stryker Corp.</b>                      |                |                          |                                   | <b>Woodside Finance Ltd.</b>                   |                |                          |                                   | 1,816 % fällig am 02.03.2031                     | € 200          | 210                      | 0,04                              |
| 1,950 % fällig am 15.06.2030              | 100            | 89                       | 0,02                              | 5,100 % fällig am 12.09.2034                   | 900            | 872                      | 0,18                              | <b>EPH Financing International A/S</b>           |                |                          |                                   |
| 4,250 % fällig am 11.09.2029              | 500            | 499                      | 0,11                              | 5,400 % fällig am 19.05.2030                   | 1.000          | 1.015                    | 0,21                              | 5,875 % fällig am 30.11.2029                     | 300            | 377                      | 0,08                              |
| 4,625 % fällig am 11.09.2034              | 200            | 197                      | 0,04                              | <b>Wynn Resorts Finance LLC</b>                |                |                          |                                   | <b>Eversource Energy</b>                         |                |                          |                                   |
| 4,850 % fällig am 08.12.2028              | 500            | 510                      | 0,11                              | 6,250 % fällig am 15.03.2033                   | 100            | 101                      | 0,02                              | 5,500 % fällig am 01.01.2034                     | \$ 200         | 204                      | 0,04                              |
| 5,200 % fällig am 10.02.2035              | 400            | 408                      | 0,09                              | 7,125 % fällig am 15.02.2031                   | 300            | 320                      | 0,07                              | <b>Interstate Power &amp; Light Co.</b>          |                |                          |                                   |
| <b>Sutter Health</b>                      |                |                          |                                   | <b>Yorkshire Water Finance PLC</b>             |                |                          |                                   | 3,600 % fällig am 01.04.2029                     | 600            | 583                      | 0,12                              |
| 5,164 % fällig am 15.08.2033              | 100            | 102                      | 0,02                              | 1,750 % fällig am 27.10.2032                   | £ 400          | 425                      | 0,09                              | <b>Jersey Central Power &amp; Light Co.</b>      |                |                          |                                   |
| <b>Synopsys, Inc.</b>                     |                |                          |                                   | 6,375 % fällig am 18.11.2034                   | 100            | 142                      | 0,03                              | 4,300 % fällig am 15.01.2026                     | 3.350          | 3.344                    | 0,70                              |
| 5,150 % fällig am 01.04.2035              | 600            | 605                      | 0,13                              | <b>Zimmer Biomet Holdings, Inc.</b>            |                |                          |                                   | <b>Louisville Gas &amp; Electric Co.</b>         |                |                          |                                   |
| <b>Synthos S.A.</b>                       |                |                          |                                   | 4,250 % fällig am 15.08.2035                   | \$ 228         | 209                      | 0,04                              | 5,450 % fällig am 15.04.2033                     | 700            | 724                      | 0,15                              |
| 2,500 % fällig am 07.06.2028              | € 300          | 333                      | 0,07                              | <b>Zoetis, Inc.</b>                            |                |                          |                                   | <b>MidAmerican Energy Co.</b>                    |                |                          |                                   |
| <b>Sysco Corp.</b>                        |                |                          |                                   | 2,000 % fällig am 15.05.2030                   | 900            | 809                      | 0,17                              | 2,700 % fällig am 01.08.2052                     | 100            | 62                       | 0,01                              |
| 3,150 % fällig am 14.12.2051              | \$ 300         | 192                      | 0,04                              |                                                |                |                          |                                   |                                                  |                |                          |                                   |
|                                           |                |                          |                                   |                                                |                | 147.430                  | 31,03                             |                                                  |                |                          |                                   |

| BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                                                                                    | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| Mississippi Power Co.<br>3,950 % fällig am 30.03.2028                 | \$ 400         | \$ 399                   | 0,08                              | 5,500 % fällig am 01.03.2030                                                            | \$ 261         | \$ 265                   | 0,06                              | Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.<br>5,102 % fällig am 01.04.2035                  | \$ 530         | \$ 542                   | 0,11                              |
| National Grid PLC<br>5,809 % fällig am 12.06.2033                     | 500            | 526                      | 0,11                              | TDC Net A/S<br>5,000 % fällig am 09.08.2032                                             | € 1.000        | 1.202                    | 0,25                              |                                                                                                 |                | 908                      | 0,19                              |
| NBN Co. Ltd.<br>5,000 % fällig am 28.08.2031                          | AUD 1.000      | 672                      | 0,14                              | Vistra Operations Co. LLC<br>6,000 % fällig am 15.04.2034                               | \$ 500         | 520                      | 0,11                              |                                                                                                 |                | 1.769                    | 0,37                              |
| New York State Electric & Gas Corp.<br>5,850 % fällig am 15.08.2033   | \$ 800         | 840                      | 0,18                              |                                                                                         |                | 60.848                   | 12,81                             | <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                                         |                |                          |                                   |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>6,750 % fällig am 15.06.2054 | 900            | 936                      | 0,20                              | Summe Unternehmensanleihen und Wechsel                                                  |                | 391.812                  | 82,49                             | Brazil Government International Bond<br>7,125 % fällig am 13.05.2054                            | 400            | 384                      | 0,08                              |
| Niagara Mohawk Power Corp.<br>5,290 % fällig am 17.01.2034            | 1.000          | 997                      | 0,21                              | <b>KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                                     |                |                          |                                   | Cassa Depositi e Prestiti SpA<br>5,875 % fällig am 30.04.2029                                   | 500            | 523                      | 0,11                              |
| NiSource, Inc.<br>3,600 % fällig am 01.05.2030                        | 300            | 288                      | 0,06                              | Maricopa County, Arizona Industrial Development<br>Authority Revenue Notes, Series 2024 | \$ 300         | 311                      | 0,07                              | Israel Government International Bond<br>5,375 % fällig am 19.02.2030                            | 400            | 408                      | 0,09                              |
| Oklahoma Gas & Electric Co.<br>5,400 % fällig am 15.01.2033           | 200            | 207                      | 0,04                              | <b>US-REGIERUNGSBEHÖRDEN</b>                                                            |                |                          |                                   | 5,750 % fällig am 12.03.2054                                                                    | 1.500          | 1.391                    | 0,29                              |
| ONEOK, Inc.<br>4,350 % fällig am 15.03.2029                           | 200            | 199                      | 0,04                              | Ginnie Mae<br>4,602 % fällig am 20.01.2068                                              | 438            | 435                      | 0,09                              | Japan Government International Bond<br>2,000 % fällig am 20.12.2044                             | ¥230.000       | 1.508                    | 0,32                              |
| 6,050 % fällig am 01.11.2034                                          | 2.300          | 2.239                    | 0,47                              | 5,196 % fällig am 20.10.2066                                                            | 217            | 217                      | 0,05                              | 2,200 % fällig am 20.03.2064                                                                    | 100.000        | 557                      | 0,12                              |
| 6,625 % fällig am 01.09.2053                                          | 1.300          | 1.352                    | 0,29                              | Ginnie Mae, TBA<br>4,000 % fällig am 01.07.2055                                         | 2.300          | 2.139                    | 0,45                              | 2,400 % fällig am 20.03.2045                                                                    | 107.600        | 750                      | 0,16                              |
| Pacific Gas & Electric Co.<br>2,100 % fällig am 01.08.2027            | 2.300          | 2.179                    | 0,46                              | 5,000 % fällig am 01.07.2055                                                            | 700            | 688                      | 0,14                              | 2,400 % fällig am 20.03.2055                                                                    | 20.000         | 127                      | 0,03                              |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026                                          | 700            | 693                      | 0,15                              | Uniform Mortgage-Backed Security<br>3,000 % fällig am 01.05.2052                        | 797            | 691                      | 0,15                              | Korea National Oil Corp.<br>4,875 % fällig am 03.04.2029                                        | \$ 500         | 509                      | 0,11                              |
| 3,250 % fällig am 01.06.2031                                          | 1.400          | 1.257                    | 0,26                              | 4,500 % fällig am 01.09.2052                                                            | 3.245          | 3.111                    | 0,66                              | Mexico Government International Bond<br>2,750 % fällig am 27.11.2031 (c) MXN 10.881             |                | 510                      | 0,11                              |
| 3,750 % fällig am 01.07.2028                                          | 300            | 291                      | 0,06                              | - 01.10.2052                                                                            |                |                          |                                   | 3,000 % fällig am 03.12.2026 (c)                                                                | 8.501          | 441                      | 0,09                              |
| 4,250 % fällig am 15.03.2046                                          | 1.100          | 821                      | 0,17                              | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA<br>3,000 % fällig am 01.07.2055                   | 2.820          | 2.440                    | 0,51                              | 4,000 % fällig am 30.11.2028 (c)                                                                | 5.101          | 265                      | 0,06                              |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045                                          | 100            | 76                       | 0,02                              | 4,000 % fällig am 01.08.2055                                                            | 4.330          | 4.026                    | 0,85                              | 5,850 % fällig am 02.07.2032 (a)                                                                | \$ 600         | 608                      | 0,13                              |
| 4,950 % fällig am 01.07.2050                                          | 100            | 81                       | 0,02                              | 4,500 % fällig am 01.08.2055                                                            | 1.100          | 1.052                    | 0,22                              | 6,000 % fällig am 07.05.2036                                                                    | 500            | 495                      | 0,10                              |
| 6,750 % fällig am 15.01.2053                                          | 400            | 403                      | 0,09                              |                                                                                         |                | 14.799                   | 3,12                              | Peru Government International Bond<br>5,400 % fällig am 12.08.2034                              | PEN 4.800      | 1.281                    | 0,27                              |
| PacificCorp<br>6,250 % fällig am 15.10.2037                           | 1.400          | 1.480                    | 0,31                              | <b>US-SCHATZOBLIGATIONEN</b>                                                            |                |                          |                                   | 6,150 % fällig am 12.08.2032                                                                    | 3.961          | 1.155                    | 0,24                              |
| 7,375 % fällig am 15.09.2055                                          | 400            | 417                      | 0,09                              | U.S. Treasury STRIPS                                                                    |                |                          |                                   | 6,950 % fällig am 12.08.2031                                                                    | 2.992          | 917                      | 0,19                              |
| Plains All American Pipeline LP<br>3,550 % fällig am 15.12.2029       | 500            | 478                      | 0,10                              | 0,000 % fällig am 15.08.2049 (b)                                                        | 11.700         | 3.511                    | 0,74                              | 7,300 % fällig am 12.08.2033                                                                    | 2.200          | 675                      | 0,14                              |
| Progress Energy, Inc.<br>7,750 % fällig am 01.03.2031                 | 204            | 235                      | 0,05                              | 0,000 % fällig am 15.08.2050 (b)                                                        | 6.800          | 1.948                    | 0,41                              | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia<br>2,800 % fällig am 23.06.2030                              | \$ 300         | 278                      | 0,06                              |
| Public Service Co. of Colorado<br>6,250 % fällig am 01.09.2037        | 300            | 323                      | 0,07                              |                                                                                         |                | 5.459                    | 1,15                              | Romania Government International Bond<br>3,750 % fällig am 07.02.2034                           | € 400          | 402                      | 0,08                              |
| Public Service Co. of Oklahoma<br>2,200 % fällig am 15.08.2031        | 300            | 260                      | 0,06                              | <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                                   |                |                          |                                   | 5,625 % fällig am 22.02.2036                                                                    | 400            | 447                      | 0,09                              |
| 5,450 % fällig am 15.01.2036                                          | 300            | 302                      | 0,06                              | Commercial Mortgage Trust<br>3,140 % fällig am 10.10.2036                               | 700            | 651                      | 0,14                              | 5,625 % fällig am 30.05.2037                                                                    | 400            | 443                      | 0,09                              |
| Public Service Enterprise Group, Inc.<br>5,450 % fällig am 01.04.2034 | 200            | 204                      | 0,04                              | Countrywide Alternative Loan Trust<br>5,749 % fällig am 25.08.2035                      | 26             | 22                       | 0,00                              | Saudi Arabia Government International Bond<br>3,750 % fällig am 05.03.2037                      | 300            | 343                      | 0,07                              |
| San Diego Gas & Electric Co.<br>1,700 % fällig am 01.10.2030          | 300            | 261                      | 0,06                              | Countrywide Home Loan Repurchasing REMIC Trust<br>4,859 % fällig am 25.11.2034          | 96             | 91                       | 0,02                              | 4,750 % fällig am 16.01.2030                                                                    | \$ 1.400       | 1.414                    | 0,30                              |
| 5,350 % fällig am 01.04.2053                                          | 1.100          | 1.029                    | 0,22                              | Credit Suisse Mortgage Capital Certificates<br>2,750 % fällig am 25.07.2057             | 190            | 185                      | 0,04                              | 5,125 % fällig am 13.01.2028                                                                    | 1.100          | 1.119                    | 0,24                              |
| Southern California Edison Co.<br>2,750 % fällig am 01.02.2032        | 1.500          | 1.294                    | 0,27                              | 3,850 % fällig am 25.09.2057                                                            | 166            | 161                      | 0,03                              | South Africa Government International Bond<br>7,100 % fällig am 19.11.2036                      | 600            | 596                      | 0,12                              |
| 2,850 % fällig am 01.08.2029                                          | 800            | 741                      | 0,16                              | RMAC PLC<br>5,437 % fällig am 15.02.2047                                                | £ 534          | 735                      | 0,16                              | 8,500 % fällig am 31.01.2037                                                                    | ZAR 16.400     | 803                      | 0,17                              |
| 3,900 % fällig am 01.12.2041                                          | 108            | 82                       | 0,02                              | Wells Fargo Commercial Mortgage Trust<br>3,874 % fällig am 15.06.2036                   | \$ 700         | 639                      | 0,13                              | 8,875 % fällig am 28.02.2035                                                                    | 59.450         | 3.124                    | 0,66                              |
| 4,125 % fällig am 01.03.2048                                          | 100            | 73                       | 0,02                              |                                                                                         |                | 2.484                    | 0,52                              | United Kingdom Gilt<br>4,375 % fällig am 31.07.2054                                             | £ 729          | 866                      | 0,18                              |
| 4,200 % fällig am 01.03.2029                                          | 200            | 196                      | 0,04                              | <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                                 |                |                          |                                   |                                                                                                 |                | 22.339                   | 4,70                              |
| 5,300 % fällig am 01.03.2028                                          | 700            | 709                      | 0,15                              | HYPOTHEKEN SONSTIGE                                                                     |                |                          |                                   | <b>AKTIEN</b>                                                                                   |                |                          |                                   |
| 5,350 % fällig am 01.03.2026                                          | 200            | 201                      | 0,04                              | ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust<br>5,364 % fällig am 25.02.2036             | 150            | 141                      | 0,03                              | <b>VORZUGSWERTPAPIERE</b>                                                                       |                |                          |                                   |
| 6,200 % fällig am 15.09.2055                                          | 400            | 383                      | 0,08                              | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>4,834 % fällig am 25.01.2037                     | 1.023          | 429                      | 0,09                              | Wells Fargo & Co.<br>4,250 % fällig am 15.09.2026                                               | 40.800 \$      | 704                      | 0,15                              |
| Southern California Gas Co.<br>5,200 % fällig am 01.06.2033           | 1.300          | 1.319                    | 0,28                              | Ellington Loan Acquisition Trust<br>5,534 % fällig am 25.05.2037                        | 131            | 129                      | 0,03                              | Summe Übertragbare Wertpapiere                                                                  | \$ 440.924     | 92,83                    |                                   |
| Southwest Gas Corp.<br>5,800 % fällig am 01.12.2027                   | 885            | 914                      | 0,19                              | New Century Home Equity Loan Trust<br>5,139 % fällig am 25.02.2036                      | 182            | 162                      | 0,03                              | <b>INVESTMENTFONDS</b>                                                                          |                |                          |                                   |
| Southwestern Public Service Co.<br>3,750 % fällig am 15.06.2049       | 500            | 362                      | 0,08                              |                                                                                         |                | 861                      | 0,18                              | <b>ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN</b>                                                        |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 01.06.2054                                          | 680            | 687                      | 0,14                              | <b>ABS SONSTIGE</b>                                                                     |                |                          |                                   | PIMCO Funds: Global<br>Investors Series plc -<br>PIMCO Credit<br>Opportunities Bond<br>Fund (e) | 992.063        | 10.357                   | 2,18                              |
| SPP-Distribucia A/S<br>1,000 % fällig am 09.06.2031                   | € 200          | 201                      | 0,04                              | Betony CLO Ltd.<br>5,621 % fällig am 30.04.2031                                         | 366            | 366                      | 0,08                              | Summe Investmentfonds                                                                           | \$ 10.357      | 2,18                     |                                   |
| SW Finance PLC<br>7,000 % fällig am 16.04.2040                        | £ 500          | 655                      | 0,14                              |                                                                                         |                |                          |                                   |                                                                                                 |                |                          |                                   |
| Systems Energy Resources, Inc.<br>2,140 % fällig am 09.12.2025        | \$ 800         | 791                      | 0,17                              |                                                                                         |                |                          |                                   |                                                                                                 |                |                          |                                   |
| 5,300 % fällig am 15.12.2034                                          | 400            | 396                      | 0,08                              |                                                                                         |                |                          |                                   |                                                                                                 |                |                          |                                   |
| 6,000 % fällig am 15.04.2028                                          | 600            | 625                      | 0,13                              |                                                                                         |                |                          |                                   |                                                                                                 |                |                          |                                   |
| Targa Resources Partners LP                                           |                |                          |                                   |                                                                                         |                |                          |                                   |                                                                                                 |                |                          |                                   |

**PENSIONSGESCHÄFTE**

| Kontrahent              | Kreditzins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kapitalbetrag | Besichert durch                                  | Sicherheiten<br>(erhalten) | Pensions-<br>geschäfte,<br>zum Wert | Zu erhaltende<br>Erlöse aus<br>Pensions-<br>geschäft <sup>(1)</sup> | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|---------------|--------------------------------------------------|----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| FICC                    | 4,400 %    | 30.06.2025            | 01.07.2025            | \$ 16.600     | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027 | \$ (17.067)                | \$ 16.600                           | \$ 16.602                                                           | 3,49                         |
| Summe Pensionsgeschäfte |            |                       |                       |               |                                                  | \$ (17.067)                | \$ 16.600                           | \$ 16.602                                                           | 3,49                         |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                         | Art   | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------|-------|-------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2027     | 96                   | \$ 227                                   | 0,05                 |
| 3-Month SOFR December Futures                        | Long  | 03.2028     | 143                  | 308                                      | 0,06                 |
| 3-Month SOFR June Futures                            | Long  | 09.2027     | 161                  | 364                                      | 0,08                 |
| 3-Month SOFR March Futures                           | Long  | 06.2027     | 196                  | 457                                      | 0,10                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2026     | 98                   | 231                                      | 0,05                 |
| 3-Month SOFR September Futures                       | Long  | 12.2027     | 191                  | 394                                      | 0,08                 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures     | Short | 09.2025     | 23                   | (20)                                     | 0,00                 |
| Euro-Bobl September Futures                          | Short | 09.2025     | 191                  | 104                                      | 0,02                 |
| Euro-Bund September Futures                          | Long  | 09.2025     | 3                    | (4)                                      | 0,00                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 446                  | 341                                      | 0,07                 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures          | Long  | 09.2025     | 356                  | 423                                      | 0,09                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures         | Long  | 09.2025     | 7                    | 11                                       | 0,00                 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures        | Long  | 09.2025     | 347                  | 790                                      | 0,17                 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long  | 09.2025     | 296                  | 1.348                                    | 0,28                 |
|                                                      |       |             |                      | <b>\$ 4.974</b>                          | <b>1,05</b>          |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### FUTURE-STYLE-OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung                                               | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld        | Marktwert      | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------------------|---------------|---------------|----------------------|----------------|----------------|----------------------|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | \$ 108,500    | 25.07.2025    | 7                    | \$ (2)         | \$ 0           | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,000       | 25.07.2025    | 14                   | (6)            | (1)            | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 109,500       | 25.07.2025    | 7                    | (2)            | (1)            | 0,00                 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures  | 110,250       | 25.07.2025    | 7                    | (2)            | (1)            | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,000       | 25.07.2025    | 7                    | (3)            | (5)            | 0,00                 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,500       | 25.07.2025    | 21                   | (8)            | (11)           | (0,01)               |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2025 Futures | 112,750       | 25.07.2025    | 7                    | (2)            | (3)            | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                  | € 117,250     | 25.07.2025    | 2                    | (1)            | 0              | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                 | 118,500       | 25.07.2025    | 2                    | 0              | 0              | 0,00                 |
| Put - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                  | 129,000       | 25.07.2025    | 2                    | (1)            | (1)            | 0,00                 |
| Call - EUREX Euro-Bobl August 2025 Futures                 | 132,500       | 25.07.2025    | 2                    | (1)            | 0              | 0,00                 |
|                                                            |               |               |                      | <b>\$ (28)</b> | <b>\$ (23)</b> | <b>(0,01)</b>        |

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate

**\$ 4.951 1,04**

### ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Referenzeinheit                                    | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------|------------------------------------------|----------------------|
| Airbus Group Finance BV                            | 1,000 %                     | 20.12.2028       | € 200                     | \$ 4                                     | 0,00                 |
| Airbus Group Finance BV                            | 1,000                       | 20.06.2029       | 300                       | 3                                        | 0,00                 |
| American International Group, Inc.                 | 1,000                       | 20.12.2026       | \$ 500                    | (5)                                      | 0,00                 |
| AT&T, Inc.                                         | 1,000                       | 20.12.2025       | 1.500                     | (4)                                      | 0,00                 |
| AT&T, Inc.                                         | 1,000                       | 20.12.2026       | 900                       | (5)                                      | 0,00                 |
| AT&T, Inc.                                         | 1,000                       | 20.06.2028       | 1.000                     | 27                                       | 0,01                 |
| Bank of America Corp.                              | 1,000                       | 20.12.2025       | 300                       | (1)                                      | 0,00                 |
| Barclays Bank PLC                                  | 1,000                       | 20.12.2025       | € 300                     | 0                                        | 0,00                 |
| Boeing Co.                                         | 1,000                       | 20.12.2025       | \$ 200                    | 2                                        | 0,00                 |
| Boeing Co.                                         | 1,000                       | 20.12.2026       | 500                       | 8                                        | 0,00                 |
| Boeing Co.                                         | 1,000                       | 20.06.2027       | 2.000                     | 145                                      | 0,03                 |
| BP Capital Markets PLC                             | 1,000                       | 20.12.2025       | € 700                     | (10)                                     | 0,00                 |
| Cellnex Telecom S.A.                               | 5,000                       | 20.12.2030       | 400                       | 100                                      | 0,02                 |
| Devon Energy Corp.                                 | 1,000                       | 20.12.2026       | \$ 200                    | 3                                        | 0,00                 |
| Elis S.A.                                          | 5,000                       | 20.12.2029       | € 200                     | 2                                        | 0,00                 |
| Enbridge, Inc.                                     | 1,000                       | 20.12.2026       | \$ 900                    | 1                                        | 0,00                 |
| Expedia Group, Inc.                                | 1,000                       | 20.12.2026       | 300                       | 1                                        | 0,00                 |
| General Electric Co.                               | 1,000                       | 20.06.2026       | 1.200                     | (1)                                      | 0,00                 |
| General Electric Co.                               | 1,000                       | 20.12.2026       | 200                       | 0                                        | 0,00                 |
| General Motors Co.                                 | 5,000                       | 20.12.2026       | 710                       | (94)                                     | (0,02)               |
| General Motors Co.                                 | 5,000                       | 20.06.2028       | 890                       | 1                                        | 0,00                 |
| Glencore Finance Europe Ltd.                       | 5,000                       | 20.06.2031       | € 300                     | 4                                        | 0,00                 |
| Hess Corp.                                         | 1,000                       | 20.12.2026       | \$ 1.200                  | 22                                       | 0,01                 |
| National Rural Utilities Cooperative Finance Corp. | 1,000                       | 20.12.2026       | 200                       | (3)                                      | 0,00                 |
| Tesco PLC                                          | 1,000                       | 20.12.2027       | € 1.050                   | 24                                       | 0,01                 |
| Tesco PLC                                          | 1,000                       | 20.06.2028       | 100                       | 2                                        | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc.                       | 1,000                       | 20.06.2026       | \$ 1.200                  | (19)                                     | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc.                       | 1,000                       | 20.12.2026       | 1.800                     | (24)                                     | (0,01)               |
| Verizon Communications, Inc.                       | 1,000                       | 20.06.2028       | 1.100                     | 19                                       | 0,00                 |
| Verizon Communications, Inc.                       | 1,000                       | 20.12.2028       | 300                       | 6                                        | 0,00                 |
| Volkswagen International Finance NV                | 1,000                       | 20.06.2028       | € 1.600                   | 1                                        | 0,00                 |
| Electricite de France                              | 1,000                       | 20.06.2030       | 500                       | 0                                        | 0,00                 |
|                                                    |                             |                  |                           | <b>\$ 209</b>                            | <b>0,05</b>          |

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Index/Tranchen         | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| CDX.IG-44 5-Year Index | 1,000 %                        | 20.06.2030            | \$ 61.000                      | \$ 197                                          | 0,04                         |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz    | Variable Zinssatzindex         | Fester<br>Zinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------------------------------------------|--------------------------------|--------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------------------------------|------------------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %            | 19.03.2030            | £ 8.520         | \$ 126                                          | 0,03                         |
| Erhalt                                         | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500              | 19.03.2035            | 500             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,000              | 18.12.2025            | \$ 4.400        | (46)                                            | (0,01)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,410              | 05.09.2034            | 400             | 13                                              | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,500              | 20.06.2054            | 5.400           | 254                                             | 0,05                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,555              | 28.08.2034            | 600             | 12                                              | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,620              | 30.11.2029            | 7.946           | (74)                                            | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,642              | 15.02.2055            | 500             | 25                                              | 0,01                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,655              | 15.02.2055            | 100             | 5                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 18.12.2029            | 4.000           | 43                                              | 0,01                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,750              | 15.05.2032            | 8.205           | (116)                                           | (0,02)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,807              | 15.02.2055            | 300             | 6                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,842              | 04.03.2030            | 700             | (10)                                            | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,848              | 15.02.2055            | 1.900           | 24                                              | 0,01                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,900              | 15.02.2035            | 22.650          | (313)                                           | (0,07)                       |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,915              | 15.02.2055            | 700             | 1                                               | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,943              | 15.02.2055            | 700             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,945              | 15.02.2055            | 800             | (3)                                             | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,100              | 15.11.2052            | 1.154           | (29)                                            | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                 | 12,030             | 04.01.2027            | BRL 30.900      | (136)                                           | (0,03)                       |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                 | 13,402             | 02.01.2029            | 21.300          | 32                                              | 0,01                         |
| Zahlung                                        | 1-Year BRL-CDI                 | 13,926             | 04.01.2027            | 44.600          | (23)                                            | (0,01)                       |
| Zahlung                                        | 6-Month AUD-BBR-BBSW           | 4,250              | 19.03.2030            | AUD 13.000      | 140                                             | 0,03                         |
| Erhalt                                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 0,000              | 17.03.2053            | € 3.850         | 2.086                                           | 0,44                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2030            | 18.490          | 232                                             | 0,05                         |
| Zahlung <sup>(3)</sup>                         | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2035            | 700             | 3                                               | 0,00                         |
| Erhalt <sup>(3)</sup>                          | 6-Month EUR-EURIBOR            | 2,250              | 17.09.2055            | 2.710           | 104                                             | 0,02                         |
| Zahlung                                        | 28-Day MXN-TIIE                | 7,582              | 02.04.2030            | MXN 10.200      | (2)                                             | 0,00                         |
| Erhalt                                         | 28-Day MXN-TIIE                | 7,768              | 12.06.2030            | 8.100           | (1)                                             | 0,00                         |
|                                                |                                |                    |                       |                 | \$ 2.347                                        | 0,49                         |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                |                    |                       |                 | \$ 2.753                                        | 0,58                         |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

<sup>(3)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

## VERKAUFSOPTIONEN

## CREDIT DEFAULT SWAPTION AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/<br>-verkauf | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|----------------------------------|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850 %            | 16.07.2025         | 800                            | \$ (1)  | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900              | 16.07.2025         | 1.600                          | (2)     | 0              | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 1,000              | 16.07.2025         | 800                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,850              | 16.07.2025         | 800                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf                 | 0,900              | 16.07.2025         | 800                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                  |                         |                    |                    |                                | \$ (6)  | \$ 0           | 0,00                         |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,555 %            | 24.07.2025         | 300                            | \$ (1)  | \$ (1)         | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,637              | 18.07.2025         | 400                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,700              | 21.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,770              | 09.07.2025         | 400                            | (1)     | (4)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,905              | 24.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,037              | 18.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,050              | 21.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,050              | 21.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Beschreibung                          | Variable Zinssatzindex | Zahlung/<br>Erhalt<br>variabler<br>Zinssatz | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| CBK        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,120 %            | 09.07.2025         | 400                            | \$ (1)  | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,564              | 24.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,605              | 23.07.2025         | 400                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,914              | 24.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,955              | 23.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR    | Erhalt                                      | 2,380              | 03.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 6-Month EUR-EURIBOR    | Erhalt                                      | 2,460              | 16.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR    | Zahlung                                     | 2,640              | 03.07.2025         | 100                            | 0       | 0              | 0,00                         |
| FAR        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 6-Month EUR-EURIBOR    | Zahlung                                     | 2,720              | 16.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,750              | 03.07.2025         | 400                            | (2)     | (3)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,790              | 09.07.2025         | 400                            | (1)     | (4)            | (0,01)                       |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,100              | 03.07.2025         | 400                            | (2)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,140              | 09.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,525              | 28.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
| GLM        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,583              | 23.07.2025         | 200                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,653              | 14.07.2025         | 500                            | (2)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,680              | 07.07.2025         | 200                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,695              | 17.07.2025         | 400                            | (1)     | (3)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,775              | 07.07.2025         | 400                            | (1)     | (4)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,875              | 28.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 3,933              | 23.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,030              | 07.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,053              | 14.07.2025         | 500                            | (2)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,095              | 17.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| JPM        | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,125              | 07.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,772              | 10.07.2025         | 400                            | (1)     | (4)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,122              | 10.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
| MYC        | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,664              | 14.07.2025         | 500                            | (2)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,669              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | (1)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,697              | 16.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,715              | 02.07.2025         | 400                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                                      | 3,725              | 03.07.2025         | 300                            | (1)     | (2)            | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,019              | 07.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,064              | 14.07.2025         | 500                            | (2)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,065              | 02.07.2025         | 400                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,075              | 03.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                                     | 4,097              | 16.07.2025         | 300                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                       |                        |                                             |                    |                    |                                | \$ (48) | \$ (47)        | (0,01)                       |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung                                                                  | Ausübungs-<br>kurs | Verfalls-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------------------|---------|----------------|------------------------------|
| SAL        | Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055  | \$ 92,469          | 07.07.2025         | 200                            | \$ (1)  | \$ 0           | 0,00                         |
|            | Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2055 | 96,469             | 07.07.2025         | 200                            | (1)     | 0              | 0,00                         |
|            |                                                                               |                    |                    |                                | \$ (2)  | \$ 0           | 0,00                         |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF<sup>(1)</sup>

| Kontrahent | Referenzeinheit                       | Zu erhaltender<br>Festzinssatz | Fälligkeits-<br>datum | Nenn-<br>betrag <sup>(2)</sup> | Gezahlte/<br>(erhaltene)<br>Abschlussprämien | Nicht realisierte<br>Wertzunahme/<br>(-abnahme) | Markt-<br>wert | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|------------|---------------------------------------|--------------------------------|-----------------------|--------------------------------|----------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------|------------------------------|
| BOA        | Brazil Government International Bond  | 1,000 %                        | 20.06.2026            | \$ 100                         | \$ (4)                                       | \$ 5                                            | \$ 1           | 0,00                         |
| BRC        | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. | 1,000                          | 20.12.2025            | 500                            | 11                                           | (9)                                             | 2              | 0,00                         |
| GST        | Petroleos Mexicanos                   | 4,850                          | 07.05.2026            | 672                            | 0                                            | 8                                               | 8              | 0,01                         |
|            | SoftBank Group Corp.                  | 1,000                          | 20.06.2026            | 100                            | (1)                                          | 1                                               | 0              | 0,00                         |
| MYC        | Brazil Government International Bond  | 1,000                          | 20.06.2027            | 1.000                          | (62)                                         | 69                                              | 7              | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2026            | 200                            | 1                                            | 0                                               | 1              | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond  | 1,000                          | 20.06.2028            | 100                            | (3)                                          | 4                                               | 1              | 0,00                         |
|            | Mexico Government International Bond  | 1,000                          | 20.12.2028            | 300                            | (3)                                          | 5                                               | 2              | 0,00                         |
|            |                                       |                                |                       |                                | \$ (61)                                      | \$ 83                                           | \$ 22          | 0,01                         |

<sup>(1)</sup> Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

<sup>(2)</sup> Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis, wie in den Bedingungen der betreffenden Swapvereinbarung definiert, eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRÄKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | CNH                    | 4.212                    | \$ 585                           | \$ 0                               | \$ (4)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 2.406                    | AUD 3.704                        | 22                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | AUD                    | 3.704                    | \$ 2.408                         | 0                                  | (21)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 4.212                    | 584                              | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |
| BOA        | 08.2025               | \$                     | 58                       | CNH 411                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 21.079                   | \$ 23.967                        | 0                                  | (777)                                                | (0,16)                  |
|            | 07.2025               | IDR                    | 1.695.264                | 104                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 5                        | ILS 18                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 100                      | KRW 136.016                      | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 22                       | SGD 28                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 28                       | \$ 22                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 2.901                    | 99                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 294                      | CNH 2.100                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 10.2025               |                        | 165                      | PEN 608                          | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | THB                    | 161                      | \$ 5                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 5.383                    | 166                              | 0                                  | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 10                       | IDR 159.290                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 50                       | THB 1.654                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 3.758                    | \$ 115                           | 0                                  | (15)                                                 | 0,00                    |
| BRC        | 08.2025               | \$                     | 344                      | CNH 2.454                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 569                      | \$ 652                           | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TRY                    | 1.307                    | 32                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 9.784                    | £ 7.191                          | 71                                 | 0                                                    | 0,01                    |
|            | 07.2025               |                        | 15                       | ¥ 2.182                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BSH        | 07.2025               |                        | 65                       | TRY 2.679                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 53.873                   | \$ 2.980                         | 0                                  | (46)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | £                      | 7.191                    | 9.786                            | 0                                  | (71)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | DKK                    | 1.347                    | 205                              | 0                                  | (7)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | PEN                    | 2.501                    | 677                              | 0                                  | (27)                                                 | (0,01)                  |
| CBK        | 09.2025               |                        | 3.058                    | 835                              | 0                                  | (25)                                                 | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 34                       | PEN 122                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | 414                      | \$ 112                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | €                      | 363                      | 415                              | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 23.400                   | 164                              | 2                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | KRW                    | 466.380                  | 339                              | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | PEN                    | 2.398                    | 652                              | 0                                  | (24)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | THB                    | 1.577                    | 47                               | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 9.899                    | 304                              | 0                                  | (37)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$                     | 546                      | £ 403                            | 6                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               |                        | 37                       | IDR 609.692                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 227                      | KRW 310.535                      | 3                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 723                      | PEN 2.584                        | 5                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 20                       | THB 668                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 654                      | TWD 19.441                       | 15                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH                    | 1.341                    | \$ 187                           | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 870                      | 10                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD                    | 9.439                    | 290                              | 0                                  | (38)                                                 | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$                     | 36                       | INR 3.066                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 70                       | PEN 253                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 09.2025               | PEN                    | 3.981                    | \$ 1.101                         | 0                                  | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 159                      | DKK 1.014                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 25.921                   | € 22.344                         | 308                                | 0                                                    | 0,06                    |
|            | 07.2025               |                        | 35                       | TWD 1.029                        | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DKK                    | 1.011                    | \$ 159                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | €                      | 22.295                   | 25.921                           | 0                                  | (308)                                                | (0,06)                  |
|            | 08.2025               | INR                    | 432                      | 5                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | \$                     | 2                        | MXN 30                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | AUD                    | 3.704                    | \$ 2.390                         | 0                                  | (38)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | BRL                    | 176                      | 32                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| GLM        | 07.2025               | CHF                    | 40                       | 49                               | 0                                  | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH                    | 2.142                    | 298                              | 0                                  | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥                      | 304.608                  | 2.093                            | 0                                  | (16)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 31                       | BRL 176                          | 1                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 50                       | CHF 40                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 217                      | DKK 1.378                        | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 8.392                    | ¥ 1.203.828                      | 0                                  | (58)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               |                        | 17                       | SGD 22                           | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CHF                    | 40                       | \$ 50                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | DKK                    | 1.374                    | 217                              | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR                    | 308                      | 4                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD                    | 22                       | 17                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$                     | 54                       | CNH 384                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               |                        | 2.093                    | ¥ 303.488                        | 16                                 | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               | MXN                    | 24.840                   | \$ 1.276                         | 0                                  | (29)                                                 | (0,01)                  |
|            | 09.2025               | \$                     | 32                       | BRL 179                          | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 09.2025               |                        | 0                        | PEN 1                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN                    | 1.484                    | \$ 404                           | 0                                  | (12)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD                    | 1.415                    | 44                               | 0                                  | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$                     | 9                        | IDR 144.618                      | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               |                        | 7                        | SGD 9                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR                    | 225                      | \$ 12                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| JPM        | 08.2025               | SGD 9                  | \$ 7                     | \$ 0                             | \$ 0                               | \$ 0                                                 | 0,00                    |
|            | 12.2025               | PEN 3.058              | 832                      | 0                                | (26)                               | (26)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | CNH 4.059              | 562                      | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | DKK 1.044              | 158                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD 195                | 152                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD 5.450              | 168                      | 0                                | (20)                               | (20)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 1.394               | CAD 1.914                | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 19                     | KRW 25.859               | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 14                     | SGD 18                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 87                     | TWD 2.593                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ZAR 15.275             | \$ 855                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 3.844              | 533                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | INR 208                | 2                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD 18                 | 14                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD 6.572              | 202                      | 0                                | (27)                               | (27)                                                 | (0,01)                  |
| MBC        | 08.2025               | \$ 277                 | CNH 1.978                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CAD 4.683              | \$ 3.410                 | 0                                | (22)                               | (22)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CNH 1.946              | 270                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | € 333                  | 382                      | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £ 283                  | 382                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | SGD 468                | 365                      | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB 787                | 24                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | TWD 2.541              | 78                       | 0                                | (10)                               | (10)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 2.016               | CAD 2.771                | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 368                    | ¥ 52.806                 | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 376                    | SGD 486                  | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 30                     | THB 1.000                | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 75                     | TWD 2.377                | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CAD 2.766              | \$ 2.016                 | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 2.184              | 302                      | 0                                | (4)                                | (4)                                                  | 0,00                    |
| MYI        | 08.2025               | SGD 485                | 376                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD 1.847              | 56                       | 0                                | (8)                                | (8)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 130                 | CNH 943                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £ 15                   | \$ 20                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥ 102.433              | 703                      | 0                                | (6)                                | (6)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 653                 | € 557                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 359                    | £ 262                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 188                    | ¥ 27.194                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 55                     | CNH 392                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 703                    | ¥ 102.057                | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 68                     | CNH 493                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥ 703.841              | \$ 4.855                 | 0                                | (18)                               | (18)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 41                  | IDR 672.604              | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 75                     | SGD 97                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 854                    | TWD 25.291               | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,00                    |
| RBC<br>SCX | 08.2025               | INR 216                | \$ 3                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | SGD 97                 | 75                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | TWD 1.105              | 34                       | 0                                | (5)                                | (5)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 457                 | CNH 3.299                | 6                                | 0                                  | 6                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 8                      | ¥ 1.137                  | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | ¥ 169.063              | \$ 1.171                 | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 1.171               | ¥ 168.443                | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | £ 7.311                | \$ 9.899                 | 0                                | (120)                              | (120)                                                | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | TWD 477                | 16                       | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 11.2025               | PEN 1.374              | 373                      | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | THB 2                  | 0                        | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 123                 | ¥ 17.744                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CNH 316                | \$ 44                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 121                 | CNH 876                  | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 538                           | \$ (1.991)                         | \$ (1.453)                                           | (0,31)                  |

### ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 40.771               | \$ 47.738                | \$ 0                             | \$ (121)                           | \$ (121)                                             | (0,03)                  |
|            | 07.2025               | \$ 42.317              | € 37.244                 | 1.401                            | 0                                  | 1.401                                                | 0,29                    |
| BOA        | 08.2025               | 47.843                 | 40.771                   | 121                              | 0                                  | 121                                                  | 0,03                    |
|            | 07.2025               | 49.966                 | 43.943                   | 1.618                            | 0                                  | 1.618                                                | 0,34                    |
| BPS        | 07.2025               | € 72                   | \$ 83                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 120                 | € 105                    | 4                                | 0                                  | 4                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | € 2.328                | \$ 2.643                 | 0                                | (89)                               | (89)                                                 | (0,02)                  |
|            | 07.2025               | \$ 50.159              | € 44.168                 | 1.689                            | 0                                  | 1.689                                                | 0,36                    |
| CBK        | 07.2025               | € 330                  | \$ 378                   | 0                                | (9)                                | (9)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 165                 | € 143                    | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | € 41.118               | \$ 47.701                | 0                                | (566)                              | (566)                                                | (0,12)                  |
|            | 08.2025               | \$ 47.701              | € 41.028                 | 564                              | 0                                  | 564                                                  | 0,12                    |
| MBC        | 07.2025               | € 3.868                | \$ 4.491                 | 0                                | (50)                               | (50)                                                 | (0,01)                  |
|            | 07.2025               | \$ 9                   | € 8                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 5.400                         | \$ (836)                           | \$ 4.564                                             | 0,96                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |      |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|------|
| AZD                              | 07.2025               | £                      | 6.219                    | \$ 8.533                         | \$ 12                              | \$ 12                                                | 0,00                    |      |
|                                  | 08.2025               | \$                     | 8.534                    | £ 6.219                          | 0                                  | (11)                                                 | 0,00                    |      |
| BOA                              | 07.2025               |                        | 39                       | 29                               | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| BRC                              | 07.2025               | £                      | 6.833                    | \$ 9.297                         | 0                                  | (67)                                                 | (0,01)                  |      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 8.682                    | £ 6.430                          | 129                                | 129                                                  | 0,03                    |      |
|                                  | 08.2025               |                        | 9.277                    | 6.817                            | 67                                 | 67                                                   | 0,01                    |      |
| CBK                              | 07.2025               |                        | 736                      | 543                              | 8                                  | 8                                                    | 0,00                    |      |
| JPM                              | 07.2025               | £                      | 14                       | \$ 19                            | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 8.791                    | £ 6.525                          | 151                                | 151                                                  | 0,03                    |      |
| MBC                              | 07.2025               | £                      | 260                      | \$ 353                           | 0                                  | (4)                                                  | 0,00                    |      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 26                       | £ 19                             | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |      |
| SSB                              | 07.2025               | £                      | 6.765                    | \$ 9.277                         | 6                                  | 6                                                    | 0,00                    |      |
|                                  | 07.2025               | \$                     | 8.803                    | £ 6.501                          | 106                                | 106                                                  | 0,02                    |      |
|                                  | 08.2025               |                        | 9.278                    | 6.765                            | 0                                  | (6)                                                  | 0,00                    |      |
| UAG                              | 07.2025               |                        | 59                       | 43                               | 1                                  | 1                                                    | 0,00                    |      |
|                                  |                       |                        |                          |                                  | \$ 480                             | \$ (88)                                              | \$ 392                  | 0,08 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 3.478                                             | 0,73                    |      |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 479.063                                           | 100,85                  |      |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (4.056)                                           | (0,85)                  |      |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 475.007                                           | 100,00                  |      |

#### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2025 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von 2.045 USD (31. Dezember 2024: 20.115 USD) als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurde zum 30. Juni 2025 ein Wertpapier mit einem Gesamtmarktwert von null USD (31. Dezember 2024: 1.022 USD) als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 13.217 USD (31. Dezember 2024: 10.923 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 110 USD (31. Dezember 2024: 2.070 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 704                                                                      | \$ 439.112                                                      | \$ 1.108                                                     | \$ 440.924        |
| Investmentfonds               | 10.357                                                                      | 0                                                               | 0                                                            | 10.357            |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 16.600                                                          | 0                                                            | 16.600            |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 79                                                                          | 11.103                                                          | 0                                                            | 11.182            |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 11.140</b>                                                            | <b>\$ 466.815</b>                                               | <b>\$ 1.108</b>                                              | <b>\$ 479.063</b> |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert         |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 744                                                                      | \$ 558.368                                                      | \$ 811                                                       | \$ 559.923        |
| Investmentfonds               | 109                                                                         | 0                                                               | 0                                                            | 109               |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 0                                                                           | (1.666)                                                         | 0                                                            | (1.666)           |
| <b>Summen</b>                 | <b>\$ 853</b>                                                               | <b>\$ 556.702</b>                                               | <b>\$ 811</b>                                                | <b>\$ 558.366</b> |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2025:

| Kontrahent                         | Kredit-<br>zins | Abrechnungs-<br>datum | Fälligkeits-<br>datum | Kredit-<br>betrag | Verbindlichkeiten<br>aus umgekehrten<br>Pensions-<br>geschäften | % des<br>Nettovermögens |
|------------------------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------------------------------------------------|-------------------------|
| BOS                                | 4,250 %         | 23.06.2025            | 01.08.2025            | \$ (1.171)        | \$ (1.172)                                                      | (0,25)                  |
| MEI                                | 4,270           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (584)             | (585)                                                           | (0,12)                  |
|                                    | 3,000           | 23.06.2025            | 01.08.2025            | (163)             | (163)                                                           | (0,03)                  |
| Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte |                 |                       |                       |                   | \$ (1.920)                                                      | (0,40)                  |

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum 30. Juni 2025                   |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ 1.393                            | \$ (1.260)                            | \$ 133                              | \$ k. A.                            | \$ k. A.                              | \$ k. A.                            |
| BOA        | 838                                 | (570)                                 | 268                                 | (19)                                | 0                                     | (19)                                |
| BPS        | (31)                                | 0                                     | (31)                                | 214                                 | 0                                     | 214                                 |
| BRC        | 1.670                               | (1.570)                               | 100                                 | (789)                               | 620                                   | (169)                               |
| BSH        | (62)                                | 20                                    | (42)                                | (7)                                 | 0                                     | (7)                                 |
| CBK        | (104)                               | 0                                     | (104)                               | (67)                                | 0                                     | (67)                                |
| DUB        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | (1.015)                             | 890                                   | (125)                               |
| FAR        | (146)                               | 0                                     | (146)                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| GLM        | (44)                                | 0                                     | (44)                                | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 |
| GST        | 8                                   | 0                                     | 8                                   | 1                                   | 0                                     | 1                                   |
| IND        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 12                                  | 0                                     | 12                                  |
| JPM        | 89                                  | 0                                     | 89                                  | 18                                  | 0                                     | 18                                  |
| MBC        | (110)                               | 0                                     | (110)                               | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MYC        | 2                                   | 90                                    | 92                                  | (6)                                 | 90                                    | 84                                  |
| MYI        | 1                                   | (10)                                  | (9)                                 | 5                                   | 70                                    | 75                                  |
| RBC        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 178                                 | 0                                     | 178                                 |
| SCX        | 0                                   | 0                                     | 0                                   | (425)                               | 400                                   | (25)                                |
| SSB        | (28)                                | 0                                     | (28)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| UAG        | 2                                   | 0                                     | 2                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 66,01             | 60,63             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 19,70             | 25,52             |
| Investmentfonds                                                        | 2,01              | 0,02              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 3,23              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,97              | 0,00              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,72              | 0,37              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 1,25              | 0,20              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 6,11              | 13,26             |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                                      | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung                         | 0,26              | 0,79              |
| Unternehmensanleihen und Wechsel                           | 82,49             | 90,17             |
| Kommunalanleihen und Wechsel                               | 0,07              | 0,06              |
| US-Regierungsbehörden                                      | 3,12              | 13,91             |
| US-Schatzobligationen                                      | 1,15              | 3,50              |
| Non-Agency-MBS                                             | 0,52              | 0,69              |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere                           | 0,37              | 0,68              |
| Staatsemissionen                                           | 4,70              | 3,31              |
| Vorzugswertpapiere                                         | 0,15              | 0,15              |
| Kurzfristige Instrumente                                   | k. A.             | 0,10              |
| Investmentfonds                                            | 2,18              | 0,02              |
| Pensionsgeschäfte                                          | 3,49              | k. A.             |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate        |                   |                   |
| Futures                                                    | 1,05              | (0,33)            |
| Verkaufsoptionen                                           |                   |                   |
| Future-Style-Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01)            | 0,00              |

| Anlagen zum Marktwert                                                                  | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,05              | 0,05              |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf                                 | 0,04              | 0,01              |
| Zinsswaps                                                                              | 0,49              | 0,32              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                                             |                   |                   |
| Optionskauf                                                                            |                   |                   |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | 0,01              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | k. A.             | 0,00              |
| Verkaufsoptionen                                                                       |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes                                                 | 0,00              | k. A.             |
| Devisenoptionen                                                                        | k. A.             | 0,00              |
| Zinsswapoptionen                                                                       | (0,01)            | (0,01)            |
| Optionen auf Wertpapiere                                                               | 0,00              | k. A.             |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemissionen – Schutzverkauf | 0,01              | 0,00              |
| Devisenterminkontrakte                                                                 | (0,31)            | 0,22              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                                                    | 1,04              | (0,60)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                                                            | (0,85)            | (13,05)           |
| Nettovermögen                                                                          | 100,00            | 100,00            |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund

| BESCHREIBUNG                                                                 | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE</b>                                              |                |                          |                                   |
| <b>AUSTRALIEN</b>                                                            |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                                   |
| Latitude Australia Personal Loans Series<br>4,721 % fällig am 17.09.2033 AUD | 8.080          | \$ 5.294                 | 0,21                              |
| Panorama Auto Trust<br>4,705 % fällig am 15.03.2033                          | 11.998         | 7.848                    | 0,31                              |
| Pepper SPARKZ Trust<br>4,735 % fällig am 15.01.2033                          | 6.326          | 4.144                    | 0,16                              |
| Plenti Auto ABS<br>4,853 % fällig am 12.08.2033                              | 5.171          | 3.392                    | 0,13                              |
|                                                                              |                | 20.678                   | 0,81                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                      |                |                          |                                   |
| Canadian Imperial Bank of Commerce<br>4,384 % fällig am 20.12.2027           | 26.300         | 17.274                   | 0,67                              |
| Dyno Nobel Ltd.<br>4,300 % fällig am 18.03.2026                              | 6.590          | 4.319                    | 0,17                              |
| Optus Finance Pty. Ltd.<br>1,600 % fällig am 01.07.2025                      | 600            | 393                      | 0,01                              |
| Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.<br>4,752 % fällig am 21.04.2026    | 2.300          | 1.506                    | 0,06                              |
| Woodside Finance Ltd.<br>3,700 % fällig am 15.09.2026                        | \$ 5.400       | 5.346                    | 0,21                              |
|                                                                              |                | 28.838                   | 1,12                              |
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                                        |                |                          |                                   |
| AFG Trust<br>4,528 % fällig am 10.07.2056 AUD                                | 2.841          | 1.861                    | 0,07                              |
| FirstMac Mortgage Funding Trust<br>4,815 % fällig am 16.09.2056              | 13.005         | 8.514                    | 0,33                              |
| Liberty Trust<br>4,423 % fällig am 25.09.2056                                | 4.197          | 2.750                    | 0,11                              |
|                                                                              | 7.900          | 5.173                    | 0,20                              |
| ORDE Trust<br>4,555 % fällig am 11.06.2056                                   | 996            | 653                      | 0,03                              |
|                                                                              | 24.500         | 16.062                   | 0,63                              |
| Triton Trust<br>4,503 % fällig am 12.03.2057                                 | 3.587          | 2.352                    | 0,09                              |
|                                                                              | 10.200         | 6.679                    | 0,26                              |
|                                                                              |                | 44.044                   | 1,72                              |
| Summe Australien                                                             |                | 93.560                   | 3,65                              |
| <b>BERMUDA</b>                                                               |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                      |                |                          |                                   |
| TSTAT Ltd.<br>5,419 % fällig am 20.07.2037                                   | \$ 3.275       | 3.278                    | 0,13                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                      |                |                          |                                   |
| Aircastle Ltd.<br>4,250 % fällig am 15.06.2026                               | 21.800         | 21.707                   | 0,85                              |
|                                                                              | 4.000          | 3.999                    | 0,15                              |
|                                                                              |                | 25.706                   | 1,00                              |
| Summe Bermuda                                                                |                | 28.984                   | 1,13                              |
| <b>KANADA</b>                                                                |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                      |                |                          |                                   |
| Algonquin Power & Utilities Corp.<br>5,365 % fällig am 15.06.2026            | 5.200          | 5.229                    | 0,20                              |
| Bank of Montreal<br>5,274 % fällig am 10.09.2027                             | 13.300         | 13.342                   | 0,52                              |
| Bank of Nova Scotia<br>5,169 % fällig am 04.06.2027                          | 200            | 201                      | 0,01                              |
| Canadian Imperial Bank of Commerce<br>5,326 % fällig am 11.09.2027           | 1.500          | 1.506                    | 0,06                              |
|                                                                              | 3.500          | 3.533                    | 0,14                              |
| Federation des Caisses Desjardins du Quebec<br>4,985 % fällig am 27.01.2027  | 9.300          | 9.308                    | 0,36                              |
| National Bank of Canada<br>5,312 % fällig am 25.03.2027                      | 7.400          | 7.408                    | 0,29                              |
|                                                                              | 17.250         | 17.290                   | 0,68                              |
| Royal Bank of Canada<br>4,925 % fällig am 27.04.2026                         | 300            | 301                      | 0,01                              |
|                                                                              | 7.000          | 7.024                    | 0,27                              |

| BESCHREIBUNG                                                     | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 5,183 % fällig am 24.01.2029                                     | \$ 6.900       | \$ 6.891                 | 0,27                              |
| 5,208 % fällig am 18.10.2028                                     | 2.600          | 2.604                    | 0,10                              |
| 5,234 % fällig am 27.03.2028                                     | 8.100          | 8.127                    | 0,32                              |
| Toronto-Dominion Bank<br>4,362 % fällig am 17.03.2026 AUD        | 2.000          | 1.310                    | 0,05                              |
| Summe Kanada                                                     |                | 84.074                   | 3,28                              |
| <b>KAIMANINSELN</b>                                              |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                          |                |                          |                                   |
| Atlas Senior Loan Fund Ltd.<br>5,608 % fällig am 15.01.2031      | \$ 350         | 351                      | 0,01                              |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.<br>5,299 % fällig am 21.10.2034     | 9.800          | 9.753                    | 0,38                              |
|                                                                  | 6.400          | 6.384                    | 0,25                              |
|                                                                  | 10.000         | 10.024                   | 0,39                              |
| Catamaran CLO Ltd.<br>5,634 % fällig am 22.04.2030               | 189            | 189                      | 0,01                              |
| CBAM Ltd.<br>5,561 % fällig am 17.04.2031                        | 977            | 979                      | 0,04                              |
| Dryden CLO Ltd.<br>5,568 % fällig am 15.07.2031                  | 369            | 370                      | 0,01                              |
| Dryden Senior Loan Fund<br>5,418 % fällig am 15.04.2029          | 181            | 181                      | 0,01                              |
| Greenwood Park CLO Ltd.<br>5,528 % fällig am 15.04.2031          | 1.649          | 1.651                    | 0,06                              |
| Greywolf CLO Ltd.<br>5,709 % fällig am 20.10.2031                | 1.772          | 1.773                    | 0,07                              |
| Octagon Investment Partners Ltd.<br>5,482 % fällig am 16.04.2031 | 88             | 88                       | 0,00                              |
|                                                                  | 181            | 181                      | 0,01                              |
| Octagon Loan Funding Ltd.<br>5,766 % fällig am 18.11.2031        | 2.311          | 2.316                    | 0,09                              |
| OZLM Ltd.<br>5,538 % fällig am 15.04.2031                        | 297            | 298                      | 0,01                              |
|                                                                  | 309            | 309                      | 0,01                              |
| Sound Point CLO Ltd.<br>5,681 % fällig am 18.04.2031             | 2.186          | 2.189                    | 0,09                              |
| Steele Creek CLO Ltd.<br>5,528 % fällig am 15.04.2031            | 1.591          | 1.593                    | 0,06                              |
| Trinitas CLO Ltd.<br>5,612 % fällig am 25.01.2034                | 3.000          | 3.004                    | 0,12                              |
|                                                                  | 6.000          | 6.004                    | 0,24                              |
| Venture CLO Ltd.<br>5,578 % fällig am 07.09.2030                 | 384            | 384                      | 0,02                              |
|                                                                  |                | 48.021                   | 1,88                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                          |                |                          |                                   |
| Avolon Holdings Funding Ltd.<br>2,125 % fällig am 21.02.2026     | 2.921          | 2.867                    | 0,11                              |
|                                                                  | 5.384          | 5.393                    | 0,21                              |
| Suci Second Investment Co.<br>4,375 % fällig am 10.09.2027       | 5.400          | 5.372                    | 0,21                              |
|                                                                  |                | 13.632                   | 0,53                              |
| Summe Kaimaninseln                                               |                | 61.653                   | 2,41                              |
| <b>DÄNEMARK</b>                                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                          |                |                          |                                   |
| Danske Bank A/S<br>1,621 % fällig am 11.09.2026                  | 4.400          | 4.373                    | 0,17                              |
| <b>FINNLAND</b>                                                  |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                          |                |                          |                                   |
| Nordea Bank Abp<br>5,145 % fällig am 19.03.2027                  | 3.630          | 3.649                    | 0,14                              |
| <b>FRANKREICH</b>                                                |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                          |                |                          |                                   |
| Cars Alliance Auto Leases France<br>2,549 % fällig am 21.10.2038 | € 2.881        | 3.387                    | 0,13                              |
| Red & Black Auto Lease France<br>2,536 % fällig am 27.06.2039    | 6.400          | 7.522                    | 0,30                              |
|                                                                  |                | 10.909                   | 0,43                              |

| BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                 |                |                          |                                   |
| Banque Federative du Credit Mutuel S.A.<br>1,604 % fällig am 04.10.2026 | \$ 1.242       | \$ 1.200                 | 0,05                              |
|                                                                         | 11.100         | 11.156                   | 0,44                              |
|                                                                         | 6.125          | 6.163                    | 0,24                              |
|                                                                         | 1.900          | 1.917                    | 0,07                              |
| BNP Paribas S.A.<br>1,323 % fällig am 13.01.2027                        | 15.100         | 14.839                   | 0,58                              |
| BPCE S.A.<br>1,652 % fällig am 06.10.2026                               | 9.650          | 9.572                    | 0,37                              |
|                                                                         | 700            | 460                      | 0,02                              |
|                                                                         | \$ 12.014      | 12.097                   | 0,47                              |
| Credit Agricole S.A.<br>1,247 % fällig am 26.01.2027                    | 5.400          | 5.298                    | 0,21                              |
|                                                                         | 300            | 195                      | 0,01                              |
|                                                                         | \$ 2.995       | 3.001                    | 0,12                              |
|                                                                         | 3.100          | 3.119                    | 0,12                              |
|                                                                         | 3.100          | 3.123                    | 0,12                              |
| Electricite de France S.A.<br>3,625 % fällig am 13.10.2025              | 610            | 608                      | 0,02                              |
|                                                                         |                | 72.748                   | 2,84                              |
| Summe Frankreich                                                        |                | 83.657                   | 3,27                              |
| <b>DEUTSCHLAND</b>                                                      |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                 |                |                          |                                   |
| Deutsche Bank AG<br>2,129 % fällig am 24.11.2026                        | 23.413         | 23.178                   | 0,91                              |
|                                                                         | 4.200          | 4.186                    | 0,16                              |
|                                                                         | 1.700          | 1.701                    | 0,07                              |
|                                                                         | 2.000          | 2.001                    | 0,08                              |
|                                                                         | 3.300          | 3.384                    | 0,13                              |
| Summe Deutschland                                                       |                | 34.450                   | 1,35                              |
| <b>IRLAND</b>                                                           |                |                          |                                   |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                 |                |                          |                                   |
| AlbaCore Euro CLO DAC<br>3,269 % fällig am 15.07.2035                   | € 15.650       | 18.395                   | 0,72                              |
| Black Diamond CLO DAC<br>3,123 % fällig am 15.05.2032                   | 3.072          | 3.606                    | 0,14                              |
| BNPP AM Euro CLO DAC<br>2,879 % fällig am 15.04.2031                    | 1.997          | 2.339                    | 0,09                              |
| Carlyle Euro CLO DAC<br>2,979 % fällig am 15.01.2031                    | 11.439         | 13.430                   | 0,53                              |
| Contego CLO DAC<br>2,823 % fällig am 23.01.2030                         | 13.421         | 15.732                   | 0,61                              |
| Henley CLO DAC<br>3,148 % fällig am 25.04.2034                          | 5.800          | 6.801                    | 0,27                              |
| Oak Hill European Credit Partners DAC<br>2,976 % fällig am 20.10.2031   | 688            | 806                      | 0,03                              |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,170 % fällig am 15.10.2034 | 9.400          | 11.004                   | 0,43                              |
|                                                                         |                | 72.113                   | 2,82                              |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                 |                |                          |                                   |
| AerCap Ireland Capital DAC<br>1,750 % fällig am 30.01.2026              | \$ 2.343       | 2.302                    | 0,09                              |
|                                                                         | 300            | 296                      | 0,01                              |
|                                                                         |                | 2.598                    | 0,10                              |
| Summe Irland                                                            |                | 74.711                   | 2,92                              |
| <b>ISRAEL</b>                                                           |                |                          |                                   |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                                 |                |                          |                                   |
| Israel Government International Bond<br>5,000 % fällig am 30.10.2026    | € 700          | 845                      | 0,03                              |
|                                                                         | \$ 1.200       | 1.224                    | 0,05                              |
| Summe Israel                                                            |                | 2.069                    | 0,08                              |
| <b>ITALIEN</b>                                                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                                 |                |                          |                                   |
| Intesa Sanpaolo SpA<br>7,000 % fällig am 21.11.2025                     | 1.000          | 1.008                    | 0,04                              |

| BESCHREIBUNG                                                          | PARI<br>(000S) | MARKT-<br>WERT<br>(000S) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------|--------------------------|-----------------------------------|
| <b>JAPAN</b>                                                          |                |                          |                                   |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                               |                |                          |                                   |
| Mizuho Financial Group, Inc.<br>5,446 % fällig am 13.05.2031          | \$ 10.300      | \$ 10.306                | 0,40                              |
| MUFG Bank Ltd.<br>4,678 % fällig am 17.02.2026 AUD                    | 300            | 197                      | 0,01                              |
| Nissan Motor Co. Ltd.<br>3,522 % fällig am 17.09.2025                 | \$ 9.382       | 9.330                    | 0,37                              |
| Nomura Holdings, Inc.<br>1,653 % fällig am 14.07.2026                 | 900            | 874                      | 0,03                              |
| 1,851 % fällig am 16.07.2025                                          | 5.600          | 5.593                    | 0,22                              |
| 5,099 % fällig am 03.07.2025                                          | 1.730          | 1.730                    | 0,07                              |
| 5,591 % fällig am 02.07.2027                                          | 2.100          | 2.115                    | 0,08                              |
| 5,709 % fällig am 09.01.2026                                          | 7.400          | 7.439                    | 0,29                              |
| NTT Finance Corp.<br>1,162 % fällig am 03.04.2026                     | 12.000         | 11.708                   | 0,46                              |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp.<br>4,946 % fällig am 28.07.2026 AUD     | 3.000          | 1.979                    | 0,08                              |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.<br>5,646 % fällig am 13.07.2026 | \$ 1.300       | 1.313                    | 0,05                              |
| 5,776 % fällig am 13.01.2026                                          | 9.700          | 9.758                    | 0,38                              |
| Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.<br>5,517 % fällig am 09.03.2026       | 759            | 763                      | 0,03                              |
| 5,554 % fällig am 14.09.2026                                          | 850            | 857                      | 0,03                              |
| 5,593 % fällig am 14.09.2026                                          | 2.000          | 2.016                    | 0,08                              |
| Summe Japan                                                           |                | 65.978                   | 2,58                              |

|                                                                  |        |        |      |
|------------------------------------------------------------------|--------|--------|------|
| <b>JERSEY, KANALINSELN</b>                                       |        |        |      |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                          |        |        |      |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.<br>0,000 % fällig am 22.04.2035 (b) | 21.500 | 21.500 | 0,84 |
| 0,000 % fällig am 15.07.2035 (b)                                 | 12.700 | 12.710 | 0,50 |
| 5,269 % fällig am 23.04.2035                                     | 12.300 | 12.263 | 0,48 |
| Summe Jersey, Kanalinseln                                        |        | 46.473 | 1,82 |

|                                                              |       |       |      |
|--------------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>LIBERIA</b>                                               |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                      |       |       |      |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>4,250 % fällig am 01.07.2026 | 200   | 199   | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 31.08.2026                                 | 4.200 | 4.218 | 0,16 |
| Summe Liberia                                                |       | 4.417 | 0,17 |

|                                                             |         |        |      |
|-------------------------------------------------------------|---------|--------|------|
| <b>LUXEMBURG</b>                                            |         |        |      |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                     |         |        |      |
| Compartment Driver UK Eight<br>4,824 % fällig am 25.09.2031 | £ 5.396 | 7.403  | 0,29 |
| Silver Arrow S.A.<br>4,773 % fällig am 20.01.2031           | 6.294   | 8.633  | 0,34 |
| Summe Luxemburg                                             |         | 16.036 | 0,63 |

|                                                         |          |       |      |
|---------------------------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>MULTINATIONAL</b>                                    |          |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |          |       |      |
| American Airlines, Inc.<br>5,500 % fällig am 20.04.2026 | \$ 1.533 | 1.531 | 0,06 |
| NXP BV<br>5,350 % fällig am 01.03.2026                  | 347      | 348   | 0,01 |
| Summe multinational                                     |          | 1.879 | 0,07 |

|                                                               |           |        |      |
|---------------------------------------------------------------|-----------|--------|------|
| <b>NIEDERLANDE</b>                                            |           |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                       |           |        |      |
| ABN AMRO Bank NV<br>4,817 % fällig am 24.02.2027              | £ 11.500  | 15.739 | 0,62 |
| 5,387 % fällig am 03.12.2028                                  | \$ 20.300 | 20.298 | 0,79 |
| Coöperatieve Rabobank UA<br>1,106 % fällig am 24.02.2027      | 12.150    | 11.885 | 0,46 |
| 5,002 % fällig am 28.08.2026                                  | 4.600     | 4.612  | 0,18 |
| Enel Finance International NV<br>7,050 % fällig am 14.10.2025 | 4.100     | 4.124  | 0,16 |
| ING Groep NV<br>1,400 % fällig am 01.07.2026                  | 6.725     | 6.725  | 0,26 |
| 5,422 % fällig am 25.03.2029                                  | 2.300     | 2.302  | 0,09 |
| 5,423 % fällig am 01.04.2027                                  | 6.600     | 6.619  | 0,26 |
| 5,956 % fällig am 11.09.2027                                  | 1.400     | 1.418  | 0,06 |
| Summe Niederlande                                             |           | 73.722 | 2,88 |

|                                                    |          |          |      |
|----------------------------------------------------|----------|----------|------|
| <b>NORWEGEN</b>                                    |          |          |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>            |          |          |      |
| DNB Bank ASA<br>5,896 % fällig am 09.10.2026       | \$ 3.600 | \$ 3.613 | 0,14 |
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                            |          |          |      |
| Kommunalbanken A/S<br>4,785 % fällig am 03.03.2028 | 20.000   | 20.021   | 0,78 |
| Summe Norwegen                                     |          | 23.634   | 0,92 |

|                                                         |       |       |      |
|---------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>SINGAPUR</b>                                         |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                 |       |       |      |
| DBS Group Holdings Ltd.<br>5,010 % fällig am 21.03.2028 | 2.200 | 2.205 | 0,09 |
| Flex Ltd.<br>3,750 % fällig am 01.02.2026               | 3.900 | 3.875 | 0,15 |
| Summe Singapur                                          |       | 6.080 | 0,24 |

|                                                |       |       |      |
|------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>SÜDKOREA</b>                                |       |       |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>        |       |       |      |
| SK Hynix, Inc.<br>1,500 % fällig am 19.01.2026 | 300   | 295   | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 16.01.2027                   | 2.580 | 2.616 | 0,10 |
| 6,250 % fällig am 17.01.2026                   | 1.400 | 1.414 | 0,06 |
|                                                |       | 4.325 | 0,17 |

|                                                          |       |       |      |
|----------------------------------------------------------|-------|-------|------|
| <b>STAATSEMISSIONEN</b>                                  |       |       |      |
| Korea National Oil Corp.<br>5,192 % fällig am 31.03.2028 | 1.200 | 1.200 | 0,05 |
| Summe Südkorea                                           |       | 5.525 | 0,22 |

|                                                                      |       |        |      |
|----------------------------------------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>SPANIEN</b>                                                       |       |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                              |       |        |      |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>5,862 % fällig am 14.09.2026 | 5.300 | 5.311  | 0,21 |
| Banco Santander S.A.<br>5,465 % fällig am 15.07.2028                 | 6.800 | 6.821  | 0,26 |
| Summe Spanien                                                        |       | 12.132 | 0,47 |

|                                                          |       |        |      |
|----------------------------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>SCHWEDEN</b>                                          |       |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                  |       |        |      |
| Svenska Handelsbanken AB<br>5,042 % fällig am 28.05.2027 | 2.200 | 2.206  | 0,09 |
| Swedbank AB<br>5,337 % fällig am 20.09.2027              | 3.300 | 3.368  | 0,13 |
| 5,828 % fällig am 15.06.2026                             | 8.500 | 8.583  | 0,33 |
| Summe Schweden                                           |       | 14.157 | 0,55 |

|                                              |       |        |      |
|----------------------------------------------|-------|--------|------|
| <b>SCHWEIZ</b>                               |       |        |      |
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>      |       |        |      |
| UBS Group AG<br>1,305 % fällig am 02.02.2027 | 4.000 | 3.925  | 0,15 |
| 1,364 % fällig am 30.01.2027                 | 5.200 | 5.106  | 0,20 |
| 6,373 % fällig am 15.07.2026                 | 7.100 | 7.107  | 0,28 |
| Summe Schweiz                                |       | 16.138 | 0,63 |

|                                                     |         |       |      |
|-----------------------------------------------------|---------|-------|------|
| <b>GROSSBRITANNIEN</b>                              |         |       |      |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>             |         |       |      |
| Bavarian Sky UK PLC<br>4,774 % fällig am 20.06.2032 | £ 3.200 | 4.389 | 0,17 |

|                                                             |          |       |      |
|-------------------------------------------------------------|----------|-------|------|
| <b>UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL</b>                     |          |       |      |
| Barclays PLC<br>4,375 % fällig am 12.01.2026                | \$ 3.550 | 3.548 | 0,14 |
| 5,304 % fällig am 09.08.2026                                | 4.800    | 4.801 | 0,19 |
| 5,887 % fällig am 12.03.2028                                | 5.400    | 5.443 | 0,21 |
| Harbour Energy PLC<br>5,500 % fällig am 15.10.2026          | 1.900    | 1.880 | 0,07 |
| HSBC Holdings PLC<br>4,292 % fällig am 12.09.2026           | 6.800    | 6.794 | 0,27 |
| 5,887 % fällig am 14.08.2027                                | 1.400    | 1.420 | 0,06 |
| 5,932 % fällig am 14.08.2027                                | 3.400    | 3.431 | 0,13 |
| 5,966 % fällig am 12.09.2026                                | 5.720    | 5.736 | 0,22 |
| 7,336 % fällig am 03.11.2026                                | 1.050    | 1.060 | 0,04 |
| Imperial Brands Finance PLC<br>3,500 % fällig am 26.07.2026 | 3.200    | 3.163 | 0,12 |
| Lloyds Banking Group PLC<br>4,716 % fällig am 11.08.2026    | 2.386    | 2.385 | 0,09 |

|                                                                                   |        |       |      |
|-----------------------------------------------------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>USA</b>                                                                        |        |       |      |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                           |        |       |      |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>5,559 % fällig am 25.03.2035        | \$ 114 | 113   | 0,00 |
| 5,565 % fällig am 25.03.2034                                                      | 20     | 22    | 0,00 |
| College Avenue Student Loans LLC<br>6,084 % fällig am 26.11.2046                  | 575    | 580   | 0,02 |
| Commonbond Student Loan Trust<br>2,730 % fällig am 25.10.2040                     | 144    | 140   | 0,01 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.<br>5,934 % fällig am 25.10.2034 | 138    | 138   | 0,01 |
| EquiFirst Mortgage Loan Trust<br>7,434 % fällig am 25.10.2034                     | 582    | 545   | 0,02 |
| Finance America Mortgage Loan Trust<br>5,259 % fällig am 25.08.2034               | 622    | 592   | 0,02 |
| First NLC Trust<br>4,504 % fällig am 25.08.2037                                   | 209    | 105   | 0,00 |
| Fremont Home Loan Trust<br>5,169 % fällig am 25.01.2035                           | 63     | 63    | 0,00 |
| Home Equity Asset Trust<br>5,379 % fällig am 25.06.2034                           | 308    | 307   | 0,01 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust<br>5,409 % fällig am 25.04.2035                    | 349    | 347   | 0,01 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust<br>5,134 % fällig am 25.09.2034               | 691    | 633   | 0,02 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust<br>5,484 % fällig am 25.09.2033            | 402    | 402   | 0,02 |
| Navient Private Education Loan Trust<br>5,146 % fällig am 15.12.2059              | 857    | 858   | 0,03 |
| 5,876 % fällig am 16.07.2040                                                      | 1.180  | 1.186 | 0,05 |
| 6,026 % fällig am 15.10.2031                                                      | 149    | 150   | 0,01 |
| 6,576 % fällig am 15.12.2045                                                      | 96     | 97    | 0,00 |
| Navient Student Loan Trust<br>6,126 % fällig am 15.11.2030                        | 1.355  | 1.357 | 0,05 |
| Nelnet Student Loan Trust<br>5,020 % fällig am 27.02.2051                         | 399    | 398   | 0,02 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust<br>5,094 % fällig am 25.01.2036                   | 44     | 44    | 0,00 |

|                                                                 |       |         |      |
|-----------------------------------------------------------------|-------|---------|------|
| <b>NON-AGENCY-MBS</b>                                           |       |         |      |
| Canada Square Funding PLC<br>5,019 % fällig am 17.06.2058       | 4.225 | 5.792   | 0,23 |
| Eurohome UK Mortgages PLC<br>4,508 % fällig am 15.06.2044       | 77    | 105     | 0,00 |
| Pierpont BTL PLC<br>5,079 % fällig am 21.09.2061                | 2.952 | 4.061   | 0,16 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>5,223 % fällig am 20.07.2053 | 7.726 | 10.611  | 0,42 |
| White Rose Master Issuer PLC<br>4,743 % fällig am 16.04.2073    | 6.693 | 9.194   | 0,36 |
|                                                                 |       | 29.763  | 1,17 |
| Summe Großbritannien                                            |       | 162.219 | 6,34 |

|                                                                                   |        |       |      |
|-----------------------------------------------------------------------------------|--------|-------|------|
| <b>USA</b>                                                                        |        |       |      |
| <b>FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE</b>                                           |        |       |      |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust<br>5,559 % fällig am 25.03.2035        | \$ 114 | 113   | 0,00 |
| 5,565 % fällig am 25.03.2034                                                      | 20     | 22    | 0,00 |
| College Avenue Student Loans LLC<br>6,084 % fällig am 26.11.2046                  | 575    | 580   | 0,02 |
| Commonbond Student Loan Trust<br>2,730 % fällig am 25.10.2040                     | 144    | 140   | 0,01 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.<br>5,934 % fällig am 25.10.2034 | 138    | 138   | 0,01 |
| EquiFirst Mortgage Loan Trust<br>7,434 % fällig am 25.10.2034                     | 582    | 545   | 0,02 |
| Finance America Mortgage Loan Trust<br>5,259 % fällig am 25.08.2034               | 622    | 592   | 0,02 |
| First NLC Trust<br>4,504 % fällig am 25.08.2037                                   | 209    | 105   | 0,00 |
| Fremont Home Loan Trust<br>5,169 % fällig am 25.01.2035                           | 63     | 63    | 0,00 |
| Home Equity Asset Trust<br>5,379 % fällig am 25.06.2034                           | 308    | 307   | 0,01 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust<br>5,409 % fällig am 25.04.2035                    | 349    | 347   | 0,01 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust<br>5,134 % fällig am 25.09.2034               | 691    | 633   | 0,02 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust<br>5,484 % fällig am 25.09.2033            | 402    | 402   | 0,02 |
| Navient Private Education Loan Trust<br>5,146 % fällig am 15.12.2059              | 857    | 858   | 0,03 |
| 5,876 % fällig am 16.07.2040                                                      | 1.180  | 1.186 | 0,05 |
| 6,026 % fällig am 15.10.2031                                                      | 149    | 150   | 0,01 |
| 6,576 % fällig am 15.12.2045                                                      | 96     | 97    | 0,00 |
| Navient Student Loan Trust<br>6,126 % fällig am 15.11.2030                        | 1.355  | 1.357 | 0,05 |
| Nelnet Student Loan Trust<br>5,020 % fällig am 27.02.2051                         | 399    | 398   | 0,02 |
| NovaStar Mortgage Funding Trust<br>5,094 % fällig am 25.01.2036                   | 44     | 44    | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG                                          | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS | BESCHREIBUNG                            | PARI<br>(000\$) | MARKT-<br>WERT<br>(000\$) | % DES<br>NETTO-<br>VERMÖ-<br>GENS |
|-------------------------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------------|-----------------|---------------------------|-----------------------------------|
| SLM Private Credit Student Loan Trust                 |                 |                           |                                   | Ford Motor Credit Co. LLC               |                 |                           |                                   | Pacific Gas & Electric Co.              |                 |                           |                                   |
| 4,870 % fällig am 15.06.2039                          | \$ 4.194        | \$ 4.083                  | 0,16                              | 3,375 % fällig am 13.11.2025            | \$ 2.150        | \$ 2.136                  | 0,08                              | 3,150 % fällig am 01.01.2026            | \$ 15.207       | \$ 15.064                 | 0,59                              |
| 4,910 % fällig am 15.06.2039                          | 3.555           | 3.468                     | 0,14                              | 4,134 % fällig am 04.08.2025            | 5.300           | 5.295                     | 0,21                              | 3,450 % fällig am 01.07.2025            | 1.600           | 1.600                     | 0,06                              |
| SLM Student Loan Trust                                |                 |                           |                                   | 4,389 % fällig am 08.01.2026            | 500             | 498                       | 0,02                              | Penske Truck Leasing Co. LP             |                 |                           |                                   |
| 5,070 % fällig am 27.12.2038                          | 724             | 711                       | 0,03                              | 7,341 % fällig am 06.03.2026            | 1.000           | 1.010                     | 0,04                              | 4,000 % fällig am 15.07.2025            | 2.500           | 2.499                     | 0,10                              |
| 5,525 % fällig am 25.07.2023                          | 385             | 378                       | 0,02                              | FS KKR Capital Corp.                    |                 |                           |                                   | Pinnacle West Capital Corp.             |                 |                           |                                   |
| 6,325 % fällig am 25.07.2023                          | 71              | 71                        | 0,00                              | 3,400 % fällig am 15.01.2026            | 1.000           | 991                       | 0,04                              | 5,214 % fällig am 10.06.2026            | 21.325          | 21.362                    | 0,83                              |
| SMB Private Education Loan Trust                      |                 |                           |                                   | GA Global Funding Trust                 |                 |                           |                                   | Reliance Standard Life Global Funding   |                 |                           |                                   |
| 2,820 % fällig am 15.10.2035                          | 815             | 805                       | 0,03                              | 1,625 % fällig am 15.01.2026            | 3.500           | 3.441                     | 0,13                              | 5,243 % fällig am 02.02.2026            | 1.500           | 1.504                     | 0,06                              |
| 3,600 % fällig am 15.01.2037                          | 1.594           | 1.571                     | 0,06                              | 2,250 % fällig am 06.01.2027            | 1.250           | 1.207                     | 0,05                              | Sammons Financial Group, Inc.           |                 |                           |                                   |
| 3,630 % fällig am 15.11.2035                          | 3.117           | 3.078                     | 0,12                              | 4,400 % fällig am 23.09.2027            | 1.300           | 1.298                     | 0,05                              | 4,450 % fällig am 12.05.2027            | 600             | 599                       | 0,02                              |
| 4,000 % fällig am 15.09.2042                          | 3.362           | 3.316                     | 0,13                              | General Motors Financial Co., Inc.      |                 |                           |                                   | Santander Holdings USA, Inc.            |                 |                           |                                   |
| 5,176 % fällig am 15.10.2035                          | 467             | 466                       | 0,02                              | 5,395 % fällig am 15.07.2027            | 5.500           | 5.493                     | 0,21                              | 4,500 % fällig am 17.07.2025            | 3.400           | 3.399                     | 0,13                              |
| 5,176 % fällig am 15.11.2035                          | 667             | 666                       | 0,03                              | 5,711 % fällig am 08.05.2027            | 3.700           | 3.696                     | 0,14                              | Southern California Edison Co.          |                 |                           |                                   |
| SoFi Professional Loan Program LLC                    |                 |                           |                                   | 6,050 % fällig am 10.10.2025            | 6.249           | 6.270                     | 0,25                              | 1,200 % fällig am 01.02.2026            | 15.700          | 15.307                    | 0,60                              |
| 2,650 % fällig am 25.09.2040                          | 748             | 739                       | 0,03                              | Glencore Funding LLC                    |                 |                           |                                   | 3,650 % fällig am 01.03.2028            | 2.965           | 2.884                     | 0,11                              |
| Structured Asset Investment Loan Trust                |                 |                           |                                   | 5,165 % fällig am 01.10.2026            | 7.900           | 7.901                     | 0,31                              | 3,700 % fällig am 01.08.2025            | 1.000           | 999                       | 0,04                              |
| 4,984 % fällig am 25.09.2034                          | 1.489           | 1.446                     | 0,06                              | Goldman Sachs Bank USA                  |                 |                           |                                   | 4,400 % fällig am 06.09.2026            | 700             | 699                       | 0,03                              |
| Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust |                 |                           |                                   | 5,125 % fällig am 21.05.2027            | 5.900           | 5.918                     | 0,23                              | 4,700 % fällig am 01.06.2027            | 800             | 803                       | 0,03                              |
| 6,159 % fällig am 25.11.2035                          | 838             | 838                       | 0,03                              | Goldman Sachs Group, Inc.               |                 |                           |                                   | 4,900 % fällig am 01.06.2026            | 1.100           | 1.101                     | 0,04                              |
|                                                       |                 | 29.713                    | 1,16                              | 1,431 % fällig am 09.03.2027            | 2.312           | 2.262                     | 0,09                              | 5,300 % fällig am 01.03.2028            | 4.000           | 4.052                     | 0,16                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 1,542 % fällig am 10.09.2027            | 1.100           | 1.062                     | 0,04                              | 5,350 % fällig am 01.03.2026            | 2.400           | 2.412                     | 0,09                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 1,948 % fällig am 21.10.2027            | 500             | 484                       | 0,02                              | Stellantis Finance U.S., Inc.           |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,182 % fällig am 09.12.2026            | 4.300           | 4.307                     | 0,17                              | 5,350 % fällig am 17.03.2028            | 1.900           | 1.916                     | 0,07                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,202 % fällig am 09.03.2027            | 239             | 239                       | 0,01                              | Synchrony Bank                          |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,214 % fällig am 10.09.2027            | 600             | 601                       | 0,02                              | 5,400 % fällig am 22.08.2025            | 3.055           | 3.054                     | 0,12                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,498 % fällig am 24.02.2028            | 1.000           | 1.003                     | 0,04                              | Synchrony Financial                     |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,642 % fällig am 23.04.2028            | 700             | 705                       | 0,03                              | 4,500 % fällig am 23.07.2025            | 650             | 650                       | 0,03                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,798 % fällig am 10.08.2026            | 2.800           | 2.804                     | 0,11                              | Synopsys, Inc.                          |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 6,249 % fällig am 15.03.2028            | 1.600           | 1.631                     | 0,06                              | 4,650 % fällig am 01.04.2028            | 5.300           | 5.355                     | 0,21                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | Great-West Lifeco U.S. Finance LP       |                 |                           |                                   | T-Mobile USA, Inc.                      |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 0,904 % fällig am 12.08.2025            | 700             | 697                       | 0,03                              | 1,500 % fällig am 15.02.2026            | 5.400           | 5.295                     | 0,21                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | Harley-Davidson, Inc.                   |                 |                           |                                   | 2,250 % fällig am 15.02.2026            | 700             | 690                       | 0,03                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 3,500 % fällig am 28.07.2025            | 6.000           | 5.992                     | 0,23                              | TD SYNEX Corp.                          |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | HCA, Inc.                               |                 |                           |                                   | 1,750 % fällig am 09.08.2026            | 5.200           | 5.029                     | 0,20                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,257 % fällig am 01.03.2028            | 1.000           | 1.006                     | 0,04                              | Uber Technologies, Inc.                 |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,875 % fällig am 15.02.2026            | 5.400           | 5.406                     | 0,21                              | 4,500 % fällig am 15.08.2029            | 5.500           | 5.472                     | 0,21                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | Hyundai Capital America                 |                 |                           |                                   | 6,250 % fällig am 15.01.2028            | 5.600           | 5.630                     | 0,22                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,250 % fällig am 08.01.2027            | 2.400           | 2.423                     | 0,09                              | 7,500 % fällig am 15.09.2027            | 5.100           | 5.149                     | 0,20                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,402 % fällig am 25.03.2027            | 2.500           | 2.497                     | 0,10                              | United Airlines, Inc.                   |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,509 % fällig am 04.08.2025            | 15.000          | 15.007                    | 0,59                              | 4,375 % fällig am 15.04.2026            | 13.600          | 13.519                    | 0,53                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,650 % fällig am 26.06.2026            | 1.500           | 1.515                     | 0,06                              | VICI Properties LP                      |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,679 % fällig am 03.11.2025            | 2.300           | 2.307                     | 0,09                              | 4,250 % fällig am 01.12.2026            | 1.500           | 1.491                     | 0,06                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,847 % fällig am 08.01.2027            | 5.200           | 5.232                     | 0,20                              | Volkswagen Group of America Finance LLC |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | Illumina, Inc.                          |                 |                           |                                   | 5,236 % fällig am 20.03.2026            | 1.400           | 1.400                     | 0,05                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 4,650 % fällig am 09.09.2026            | 3.100           | 3.105                     | 0,12                              | 5,327 % fällig am 12.09.2025            | 600             | 600                       | 0,02                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,800 % fällig am 12.12.2025            | 1.528           | 1.535                     | 0,06                              | 5,428 % fällig am 14.08.2026            | 5.375           | 5.393                     | 0,21                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | Jackson National Life Global Funding    |                 |                           |                                   | 5,472 % fällig am 25.03.2027            | 9.200           | 9.192                     | 0,36                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 3,050 % fällig am 29.04.2026            | 5.000           | 4.941                     | 0,19                              | 6,000 % fällig am 16.11.2026            | 390             | 396                       | 0,02                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,315 % fällig am 14.01.2028            | 2.500           | 2.509                     | 0,10                              | Wells Fargo & Co.                       |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | John Deere Capital Corp.                |                 |                           |                                   | 1,500 % fällig am 24.05.2027            | € 1.700         | 1.963                     | 0,08                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,025 % fällig am 15.07.2027            | 4.100           | 4.125                     | 0,16                              | 5,133 % fällig am 24.01.2028            | \$ 2.039        | 2.041                     | 0,08                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | JPMorgan Chase & Co.                    |                 |                           |                                   | Western Union Co.                       |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 1,045 % fällig am 19.11.2026            | 600             | 592                       | 0,02                              | 1,350 % fällig am 15.03.2026            | 2.200           | 2.149                     | 0,08                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 1,578 % fällig am 22.04.2027            | 1.400           | 1.368                     | 0,05                              | Williams Cos., Inc.                     |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,210 % fällig am 22.10.2028            | 1.600           | 1.606                     | 0,06                              | 5,400 % fällig am 02.03.2026            | 4.700           | 4.727                     | 0,18                              |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,270 % fällig am 22.04.2028            | 5.100           | 5.116                     | 0,20                              |                                         |                 | 529.828                   | 20,69                             |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,280 % fällig am 22.07.2028            | 600             | 603                       | 0,02                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,552 % fällig am 23.01.2028            | 6.400           | 6.455                     | 0,25                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,558 % fällig am 24.02.2028            | 5.633           | 5.683                     | 0,22                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | Las Vegas Sands Corp.                   |                 |                           |                                   |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,900 % fällig am 01.06.2027            | 1.500           | 1.533                     | 0,06                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | Mercedes-Benz Finance North America LLC |                 |                           |                                   |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 4,985 % fällig am 31.07.2026            | 2.600           | 2.601                     | 0,10                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,001 % fällig am 31.07.2026            | 5.300           | 5.303                     | 0,21                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,012 % fällig am 09.01.2026            | 2.058           | 2.061                     | 0,08                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,195 % fällig am 01.04.2027            | 12.230          | 12.227                    | 0,48                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | Morgan Stanley Bank N.A.                |                 |                           |                                   |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,250 % fällig am 26.05.2028            | 3.600           | 3.611                     | 0,14                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | MPLX LP                                 |                 |                           |                                   |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 1,750 % fällig am 01.03.2026            | 10.300          | 10.103                    | 0,39                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | NextEra Energy Capital Holdings, Inc.   |                 |                           |                                   |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,116 % fällig am 29.01.2026            | 4.200           | 4.210                     | 0,16                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,159 % fällig am 04.02.2028            | 9.300           | 9.349                     | 0,37                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | Nissan Motor Acceptance Co. LLC         |                 |                           |                                   |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 1,850 % fällig am 16.09.2026            | 7.100           | 6.777                     | 0,26                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 2,000 % fällig am 09.03.2026            | 4.095           | 3.995                     | 0,16                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 6,950 % fällig am 15.09.2026            | 400             | 405                       | 0,02                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | ONEOK, Inc.                             |                 |                           |                                   |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 2,200 % fällig am 15.09.2025            | 700             | 696                       | 0,03                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 4,250 % fällig am 24.09.2027            | 3.200           | 3.196                     | 0,13                              |                                         |                 |                           |                                   |
|                                                       |                 |                           |                                   | 5,850 % fällig am 15.01.2026            | 3.500           | 3.518                     | 0,14                              |                                         |                 |                           |                                   |



| BESCHREIBUNG                                        | PARI<br>(000S) | MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |       | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |       | BESCHREIBUNG                          | PARI<br>(000S) | MARKT- NETTO-<br>WERT VERMÖ-<br>GENS |       |
|-----------------------------------------------------|----------------|--------------------------------------|-------|---------------------------------------|----------------|--------------------------------------|-------|---------------------------------------|----------------|--------------------------------------|-------|
|                                                     |                | (000S)                               | % DES |                                       |                | (000S)                               | % DES |                                       |                | (000S)                               | % DES |
| GSR Mortgage Loan Trust                             |                |                                      |       | 4,898 % fällig am 15.10.2040          | \$ 52          | \$ 52                                | 0,00  | 4,690 % fällig am 10.07.2025          | \$ 1.700       | \$ 1.698                             | 0,07  |
| 4,723 % fällig am 25.11.2035                        | \$ 69          | \$ 58                                | 0,00  | 4,918 % fällig am 15.11.2050          | 72             | 72                                   | 0,00  | 4,710 % fällig am 10.07.2025          | 7.400          | 7.390                                | 0,29  |
| 4,857 % fällig am 25.06.2034                        | 37             | 36                                   | 0,00  | 4,938 % fällig am 15.05.2036          |                |                                      |       | Crown Castle, Inc.                    |                |                                      |       |
| Impac CMB Trust                                     |                |                                      |       | - 15.12.2041                          | 138            | 138                                  | 0,01  | 5,030 % fällig am 22.07.2025          | 21.600         | 21.534                               | 0,84  |
| 5,074 % fällig am 25.03.2035                        | 60             | 58                                   | 0,00  | 5,245 % fällig am 25.11.2054          | 29.541         | 29.480                               | 1,15  | 5,030 % fällig am 24.07.2025          | 3.300          | 3.289                                | 0,13  |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust |                |                                      |       | 5,250 % fällig am 15.04.2049          | 5.744          | 5.756                                | 0,23  | CVS Corp.                             |                |                                      |       |
| 4,128 % fällig am 05.07.2031                        | 3.000          | 2.758                                | 0,11  | 5,255 % fällig am 25.03.2055          | 16.538         | 16.556                               | 0,65  | 4,920 % fällig am 14.07.2025          | 20.000         | 19.962                               | 0,78  |
| 5,569 % fällig am 15.06.2035                        | 969            | 837                                  | 0,03  | 5,275 % fällig am 25.08.2054          | 1.672          | 1.676                                | 0,07  | 4,920 % fällig am 15.07.2025          | 4.700          | 4.690                                | 0,18  |
| Merrill Lynch Mortgage Investors Trust              |                |                                      |       | 5,305 % fällig am 25.10.2052          |                |                                      |       | Equifax, Inc.                         |                |                                      |       |
| 5,879 % fällig am 25.05.2033                        | 103            | 101                                  | 0,00  | - 25.06.2055                          | 23.415         | 23.193                               | 0,91  | 4,620 % fällig am 17.07.2025          | 9.300          | 9.280                                | 0,36  |
| 6,210 % fällig am 25.03.2033                        | 164            | 158                                  | 0,01  | 5,306 % fällig am 25.06.2055          | 4.100          | 4.105                                | 0,16  | HCA, Inc.                             |                |                                      |       |
| New Residential Mortgage Loan Trust                 |                |                                      |       | 5,404 % fällig am 25.07.2055          | 4.400          | 4.401                                | 0,17  | 4,950 % fällig am 14.08.2025          | 2.600          | 2.584                                | 0,10  |
| 3,500 % fällig am 25.12.2057                        | 278            | 270                                  | 0,01  | 5,405 % fällig am 25.11.2054          |                |                                      |       | 4,950 % fällig am 15.08.2025          | 2.600          | 2.584                                | 0,10  |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058                        | 132            | 130                                  | 0,01  | - 25.01.2055                          | 24.500         | 24.414                               | 0,95  | 5,000 % fällig am 22.08.2025          | 24.000         | 23.827                               | 0,93  |
| Sequoia Mortgage Trust                              |                |                                      |       | 5,455 % fällig am 25.05.2054          |                |                                      |       | Holcim Finance U.S. LLC               |                |                                      |       |
| 5,112 % fällig am 20.10.2034                        | 287            | 264                                  | 0,01  | - 25.03.2055                          | 38.838         | 38.834                               | 1,52  | 4,640 % fällig am 08.07.2025          | 20.900         | 20.879                               | 0,82  |
| Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust      |                |                                      |       | 5,505 % fällig am 25.12.2054          | 2.415          | 2.421                                | 0,09  | Intel Corp.                           |                |                                      |       |
| 5,351 % fällig am 25.03.2034                        | 6              | 6                                    | 0,00  | 5,799 % fällig am 25.07.2044          | 3              | 3                                    | 0,00  | 4,590 % fällig am 01.07.2025          | 3.300          | 3.300                                | 0,13  |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust         |                |                                      |       | Ginnie Mae                            |                |                                      |       | Jones Lang LaSalle Finance BV         |                |                                      |       |
| 5,092 % fällig am 19.10.2034                        | 190            | 182                                  | 0,01  | 2,500 % fällig am 20.01.2049          |                |                                      |       | 4,720 % fällig am 09.07.2025          | 23.600         | 23.573                               | 0,92  |
| Towd Point Mortgage Trust                           |                |                                      |       | - 20.10.2049                          | 583            | 520                                  | 0,02  | Mondelez International, Inc.          |                |                                      |       |
| 3,250 % fällig am 25.07.2056                        | 563            | 556                                  | 0,02  | 4,350 % fällig am 20.04.2069          | 664            | 666                                  | 0,03  | 4,570 % fällig am 11.08.2025          | 19.100         | 18.999                               | 0,74  |
| 3,750 % fällig am 25.05.2058                        | 5.157          | 5.063                                | 0,20  | 4,602 % fällig am 20.09.2071          | 1.212          | 1.197                                | 0,05  | NextEra Energy Capital Holdings, Inc. |                |                                      |       |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust       |                |                                      |       | 4,750 % fällig am 20.11.2029          | 1              | 1                                    | 0,00  | 4,600 % fällig am 28.07.2025          | 2.300          | 2.292                                | 0,09  |
| 4,894 % fällig am 25.04.2045                        | 1              | 1                                    | 0,00  | 4,906 % fällig am 20.02.2067          | 202            | 203                                  | 0,01  | 4,600 % fällig am 19.08.2025          | 1.800          | 1.788                                | 0,07  |
| 4,974 % fällig am 25.12.2045                        | 20             | 21                                   | 0,00  | 4,926 % fällig am 20.02.2065          | 2.768          | 2.773                                | 0,11  | RTX Corp.                             |                |                                      |       |
| 4,983 % fällig am 25.10.2035                        | 201            | 184                                  | 0,01  | 4,932 % fällig am 20.10.2037          | 103            | 102                                  | 0,00  | 4,660 % fällig am 15.07.2025          | 24.600         | 24.552                               | 0,96  |
|                                                     |                | 16.851                               | 0,66  | 4,946 % fällig am 20.11.2069          | 110            | 111                                  | 0,00  | Targa Resources Corp.                 |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,002 % fällig am 20.02.2074          | 381            | 380                                  | 0,02  | 4,700 % fällig am 29.07.2025          | 9.900          | 9.860                                | 0,38  |
|                                                     |                |                                      |       | 5,024 % fällig am 20.03.2068          | 4.622          | 4.655                                | 0,18  |                                       |                | 299.646                              | 11,70 |
|                                                     |                |                                      |       | 5,046 % fällig am 20.11.2065          | 1.388          | 1.392                                | 0,05  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,096 % fällig am 20.02.2070          | 54             | 54                                   | 0,00  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,099 % fällig am 20.01.2068          | 5.066          | 5.104                                | 0,20  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,196 % fällig am 20.12.2065          |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | - 20.08.2067                          | 1.635          | 1.642                                | 0,06  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,199 % fällig am 20.12.2068          | 859            | 865                                  | 0,03  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,202 % fällig am 20.01.2074          |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | - 20.07.2074                          | 5.823          | 5.845                                | 0,23  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,204 % fällig am 20.06.2055          | 18.300         | 18.311                               | 0,72  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,246 % fällig am 20.01.2066          | 194            | 194                                  | 0,01  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,252 % fällig am 20.01.2054          |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | - 20.10.2073                          | 5.280          | 5.292                                | 0,21  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,296 % fällig am 20.11.2066          | 379            | 381                                  | 0,02  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,302 % fällig am 20.05.2073          | 4.080          | 4.124                                | 0,16  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,324 % fällig am 20.03.2069          | 3.339          | 3.381                                | 0,13  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,402 % fällig am 20.05.2073          | 972            | 987                                  | 0,04  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,592 % fällig am 20.04.2067          | 2.052          | 2.078                                | 0,08  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,625 % fällig am 20.03.2027          |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | - 20.03.2030                          | 12             | 11                                   | 0,00  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,802 % fällig am 20.06.2071          | 6.775          | 6.921                                | 0,27  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 6,595 % fällig am 20.05.2071          | 2.414          | 2.471                                | 0,10  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 6,601 % fällig am 20.06.2071          | 2.374          | 2.421                                | 0,09  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 7,843 % fällig am 20.09.2066          | 674            | 696                                  | 0,03  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | Uniform Mortgage-Backed Security      |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,000 % fällig am 01.09.2049          | 3.032          | 2.859                                | 0,11  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | Uniform Mortgage-Backed Security, TBA |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 5,500 % fällig am 01.08.2055          | 46.400         | 46.359                               | 1,81  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       |                                       |                | 432.513                              | 16,89 |                                       |                |                                      |       |
| US-SCHATZOBIGATIONEN                                |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)    |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 0,125 % fällig am 15.10.2025          | 7.912          | 7.885                                | 0,31  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 2,125 % fällig am 15.04.2029          | 7.311          | 7.509                                | 0,29  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | U.S. Treasury Notes                   |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,000 % fällig am 31.05.2030          | 64.000         | 64.630                               | 2,53  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       |                                       |                | 80.024                               | 3,13  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | Summe USA                             |                | 1.093.730                            | 42,72 |                                       |                |                                      |       |
| KURZFRISTIGE INSTRUMENTE                            |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
| COMMERCIAL PAPER                                    |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | AbbVie, Inc.                          |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,640 % fällig am 07.07.2025          | 1.400          | 1.399                                | 0,05  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | Air Lease Corp.                       |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,850 % fällig am 15.07.2025          | 18.400         | 18.363                               | 0,72  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,850 % fällig am 18.07.2025          | 2.900          | 2.893                                | 0,11  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | Alimentation Couche-Tard, Inc.        |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,630 % fällig am 07.07.2025          | 10.700         | 10.690                               | 0,42  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,670 % fällig am 02.07.2025          | 8.400          | 8.398                                | 0,33  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | Bacardi-Martini BV                    |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,950 % fällig am 03.07.2025          | 2.900          | 2.899                                | 0,11  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,950 % fällig am 10.07.2025          | 19.400         | 19.374                               | 0,76  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | Canadian Natural Resources Ltd.       |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,900 % fällig am                     |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 06.08.2025 (b)                        | 25.500         | 25.375                               | 0,99  |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | CBRE Services, Inc.                   |                |                                      |       |                                       |                |                                      |       |
|                                                     |                |                                      |       | 4,640 % fällig am 24.07.2025          | 8.200          | 8.174                                | 0,32  |                                       |                |                                      |       |



## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

### PENSIONSGESCHÄFTE

| Kontrahent              | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch                                  | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft <sup>(1)</sup> | % des Netto-vermögens |
|-------------------------|-------------|-------------------|-------------------|----------------|--------------------------------------------------|-------------------------|------------------------------|-----------------------------------------------------------|-----------------------|
| FICC                    | 4,400 %     | 30.06.2025        | 01.07.2025        | \$ 18.300      | U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 15.12.2027 | \$ (18.815)             | \$ 18.300                    | \$ 18.302                                                 | 0,71                  |
| Summe Pensionsgeschäfte |             |                   |                   |                |                                                  | \$ (18.815)             | \$ 18.300                    | \$ 18.302                                                 | 0,71                  |

<sup>(1)</sup> Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### FUTURES

| Beschreibung                                                   | Art   | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|----------------------------------------------------------------|-------|--------------|----------------------|------------------------------------------|----------------------|
| 3-Month SOFR June Futures                                      | Long  | 09.2025      | 2.956                | \$ (185)                                 | (0,01)               |
| 3-Month SOFR March Futures                                     | Long  | 06.2026      | 2.536                | 1.639                                    | 0,06                 |
| Australia Government 3-Year Note September Futures             | Long  | 09.2025      | 604                  | 140                                      | 0,01                 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures                    | Short | 09.2025      | 2.607                | (2.096)                                  | (0,08)               |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures                    | Long  | 09.2025      | 7.007                | 7.919                                    | 0,31                 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures                   | Short | 09.2025      | 510                  | (915)                                    | (0,03)               |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures                  | Short | 09.2025      | 235                  | (446)                                    | (0,02)               |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures           | Short | 09.2025      | 498                  | (1.774)                                  | (0,07)               |
| United Kingdom Long Gilt September Futures                     | Long  | 09.2025      | 192                  | 557                                      | 0,02                 |
|                                                                |       |              |                      | \$ 4.839                                 | 0,19                 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate |       |              |                      | \$ 4.839                                 | 0,19                 |

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend\*)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz              | Variable Zinssatzindex         | Fest-Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|------------------------------------------------|--------------------------------|---------------|-------------------|-------------|------------------------------------------|----------------------|
| Zahlung                                        | 1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS | 3,500 %       | 19.03.2030        | £ 46.900    | \$ 714                                   | 0,03                 |
| Erhalt <sup>(1)</sup>                          | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,620         | 30.11.2029        | \$ 658.176  | (6.648)                                  | (0,26)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 3,862         | 28.02.2029        | 58.100      | (837)                                    | (0,03)               |
| Erhalt                                         | 1-Day USD-SOFR Compounded-OIS  | 4,100         | 11.02.2026        | 345.300     | 20                                       | 0,00                 |
|                                                |                                |               |                   |             | \$ (6.751)                               | (0,26)               |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate |                                |               |                   |             | \$ (6.751)                               | (0,26)               |

<sup>(1)</sup> Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend\*, außer Anzahl der Kontrakte)

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

### OPTIONSKAUF

#### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung                         | Variable Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Kosten   | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|--------------------------------------|------------------------|-----------------------------------|----------------|----------------|----------------------------|----------|------------|-----------------------|
| BRC        | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                            | 5,400 %        | 26.09.2025     | 73.100                     | \$ 17    | \$ 0       | 0,00                  |
| MYC        | Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-SOFR       | Zahlung                           | 3,600          | 12.08.2025     | 631.700                    | 502      | 407        | 0,01                  |
|            | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap  | 3-Month USD-SOFR       | Erhalt                            | 4,600          | 12.08.2025     | 631.700                    | 506      | 1          | 0,00                  |
|            |                                      |                        |                                   |                |                |                            | \$ 1.025 | \$ 408     | 0,01                  |

### VERKAUFSOPTIONEN

#### CREDIT DEFAULT SWAPPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung                     | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag <sup>(1)</sup> | Aufgeld | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|------------|----------------------------------|---------------------|----------------|----------------|----------------------------|---------|------------|-----------------------|
| GST        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850 %        | 16.07.2025     | 9.500                      | \$ (13) | \$ (1)     | 0,00                  |
| JPM        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 1,000          | 16.07.2025     | 10.650                     | (11)    | (1)        | 0,00                  |
| RBC        | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,850          | 16.07.2025     | 10.200                     | (12)    | 0          | 0,00                  |
|            | Put - OTC CDX.IG-44 5-Year Index | Verkauf             | 0,900          | 16.07.2025     | 10.650                     | (13)    | (1)        | 0,00                  |
|            |                                  |                     |                |                |                            | \$ (49) | \$ (3)     | 0,00                  |

<sup>(1)</sup> Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 45                   | \$ 51                    | \$ 0                             | \$ (2)                             | \$ (2)                                               | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 94.756              | AUD 145.868              | 839                              | 0                                  | 839                                                  | 0,03                    |
|            | 08.2025               | AUD 145.868            | \$ 94.811                | 0                                | (844)                              | (844)                                                | (0,03)                  |
| BOA        | 07.2025               | € 73.888               | 84.014                   | 0                                | (2.720)                            | (2.720)                                              | (0,10)                  |
|            | 07.2025               | \$ 2.957               | AUD 4.566                | 35                               | 0                                  | 35                                                   | 0,00                    |
| BPS        | 07.2025               | 14                     | € 12                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | ILS 79                 | \$ 23                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 77.738              | £ 57.146                 | 572                              | 0                                  | 572                                                  | 0,02                    |
|            | 07.2025               | 47                     | ILS 164                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | £ 55.644               | \$ 75.720                | 0                                | (543)                              | (543)                                                | (0,02)                  |
| BSH        | 07.2025               | \$ 249                 | DKK 1.636                | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| CBK        | 07.2025               | 4.666                  | AUD 7.197                | 51                               | 0                                  | 51                                                   | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | DKK 1.232              | \$ 193                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 85.768              | € 73.932                 | 1.017                            | 0                                  | 1.017                                                | 0,04                    |
|            | 07.2025               | 23                     | ILS 79                   | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | € 73.770               | \$ 85.768                | 0                                | (1.016)                            | (1.016)                                              | (0,04)                  |
|            | 08.2025               | \$ 193                 | DKK 1.229                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               | DKK 1.674              | \$ 263                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 263                 | DKK 1.670                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| JPM        | 07.2025               | AUD 1.601              | \$ 1.049                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 192                 | DKK 1.268                | 7                                | 0                                  | 7                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | 1.050                  | AUD 1.601                | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | AUD 1.813              | \$ 1.188                 | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | CAD 406                | 296                      | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 1.047               | AUD 1.601                | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | 296                    | CAD 406                  | 2                                | 0                                  | 2                                                    | 0,00                    |
|            | 08.2025               | CAD 406                | \$ 296                   | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | € 125                  | 147                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 11                  | £ 8                      | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SCX        | 07.2025               | 0                      | ILS 1                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| SOG        | 07.2025               | 38                     | € 33                     | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
| SSB        | 07.2025               | £ 57.146               | \$ 77.377                | 0                                | (933)                              | (933)                                                | (0,04)                  |
|            | 07.2025               | \$ 1.041               | € 898                    | 13                               | 0                                  | 13                                                   | 0,00                    |
| UAG        | 07.2025               | 3                      | ILS 12                   | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| WST        | 07.2025               | AUD 157.631            | \$ 101.638               | 0                                | (1.665)                            | (1.665)                                              | (0,06)                  |
|            | 07.2025               | € 898                  | 1.053                    | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                    |
|            | 08.2025               | \$ 1.055               | € 898                    | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 2.551                         | \$ (7.728)                         | \$ (5.177)                                           | (0,20)                  |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | AUD 57.101             | \$ 37.093                | \$ 0                             | \$ (328)                           | \$ (328)                                             | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$ 37.114              | AUD 57.101               | 330                              | 0                                  | 330                                                  | 0,01                    |
| BOA        | 07.2025               | 12                     | 18                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | 43.234                 | 67.087                   | 731                              | 0                                  | 731                                                  | 0,03                    |
| DUB        | 07.2025               | 1.227                  | 1.905                    | 22                               | 0                                  | 22                                                   | 0,00                    |
| FAR        | 07.2025               | AUD 56.764             | \$ 37.112                | 0                                | (88)                               | (88)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 48.101              | AUD 74.553               | 757                              | 0                                  | 757                                                  | 0,03                    |
|            | 08.2025               | 37.135                 | 56.764                   | 88                               | 0                                  | 88                                                   | 0,00                    |
| MBC        | 07.2025               | AUD 912                | \$ 585                   | 0                                | (13)                               | (13)                                                 | 0,00                    |
| MYI        | 07.2025               | 49.989                 | 32.572                   | 0                                | (188)                              | (188)                                                | (0,01)                  |
| WST        | 07.2025               | \$ 48.130              | AUD 74.645               | 789                              | 0                                  | 789                                                  | 0,03                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 2.717                         | \$ (617)                           | \$ 2.100                                             | 0,08                    |

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Nettovermögens |
|------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------------|
| AZD        | 07.2025               | € 49.561               | \$ 58.030                | \$ 0                             | \$ (146)                           | \$ (146)                                             | (0,01)                  |
|            | 08.2025               | \$ 58.157              | € 49.561                 | 147                              | 0                                  | 147                                                  | 0,01                    |
| BOA        | 07.2025               | 35.340                 | 31.080                   | 1.144                            | 0                                  | 1.144                                                | 0,05                    |
| BPS        | 07.2025               | 634                    | 553                      | 15                               | 0                                  | 15                                                   | 0,00                    |
| BRC        | 07.2025               | € 2                    | \$ 2                     | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 35.961              | € 31.663                 | 1.206                            | 0                                  | 1.206                                                | 0,05                    |
|            | 07.2025               | € 19                   | \$ 22                    | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 685                 | € 591                    | 8                                | 0                                  | 8                                                    | 0,00                    |
| DUB        | 07.2025               | € 52.707               | \$ 61.146                | 0                                | (724)                              | (724)                                                | (0,03)                  |
|            | 08.2025               | \$ 61.146              | € 52.592                 | 724                              | 0                                  | 724                                                  | 0,03                    |
| MBC        | 07.2025               | € 93                   | \$ 107                   | 0                                | (3)                                | (3)                                                  | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 72.171              | € 62.163                 | 799                              | 0                                  | 799                                                  | 0,03                    |
| WST        | 07.2025               | € 52.267               | \$ 61.291                | 0                                | (63)                               | (63)                                                 | 0,00                    |
|            | 07.2025               | \$ 32.686              | € 28.933                 | 1.276                            | 0                                  | 1.276                                                | 0,05                    |
|            | 08.2025               | 61.425                 | 52.267                   | 63                               | 0                                  | 63                                                   | 0,00                    |
|            |                       |                        |                          | \$ 5.382                         | \$ (936)                           | \$ 4.446                                             | 0,18                    |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2025 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent                       | Abrechnungs-<br>monat | Zu zahlende<br>Währung | Zu erhaltende<br>Währung | Nicht realisierte<br>Wertzunahme | Nicht realisierte<br>(Wertabnahme) | Nicht realisierte<br>Nettowertzunahme/<br>(-abnahme) | % des<br>Netto-<br>vermögens |
|----------------------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------|
| AZD                              | 07.2025               | £ 869                  | \$ 1.193                 | \$ 2                             | \$ 0                               | \$ 2                                                 | 0,00                         |
|                                  | 08.2025               | \$ 1.193               | £ 869                    | 0                                | (2)                                | (2)                                                  | 0,00                         |
| BRC                              | 07.2025               | £ 1.124                | \$ 1.526                 | 0                                | (15)                               | (15)                                                 | 0,00                         |
|                                  | 07.2025               | \$ 1.105               | £ 818                    | 17                               | 0                                  | 17                                                   | 0,00                         |
|                                  | 08.2025               | 1.251                  | 919                      | 9                                | 0                                  | 9                                                    | 0,00                         |
| CBK                              | 07.2025               | 428                    | 315                      | 3                                | 0                                  | 3                                                    | 0,00                         |
| JPM                              | 07.2025               | 1.188                  | 881                      | 21                               | 0                                  | 21                                                   | 0,00                         |
| MBC                              | 07.2025               | 15                     | 11                       | 0                                | 0                                  | 0                                                    | 0,00                         |
| SSB                              | 07.2025               | £ 911                  | \$ 1.249                 | 1                                | 0                                  | 1                                                    | 0,00                         |
|                                  | 07.2025               | \$ 1.189               | £ 878                    | 14                               | 0                                  | 14                                                   | 0,00                         |
|                                  | 08.2025               | 1.249                  | 911                      | 0                                | (1)                                | (1)                                                  | 0,00                         |
|                                  |                       |                        |                          | \$ 67                            | \$ (18)                            | \$ 49                                                | 0,00                         |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 1.823                                             | 0,07                         |
| Summe Anlagen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 2.607.716                                         | 101,85                       |
| Sonstige Aktiva und Passiva      |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ (47.480)                                          | (1,85)                       |
| Nettovermögen                    |                       |                        |                          |                                  |                                    | \$ 2.560.236                                         | 100,00                       |

### ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend\*):

\* Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

Barmittel in Höhe von 30.909 USD (31. Dezember 2024: 11.122 USD) wurden zum 30. Juni 2025 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2025 Barmittel in Höhe von 2.530 USD (31. Dezember 2024: 5.330 USD) als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert<sup>(1)</sup>

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2025 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten<br>notierte Kurse<br>für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                        | \$ 2.336.793                                                    | \$ 4.105                                                     | \$ 2.340.898 |
| Investmentfonds               | 248.607                                                                     | 0                                                               | 0                                                            | 248.607      |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                           | 18.300                                                          | 0                                                            | 18.300       |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | 697                                                                         | (786)                                                           | 0                                                            | (89)         |
| Summen                        | \$ 249.304                                                                  | \$ 2.354.307                                                    | \$ 4.105                                                     | \$ 2.607.716 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2024 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie <sup>(2)</sup>      | An aktiven Märkten notierte<br>Kurse für identische Anlagen<br>(Stufe 1) | Wesentliche sonstige<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 2) | Wesentliche nicht<br>beobachtbare Inputfaktoren<br>(Stufe 3) | Marktwert    |
|-------------------------------|--------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------|
| Übertragbare Wertpapiere      | \$ 0                                                                     | \$ 2.015.074                                                    | \$ 0                                                         | \$ 2.015.074 |
| Investmentfonds               | 27.635                                                                   | 197.290                                                         | 0                                                            | 224.925      |
| Pensionsgeschäfte             | 0                                                                        | 133.083                                                         | 0                                                            | 133.083      |
| Finanzderivate <sup>(3)</sup> | (602)                                                                    | 334                                                             | 0                                                            | (268)        |
| Summen                        | \$ 27.033                                                                | \$ 2.345.781                                                    | \$ 0                                                         | \$ 2.372.814 |

<sup>(1)</sup> Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

<sup>(2)</sup> Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

<sup>(3)</sup> Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

### Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024:

| Kontrahent | Zum<br>30. Juni 2025                |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| AZD        | \$ (4)                              | \$ 0                                  | \$ (4)                              | \$ k. A.                            | \$ k. A.                              | \$ k. A.                            |
| BOA        | (1.541)                             | 1.470                                 | (71)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| BPS        | 15                                  | (10)                                  | 5                                   | (1.355)                             | 1.180                                 | (175)                               |

| Kontrahent | Zum<br>30. Juni 2025                |                                       |                                     | Zum 31. Dez. 2024                   |                                       |                                     |
|------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|
|            | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> | Gesamtmarktwert<br>der OTC-Derivate | Sicherheiten<br>(erhalten)/verpfändet | Netto-<br>Engagement <sup>(1)</sup> |
| BRC        | \$ 1.979                            | \$ (1.870)                            | \$ 109                              | \$ (1.200)                          | \$ 1.000                              | \$ (200)                            |
| BSH        | 8                                   | 0                                     | 8                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| CBK        | 62                                  | 0                                     | 62                                  | 213                                 | (260)                                 | (47)                                |
| DUB        | 24                                  | 0                                     | 24                                  | (2.180)                             | 1.790                                 | (390)                               |
| FAR        | 757                                 | (500)                                 | 257                                 | 1.558                               | (1.370)                               | 188                                 |
| GLM        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 195                                 | (200)                                 | (5)                                 |
| GST        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| JPM        | 27                                  | 0                                     | 27                                  | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MBC        | 783                                 | (620)                                 | 163                                 | 1.769                               | (1.220)                               | 549                                 |
| MYC        | 408                                 | (460)                                 | (52)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| MYI        | (188)                               | (40)                                  | (228)                               | 93                                  | 0                                     | 93                                  |
| RBC        | (1)                                 | 0                                     | (1)                                 | 44                                  | 0                                     | 44                                  |
| RYL        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 320                                 | (300)                                 | 20                                  |
| SCX        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | (1.501)                             | 1.360                                 | (141)                               |
| SOG        | 1                                   | 0                                     | 1                                   | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| SSB        | (906)                               | 1.060                                 | 154                                 | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |
| TOR        | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               | 243                                 | 0                                     | 243                                 |
| WST        | 400                                 | (440)                                 | (40)                                | k. A.                               | k. A.                                 | k. A.                               |

<sup>(1)</sup> Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

#### Vergleichsinformationen

Es folgt eine Analyse des Fondsvermögens zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 als Anteil am Gesamtvermögen des Fonds:

| Analyse des Gesamtvermögens                                            | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere          | 35,23             | 36,30             |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere* | 46,24             | 45,00             |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere                                      | 3,79              | 0,45              |
| Investmentfonds                                                        | 9,05              | 9,13              |
| Pensionsgeschäfte                                                      | 0,67              | 5,40              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate                    | 0,37              | 0,08              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                                    | 0,03              | 0,08              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                                             | 0,41              | 0,22              |
| Sonstige Aktiva                                                        | 4,21              | 3,34              |
| Summe Aktiva                                                           | 100,00            | 100,00            |

\* Gemäß der in Anhang 1 des Verkaufsprospekts angegebenen Liste von Märkten, die die OGAW-Kriterien für geregelte Märkte erfüllen.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert                               | 30. Juni 2025 (%) | 31. Dez. 2024 (%) |
|-----------------------------------------------------|-------------------|-------------------|
| Australien                                          | 3,65              | 0,94              |
| Bermuda                                             | 1,13              | 0,36              |
| Kanada                                              | 3,28              | 3,16              |
| Kaimaninseln                                        | 2,41              | 3,25              |
| Dänemark                                            | 0,17              | 1,15              |
| Finnland                                            | 0,14              | 0,27              |
| Frankreich                                          | 3,27              | 3,13              |
| Deutschland                                         | 1,35              | 1,46              |
| Irland                                              | 2,92              | 3,17              |
| Israel                                              | 0,08              | 0,03              |
| Italien                                             | 0,04              | k. A.             |
| Japan                                               | 2,58              | 2,59              |
| Jersey, Kanalinseln                                 | 1,82              | k. A.             |
| Liberia                                             | 0,17              | k. A.             |
| Luxemburg                                           | 0,63              | 0,83              |
| Multinational                                       | 0,07              | 0,04              |
| Niederlande                                         | 2,88              | 2,51              |
| Norwegen                                            | 0,92              | 0,16              |
| Singapur                                            | 0,24              | 0,06              |
| Südkorea                                            | 0,22              | 0,21              |
| Spanien                                             | 0,47              | 0,29              |
| Schweden                                            | 0,55              | 0,61              |
| Schweiz                                             | 0,63              | 0,91              |
| Vereinigte Arabische Emirate                        | k. A.             | 0,03              |
| Großbritannien                                      | 6,34              | 5,26              |
| USA                                                 | 42,72             | 40,79             |
| Kurzfristige Instrumente                            | 12,75             | 15,27             |
| Investmentfonds                                     | 9,71              | 9,65              |
| Pensionsgeschäfte                                   | 0,71              | 5,71              |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate |                   |                   |
| Futures                                             | 0,19              | 0,04              |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate                 |                   |                   |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | k. A.             | 0,00              |
| Zinsswaps                                           | (0,26)            | 0,03              |
| Freiverkehrsfinanzderivate                          |                   |                   |
| Optionskauf                                         |                   |                   |
| Zinsswapoptionen                                    | 0,01              | 0,02              |
| Verkaufsoptionen                                    |                   |                   |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes          | 0,00              | k. A.             |
| Devisenterminkontrakte                              | (0,20)            | 0,22              |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte                 | 0,26              | (0,32)            |
| Sonstige Aktiva und Passiva                         | (1,85)            | (1,83)            |
| Nettovermögen                                       | 100,00            | 100,00            |

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Fonds (nachfolgend jeweils als ein „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Fonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilsklassen („Klassen“) umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilsklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Fonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Fonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Fonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft.

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Europe GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Fonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Fonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehrerer Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn für einen bestimmten Fonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften, PIMCO Asia Limited and PIMCO Asia Pte Ltd., als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft für den geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet hat. Der Abschluss wird für alle Teilfonds auf der Basis der Unternehmensfortführung erstellt.

### Erstellungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2025. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, wie vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht, und den OGAW-Richtlinien erstellt.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss gelesen werden, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und der im Einklang mit dem vom Financial Reporting Council herausgegebenen Financial Reporting Standard 102 („FRS 102“), „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and Republic of Ireland“, dem Companies Act von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt wurde. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Für den Dynamic Multi-Asset Fund wurde ein geprüfter Abschluss für das am 31. Dezember 2024 endende Geschäftsjahr erstellt. Daher werden für diesen Fonds keine Abschlüsse mehr erstellt. Zum 31. Dezember 2024 hielt der Dynamic Multi-Asset Fund eine Restposition in übertragbaren Wertpapieren von 3.400.000 Anteilen eines AT1-Anspruchs der Credit Suisse AG („AT1-Anspruch“) mit einem Marktwert von 410.430 EUR. Dieser AT1-Anspruch bezieht sich auf eine Position in Unternehmensanleihen im Banken- und Finanzsektor und wurde zum 31. Dezember 2024 in der

Marktbewertungshierarchie in Stufe 2 eingeordnet. Der AT1-Anspruch wird zum 30. Juni 2025 mit einem beizulegenden Zeitwert von 340.518 EUR weiterhin im Fonds gehalten. Dieser Betrag ist im Wert der sonstigen finanziellen Vermögenswerte im Finanzstatus auf Gesellschaftsebene zum 30. Juni 2025 enthalten.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds, die einen erheblichen Anteil ihres Vermögens in äußerst liquiden und zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen halten, verfügbaren Ausnahmeregelung gemäß Section 7 von FRS 102 Gebrauch gemacht und legt daher keine Kapitalflussrechnung vor.

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Die Gesellschaft verwendet den US-Dollar als Präsentationswährung. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in der jeweiligen Funktionswährung erstellt. Der Finanzstatus der Gesellschaft wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Berichtszeitraums umgerechnet und die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft werden zum durchschnittlichen Wechselkurs (als Annäherung an die tatsächlichen Kurse) des Berichtszeitraums umgerechnet, um diese in den Abschluss der Gesellschaft einzubeziehen.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Die Aufstellung der Wertpapieranlagen bestimmter Fonds enthält gegebenenfalls übertragbare Wertpapiere, die sowohl einen Nennwert von null als auch einen Marktwert von null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und der tatsächliche Marktwert auf die nächsten Tausend gerundet werden.

Die von der Gesellschaft während des Berichtszeitraums angewandte Swing-Pricing-Methode ist mit derjenigen konform, die im geprüften Jahresabschluss angewandt wurde.

Zum 30. Juni 2025 wurde Swing Pricing auf den Emerging Markets Corporate Bond Fund, den Global High Yield Bond Fund und den US Investment Grade Corporate Bond Fund angewandt. Zum 31. Dezember 2024 wurde auf keinen der Fonds Swing Pricing angewandt.

Der NIW je Anteil ist in Erläuterung 16 angegeben und kann eine Swing-Pricing-Anpassung beinhalten. Swing-Pricing-Anpassungen werden nicht im Finanzstatus, in der Betriebsergebnisrechnung oder im Ausweis der Nettovermögensänderungen ausgewiesen.

## 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der Marktwert ist definiert als der Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es sind getrennte Angaben zur Marktbewertungshierarchie für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva erforderlich, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Diese Inputfaktoren oder Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, dass mit der Anlage in diesen Wertpapieren verbunden ist. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

- Stufe 1 – Quotierte Preise auf aktiven Märkten oder Börsen für identische Aktiva und Passiva.
- Stufe 2 – Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren. Hierzu können insbesondere quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten an Märkten, die aktiv sind, quotierte Preise für identische oder ähnliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an Märkten, die nicht aktiv sind, andere Inputfaktoren als quotierte Preise, die für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu beobachten sind (wie zum Beispiel Zinssätze, Renditekurven, Volatilitäten, Tilgungsgeschwindigkeit, Verlustquoten, Kreditrisiken und Ausfallraten) oder andere bestätigte Inputfaktoren vom Markt zählen.

- Stufe 3 – Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren, die unter diesen Umständen auf bestmöglich verfügbaren Informationen beruhen, wenn beobachtbare Inputfaktoren nicht verfügbar sind, was zur Bestimmung des Marktwerts von Anlagen verwendete Annahmen des Verwaltungsrats oder anderer Personen, die nach seinem Ermessen handeln, einschließen kann.

Eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 ist der Aufstellung der Wertpapieranlagen zu entnehmen. Die von den Fonds zur Klassifizierung von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anhand einer Zeitwerthierarchie verwendete Methode ist mit derjenigen konform, die im geprüften Jahresabschluss angewandt wurde.

#### 4. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs können alle Fonds Finanzderivate und Anlagetechniken für eine effiziente Portfolioverwaltung einsetzen. Die Fonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2025 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 138.713.329 USD/(null USD) (30. Juni 2024: 195.146.977 USD/(250 USD)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2025 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug 339.914 USD/(102.041.044 USD) (30. Juni 2024: 13.999 USD/(89.899.986 USD)).

Der durch die Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2025 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug null USD/(8.542.867 USD) (30. Juni 2024: null USD/(10.160.992 USD)).

#### 5. DIVIDENDENAUSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können

Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

- Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
- Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
- Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Fonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anteilinhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Income-II-Klassen kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den besicherten Klassen berechnet.

Im Fall aller Anteilsklassen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, des Asia Strategic Interest Bond Fund, des Euro Income Bond Fund, des Income Fund, des Income Fund II, des Low Duration Income Fund, des Mortgage Opportunities Fund, des PIMCO ESG Income Fund und des US Short-Term Fund werden, mit Ausnahme der Anteilsklassen G Institutional, G Retail, Class E

ausschüttend Q, Class E ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A, Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Administrative-Anteilsklassen des Diversified Income Fund und des PIMCO Balanced Income and Growth Fund sowie den Klassen Institutional und Investor des PIMCO Capital Securities Fund, der Anteilsklassen M Retail, BE Retail, BM Retail, um Retail und N Retail aller anderen Fonds werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteilsklassen G Institutional, G Retail und Investor ausschüttend A werden Dividendenausschüttungen jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Fonds mit ausschüttenden Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilinhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteilsklassen BM Retail dekulmlierend und M Retail dekulmlierend kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen entscheiden, die Ausschüttungen und Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen. Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können aus dem Kapital der Anteilsklassen BM Retail dekulmlierend und M Retail dekulmlierend gezahlt werden. Dies kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge unter Verzicht auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden.

Dividendenausschüttungen an Inhaber rückgabeberechtigter Anteile werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten klassifiziert. Die auf die thesaurierenden Anteile entfallenden Erträge oder Kapitalzuwachs werden weder festgesetzt noch ausgeschüttet. Statt dessen wird der NIW je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilinhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Fonds zurück. Die Anteilinhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen. Für die nachfolgenden Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

| Fonds                                            | Am 30. Jun. 2025<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2024<br>abgeschlossener<br>Berichtszeitraum |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 114                                                  | \$ 4                                                    |
| Asia Strategic Interest Bond Fund                | 3                                                       | 0                                                       |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 20.324                                                  | 2.339                                                   |
| PIMCO Capital Securities Fund                    | 0                                                       | 239                                                     |
| PIMCO Climate Bond Fund                          | 83                                                      | 16                                                      |
| Diversified Income Fund                          | 34.003                                                  | 5.512                                                   |
| Dynamic Bond Fund                                | 1.142                                                   | 1.184                                                   |
| Emerging Markets Bond Fund                       | 632                                                     | 752                                                     |
| Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 0                                                       | 260                                                     |
| PIMCO ESG Income Fund                            | 43                                                      | 0                                                       |
| Global Bond Fund                                 | 236                                                     | 776                                                     |
| Global Bond ESG Fund                             | 97                                                      | 1.437                                                   |
| Global High Yield Bond Fund                      | 618                                                     | 488                                                     |
| Global Investment Grade Credit Fund              | 3.024                                                   | 5.101                                                   |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 342                                                     | 0                                                       |
| Global Real Return Fund                          | 98                                                      | 0                                                       |
| Income Fund                                      | 21.821                                                  | 10.489                                                  |
| Low Average Duration Fund                        | 56                                                      | 23                                                      |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 13                                                      | 25                                                      |
| Low Duration Opportunities Fund                  | 5.249                                                   | 6.096                                                   |
| Total Return Bond Fund                           | 9                                                       | 106                                                     |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 212                                                     | 155                                                     |
| UK Corporate Bond Fund                           | £ 1.121                                                 | £ 1.595                                                 |
| US High Yield Bond Fund                          | \$ 5                                                    | \$ 0                                                    |



## 6. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um Investmentgesellschaften im Sinne der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente („MiFID“) handelt oder die gleichwertigen regulatorischen Bestimmungen unterliegen, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

## 7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungsrennung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Fonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Fonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Fonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Fonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

## 8. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER ERGÄNZUNG, AN DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND AN DER SATZUNG

Am 14. April 2025 und wie den entsprechenden Anteilinhabern zuvor mitgeteilt, wurden die Ergänzungen für den PIMCO Balanced Income and Growth Fund und den PIMCO Capital Securities Fund aktualisiert, um eine Änderung der Ausschüttungshäufigkeit bestimmter Klassen von vierteljährlich auf monatlich widerzuspiegeln. Diese Änderung betrifft alle Administrative-Klassen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund und alle Institutional-, Investor-Income- und Investor-Income-II-Klassen des PIMCO Capital Securities Fund.

Am 15. Mai 2025 wurden die Ergänzungen für den PIMCO Climate Bond Fund, Diversified Income ESG Fund, Emerging Local Bond ESG Fund, Emerging Markets Bond ESG Fund, PIMCO ESG Income Fund, Global Bond ESG Fund, Global High Yield Bond ESG Fund, Global Investment Grade Credit ESG Fund und Low Duration Opportunities ESG Fund aktualisiert, um die Anforderungen der Richtlinien der European Securities and Markets Authority („ESMA“) zur Fondsbenennung zu berücksichtigen, einschließlich der zusätzlichen Angabe, dass die Fonds Anlagen vermeiden sollen, die gegen Ausschlusskriterien für Paris-abgestimmte EU-Referenzwerte verstoßen. Darüber hinaus wurde die Ergänzung für den PIMCO Climate Bond Fund aktualisiert, um die Mindestverpflichtung des Fonds für nachhaltige Investitionen von 66 % auf 80 % zu erhöhen.

Am 29. Mai 2025 wurde die Ergänzung für den PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund aktualisiert, um den bestehenden Verzicht auf die Verwaltungsgebühr von 15 Basispunkten zu streichen und die Gesamtgebühr für alle Klassen des Fonds um 16 Basispunkte zu senken.

Am selben Tag wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die Class H Institutional um ein Jahr bis zum 30. Juni 2026 zu verlängern.

Am 3. Juni 2025 wurde die Ergänzung für den StocksPLUS™ Fund aktualisiert, um eine neue Anteilsklasse des Fonds, die BM Retail Class, aufzulegen.

Am 23. Juni 2025 wurde die Ergänzung für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund aktualisiert, um explizit darauf zu verweisen, dass der Fonds ökologische und soziale Merkmale bewerten wird, indem verbindliche ESG-Kriterien für die Auswahl von Basiswerten umgesetzt werden, die den aktuellen Anlagestrategien des Fonds entsprechen. Die Ergänzung für den Fonds wurde aktualisiert, um einen vorvertraglichen Anhang aufzunehmen, der im Rahmen der Offenlegungsverordnung erforderlich ist.

An der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft wurden während des Berichtszeitraums keine Änderungen vorgenommen.

## 9. GEBÜHREN UND KOSTEN

### (a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Mit Ausnahme der Anteilsklassen BM Retail und BE Retail, wie in der entsprechenden Fondsergänzung angegeben, darf die Gesamtgebühr 2,50 % p. a. des NIW jedes Fonds nicht übersteigen. Gesamtgebühr bezeichnet die Verwaltungsgebühr zuzüglich der geltenden Servicegebühr, Bestandspflegegebühr oder Vertriebsgebühr, wie in der Fondsergänzung in Bezug auf die jeweiligen Anteilsklassen dargelegt.

### (b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Fonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Fonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Fonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Fonds erbracht hat.

Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Fonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

|                                                      | Anteilsklassen<br>Inst'l, Inv,<br>Admin (%) | H<br>Inst'l (%) | BE Retail<br>BM Retail<br>E Class,<br>G Retail,<br>M Retail,<br>N Retail,<br>T Class (%) | Class<br>R (%) | UM<br>Retail,<br>Class<br>W (%) |
|------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------------------------|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                      | 0,65                                        | 0,82            | 1,55                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Asia Strategic Interest Bond Fund                    | 0,65                                        | k. A.           | 1,50                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund <sup>(1)</sup> | 0,95                                        | 1,12            | 2,15                                                                                     | k. A.          | 1,60                            |
| PIMCO Capital Securities Fund                        | 0,79                                        | k. A.           | 1,69                                                                                     | 0,93           | k. A.                           |
| PIMCO Climate Bond Fund                              | 0,52                                        | k. A.           | 1,42                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Commodity Real Return Fund                           | 0,74                                        | 0,91            | 1,64                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund                 | 0,65                                        | 0,82            | 1,55                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Diversified Income Fund                              | 0,69                                        | 0,86            | 1,59                                                                                     | k. A.          | 0,55                            |
| Diversified Income Duration Hedged Fund              | 0,69                                        | k. A.           | 1,59                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Diversified Income ESG Fund                          | 0,72                                        | k. A.           | 1,62                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Dynamic Bond Fund                                    | 0,90                                        | 1,07            | 1,80                                                                                     | 0,99           | k. A.                           |
| Emerging Local Bond Fund                             | 0,89                                        | 1,06            | 1,89                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Emerging Local Bond ESG Fund                         | 0,92                                        | k. A.           | 1,92                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Emerging Markets Bond Fund                           | 0,79                                        | 0,96            | 1,69                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Emerging Markets Bond ESG Fund                       | 0,82                                        | k. A.           | 1,72                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund                 | 0,86                                        | k. A.           | 1,76                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund            | 0,79                                        | k. A.           | 1,69                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund      | 0,85                                        | k. A.           | 1,75                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| PIMCO ESG Income Fund                                | 0,59                                        | k. A.           | 1,49                                                                                     | 0,82           | k. A.                           |
| Euro Bond Fund                                       | 0,46                                        | k. A.           | 1,36                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Euro Credit Fund <sup>(2)</sup>                      | 0,46                                        | 0,38            | 1,36                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Euro Income Bond Fund                                | 0,49                                        | k. A.           | 1,39                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Euro Long Average Duration Fund                      | 0,46                                        | k. A.           | 1,36                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Euro Short-Term Fund                                 | 0,29                                        | k. A.           | 1,04                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| PIMCO European High Yield Bond Fund                  | 0,55                                        | k. A.           | 1,45                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |

|                                                  | Anteilsklassen<br>Inst'l, Inv,<br>Admin (%) | H<br>Inst'l (%) | BE Retail<br>BM Retail<br>E Class,<br>G Retail,<br>M Retail,<br>N Retail,<br>T Class (%) | Class<br>R (%) | UM<br>Retail,<br>Class<br>W (%) |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|---------------------------------|
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 0,32                                        | 0,49            | 1,07                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Global Advantage Fund                            | 0,70                                        | k. A.           | 1,70                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Global Bond Fund                                 | 0,49                                        | 0,66            | 1,39                                                                                     | 0,76           | 0,39                            |
| Global Bond ESG Fund                             | 0,52                                        | k. A.           | 1,42                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Global Bond Ex-US Fund                           | 0,49                                        | 0,66            | 1,39                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Global High Yield Bond Fund                      | 0,55                                        | 0,72            | 1,45                                                                                     | 0,80           | k. A.                           |
| Global High Yield Bond ESG Fund                  | 0,58                                        | k. A.           | 1,48                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Global Investment Grade Credit Fund              | 0,49                                        | 0,66            | 1,39                                                                                     | 0,76           | 0,39                            |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 0,52                                        | k. A.           | 1,42                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Global Low Duration Real Return Fund             | 0,49                                        | k. A.           | 1,39                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Global Real Return Fund                          | 0,49                                        | 0,66            | 1,39                                                                                     | 0,76           | k. A.                           |
| Income Fund                                      | 0,55                                        | 0,72            | 1,45                                                                                     | 0,80           | k. A.                           |
| Income Fund II                                   | 0,55                                        | k. A.           | 1,45                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Inflation Multi-Asset Fund                       | 0,79                                        | k. A.           | 1,69                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Low Average Duration Fund                        | 0,46                                        | 0,63            | 1,36                                                                                     | 0,75           | k. A.                           |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0,49                                        | k. A.           | 1,39                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Low Duration Income Fund                         | 0,55                                        | 0,72            | 1,45                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Low Duration Opportunities Fund                  | 0,49                                        | k. A.           | 1,20                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Low Duration Opportunities ESG Fund              | 0,52                                        | k. A.           | k. A.                                                                                    | k. A.          | k. A.                           |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 0,99                                        | k. A.           | 1,89                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Mortgage Opportunities Fund                      | 0,69                                        | 0,86            | 1,59                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| StocksPLUS™ Fund                                 | 0,55                                        | 0,72            | 1,45                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 0,69                                        | k. A.           | k. A.                                                                                    | k. A.          | k. A.                           |
| Strategic Income Fund                            | 0,79                                        | k. A.           | 1,69                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| Total Return Bond Fund                           | 0,50                                        | 0,67            | 1,40                                                                                     | 0,77           | k. A.                           |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 1,40                                        | 1,57            | 2,50                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| UK Corporate Bond Fund <sup>(3)</sup>            | 0,46                                        | 0,29            | k. A.                                                                                    | k. A.          | k. A.                           |
| UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 0,46                                        | k. A.           | k. A.                                                                                    | k. A.          | k. A.                           |
| US High Yield Bond Fund                          | 0,55                                        | 0,72            | 1,45                                                                                     | 0,80           | k. A.                           |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund          | 0,49                                        | 0,66            | 1,39                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |
| US Short-Term Fund <sup>(4)</sup>                | 0,45                                        | 0,62            | 0,85                                                                                     | k. A.          | k. A.                           |

<sup>(1)</sup> In den Gebühren der Anteilsklassen BM Retail und M Retail wird kein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,55 % p. a. berücksichtigt. Die Gebührenverzeichte laufen zum 29. November 2028 ab.

<sup>(2)</sup> In den Gebühren der Class H Institutional wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,25 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht läuft zum 1. Juli 2026 ab.

<sup>(3)</sup> In den Gebühren der Class H Institutional wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,34 % p. a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht läuft zum 31. August 2025 ab.

<sup>(4)</sup> In den Gebühren für die Class E wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p. a. berücksichtigt, der sich bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Fonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebühren für alle Fonds (mit Ausnahme des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund) blieben während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2025 unverändert.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, BE Retail, BM Retail, Class E, G Retail, M Retail, N Retail, Class T und UM Retail fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Broker-Händler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilinhabern dieser Anteilsklassen der Fonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilinhabern getragen. Die Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite kämen alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilinhabern zugute. Dies betrifft u. a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z (die Class Z werden primär für andere Fonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben) und um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Class Z auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

#### (c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Fonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

#### (d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Verwahr- und Unterdepotdienste für die einzelnen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste von Notierungsmaklern, Zahlstellen und anderen Vertretern vor Ort sowie Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Fonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen im Zusammenhang mit Due-Diligence-Prüfungen von Anlagen und potenziellen Anlagen und/oder im Zusammenhang mit Verhandlungen über solche Transaktionen), Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft bezahlte den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2025 Honorare in Höhe von 90.000 EUR (30. Juni 2024: 75.000 EUR). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine separate Vergütung für ihre Position als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft. Die Verwaltungsrats honorare sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

**Servicegebühr** Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor-Klassen anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Broker-Händler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilinhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber der Investor Classes. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilinhaberanfragen zu den Fonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilinhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilinhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilinhaber im Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilinhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Der Satz der Servicegebühren blieb während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024 unverändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Fonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Broker-Dealer, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**Bestandspflegegebühr** Die Bestandspflegegebühr für Administrative-Klassen ist an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen zahlbar, die sie den Anteilinhabern der Fonds erbringt, und für die Führung der Anteilinhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefonkosten und Gemeinkosten) von Finanzberatern oder sonstigen Mitarbeitern beteiligt oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilinhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilinhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilinhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Broker-Dealer, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber von Administrative-Klassen. Die Bestandspflegegebühr wird auf der Grundlage von 0,50 % p. a. des NIW jedes Fonds berechnet, mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund, für den die Berechnung auf der Grundlage von 0,75 % p. a. erfolgt, und ist den Administrative-Klassen zuzuordnen. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Broker-Dealer, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Der Satz der Bestandspflegegebühren blieb während der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024 unverändert.

(e) Vertriebsgebühr

Die Vertriebsgebühr, die für die Anteilklassen Class T, BN Retail, BM Retail und BE Retail anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilinhabern des Fonds erbracht hat.

Diese Dienste werden direkt von der Vertriebsstelle oder indirekt über Broker-Dealer, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre an alle Anteilinhaber der Class T erbracht. Die Vertriebsgebühr wird auf der Grundlage von 0,40 % p. a. des NIW jedes Teilfonds berechnet, der auf die Anteilklassen der Class T entfällt, mit Ausnahme des Global Bond Fund und des Total Return Bond Fund, für die eine Vertriebsgebühr von 0,30 % p. a. des NIW des Teilfonds anfällt, der auf die Anteilklassen der Class T entfällt.

Nur in Bezug auf die Anteilklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail kann, sofern in der entsprechenden Ergänzung angegeben, die Vertriebsgebühr bis zu 1 % des NIW betragen. Daher kann die Gesamtgebühr 2,50 % des NIW übersteigen.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Der Satz der Vertriebsgebühr blieb während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024 unverändert.

(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)

Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Fonds für alle Klassen des Fonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsratshonorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsratshonorare) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Basis des Fonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Fonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf die sie verzichtet, die sie reduziert oder erstattet hat, und dies gemäß dem Verwaltungsvertrag (der „Erstattungsbetrag“) während der vorangegangenen 36 Monate, vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf pro Jahr 0,0049 % vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Fonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbetrag; 3) enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Fonds einen negativen Ertrag behält.

Die in der Betriebsergebnisrechnung angegebene Verwaltungsgebühr wird vor Berücksichtigung des jeweils gegebenenfalls gewährten Verzichts auf Verwaltungsgebühren angegeben. Die Verzichte auf Verwaltungsgebühren werden in der Betriebsergebnisrechnung unter Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaften ausgewiesen. Die Verwaltungsgebühr wird der Verwaltungsgesellschaft nach Berücksichtigung des Verzichts gezahlt.

10. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN VERBUNDENEN PARTEIEN

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien der Gesellschaft. An diese Parteien gegebenenfalls zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 9 offengelegt.

Zum 30. Juni 2025 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.291.214 (31. Dezember 2024: 1.260.087) Anteile des US Short-Term Fund.

Jeder Fonds kann in die anderen Fonds der Gesellschaft und/oder andere Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, die von der Verwaltungsgesellschaft oder von mit der Verwaltungsgesellschaft verbundenen Unternehmen verwaltet werden (der „verbundene Fonds“). Die folgenden Teilfonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2025 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

| 30. Jun. 2025                                       |                                           |
|-----------------------------------------------------|-------------------------------------------|
| Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |                                           |
| Fonds                                               |                                           |
| Diversified Income Fund                             | US Short-Term Fund                        |
| Diversified Income Duration Hedged Fund             | US Short-Term Fund                        |
| Diversified Income ESG Fund                         | PIMCO ESG Income Fund                     |
| Dynamic Bond Fund                                   | PIMCO Asia High Yield Bond Fund           |
| Dynamic Bond Fund                                   | Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Dynamic Bond Fund                                   | US Short-Term Fund                        |
| Emerging Local Bond Fund                            | Asia Strategic Interest Bond Fund         |
| Emerging Local Bond Fund                            | Emerging Local Bond ESG Fund              |
| Emerging Local Bond Fund                            | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Emerging Markets Bond Fund                          | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund |
| Euro Income Bond Fund                               | PIMCO European High Yield Bond Fund       |

|                                                  | 30. Jun. 2025                                       |
|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| Fonds                                            | Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
| Global Bond Fund                                 | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| Global Bond Fund                                 | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Bond Fund                                 | Global Bond Ex-US Fund                              |
| Global Bond Fund                                 | UK Corporate Bond Fund                              |
| Global High Yield Bond Fund                      | US Short-Term Fund                                  |
| Global Investment Grade Credit Fund              | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Investment Grade Credit Fund              | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Global Investment Grade Credit Fund              | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund                |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund          | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Low Average Duration Fund                        | PIMCO Climate Bond Fund                             |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | US Short-Term Fund                                  |
| Low Duration Opportunities Fund                  | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund                |
| Low Duration Opportunities Fund                  | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Total Return Bond Fund                           | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| US High Yield Bond Fund                          | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund          | US Short-Term Fund                                  |
|                                                  | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
|                                                  | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund                |

Die folgenden Teilfonds hielten zum 31. Dezember 2024 Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft im vergleichenden Finanzstatus der Teilfonds eliminiert.

|                                         | 31. Dez. 2024                                       |
|-----------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| Fonds                                   | Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
| Diversified Income Fund                 | US Short-Term Fund                                  |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | US Short-Term Fund                                  |
| Diversified Income ESG Fund             | PIMCO ESG Income Fund                               |
| Dynamic Bond Fund                       | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Dynamic Bond Fund                       | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Dynamic Bond Fund                       | US Short-Term Fund                                  |
| Emerging Local Bond Fund                | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Emerging Local Bond Fund                | Emerging Local Bond ESG Fund                        |
| Emerging Markets Bond Fund              | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| Euro Income Bond Fund                   | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| Global Bond Fund                        | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Bond Fund                        | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Bond Fund                        | Global Bond Ex-US Fund                              |
| Global Bond Fund                        | UK Corporate Bond Fund                              |
| Global High Yield Bond Fund             | US Short-Term Fund                                  |
| Global Investment Grade Credit Fund     | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Investment Grade Credit Fund     | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Low Average Duration Fund               | PIMCO Climate Bond Fund                             |
| Low Duration Opportunities Fund         | US Short-Term Fund                                  |
| Low Duration Opportunities Fund         | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Total Return Bond Fund                  | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Total Return Bond Fund                  | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| US High Yield Bond Fund                 | US Short-Term Fund                                  |
| US High Yield Bond Fund                 | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
|                                         | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |

Die folgenden Teilfonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft in der vergleichenden Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Teilfonds eliminiert.

|                                         | 30. Jun. 2024                                       |
|-----------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| Fonds                                   | Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
| Diversified Income Fund                 | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Diversified Income Fund                 | US Short-Term Fund                                  |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | US Short-Term Fund                                  |
| Diversified Income ESG Fund             | Emerging Markets Bond ESG Fund                      |
| Diversified Income ESG Fund             | Global Investment Grade Credit ESG Fund             |
| Dynamic Bond Fund                       | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Dynamic Bond Fund                       | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Dynamic Bond Fund                       | US Short-Term Fund                                  |
| Dynamic Multi-Asset Fund                | PIMCO Capital Securities Fund                       |
| Dynamic Multi-Asset Fund                | Income Fund                                         |
| Dynamic Multi-Asset Fund                | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund          |
| Emerging Local Bond Fund                | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Emerging Local Bond Fund                | Emerging Local Bond ESG Fund                        |
| Emerging Local Bond Fund                | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| Emerging Markets Bond Fund              | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| Euro Income Bond Fund                   | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Bond Fund                        | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| Global Bond Fund                        | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Bond Fund                        | Global Bond Ex-US Fund                              |
| Global Bond Fund                        | UK Corporate Bond Fund                              |
| Global High Yield Bond Fund             | US Short-Term Fund                                  |
| Global High Yield Bond Fund             | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Global Investment Grade Credit Fund     | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Global Investment Grade Credit Fund     | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Global Investment Grade Credit Fund     | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Low Average Duration Fund               | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |
| Low Duration Opportunities Fund         | US Short-Term Fund                                  |
| Low Duration Opportunities Fund         | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| Total Return Bond Fund                  | Asia Strategic Interest Bond Fund                   |
| Total Return Bond Fund                  | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund           |
| Total Return Bond Fund                  | US Short-Term Fund                                  |
| US High Yield Bond Fund                 | PIMCO Asia High Yield Bond Fund                     |
| US High Yield Bond Fund                 | PIMCO European High Yield Bond Fund                 |

Bestimmte Fonds investieren in die Class Z des PIMCO China Bond Fund, ein Fonds der PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c., und in den PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, ein Fonds der PIMCO Select Funds plc, die als verbundene Fonds gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Fonds investieren in den PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, den PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, den PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF und in den PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, die alle Fonds der PIMCO ETFs plc sind und als verbundene Fonds gelten. Da diese Fonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, werden die Verwaltungsgebühren vom investierenden Fonds und vom zugrunde liegenden verbundenen Fonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaften ausgewiesen wird.



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Während der Geschäftsjahre zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024 kauften und verkauften die unten erwähnten Fonds Wertpapiere verbundener Fonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds vor (Angaben in Tausend):

| Fonds                                            | 30. Jun. 2025 |            |
|--------------------------------------------------|---------------|------------|
|                                                  | Käufe         | Verkäufe   |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 327.806    | \$ 409.212 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund                | 28.683        | 28.107     |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 752.066       | 692.030    |
| PIMCO Capital Securities Fund                    | 3.800         | 903        |
| PIMCO Climate Bond Fund                          | 0             | 6.858      |
| Commodity Real Return Fund                       | 1             | 0          |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 1.087         | 14.809     |
| Diversified Income Fund                          | 1.069.982     | 882.587    |
| Diversified Income Duration Hedged Fund          | 45.478        | 65.220     |
| Diversified Income ESG Fund                      | 522           | 2.616      |
| Dynamic Bond Fund                                | 502.045       | 440.905    |
| Emerging Local Bond Fund                         | 1.186.569     | 1.102.939  |
| Emerging Local Bond ESG Fund                     | 364           | 1.986      |
| Emerging Markets Bond Fund                       | 1.939.982     | 1.647.163  |
| Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 14.358        | 30.469     |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 68.445        | 64.400     |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 153.193       | 141.894    |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 1.202         | 1.517      |
| PIMCO ESG Income Fund                            | 0             | 173        |
| Euro Bond Fund                                   | 211.505       | 299.757    |
| Euro Credit Fund                                 | 3.170         | 3.128      |
| Euro Income Bond Fund                            | 34.268        | 135.417    |
| PIMCO European High Yield Bond Fund              | 14.372        | 2.968      |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 85.773        | 72.379     |
| Global Advantage Fund                            | 128.323       | 131.099    |
| Global Bond Fund                                 | 4.717.134     | 4.558.552  |
| Global Bond ESG Fund                             | 43.581        | 5.608      |
| Global Bond Ex-US Fund                           | 496.423       | 583.850    |
| Global High Yield Bond Fund                      | 648.703       | 688.279    |
| Global Investment Grade Credit Fund              | 1.560.769     | 1.511.819  |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 49.208        | 32.421     |
| Global Low Duration Real Return Fund             | 311.067       | 327.200    |
| Global Real Return Fund                          | 703.561       | 675.500    |
| Income Fund                                      | 6.968.397     | 6.669.053  |
| Income Fund II                                   | 104.076       | 83.800     |
| Inflation Multi-Asset Fund                       | 48.617        | 48.500     |
| Low Average Duration Fund                        | 49.303        | 39.425     |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 108.275       | 96.419     |
| Low Duration Income Fund                         | 680.572       | 653.745    |
| Low Duration Opportunities Fund                  | 37.031        | 44.087     |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 11.314        | 9.800      |
| StocksPLUS™ Fund                                 | 1.350.143     | 1.298.000  |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 210           | 200        |
| Strategic Income Fund                            | 928.967       | 858.434    |
| Total Return Bond Fund                           | 1.839.958     | 1.886.480  |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 21.029        | 31.241     |
| UK Corporate Bond Fund                           | 12.485        | 38.228     |
| UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 1.421         | 32.475     |
| US High Yield Bond Fund                          | 209.796       | 214.561    |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund          | 16.747        | 6.275      |
| US Short-Term Fund                               | 595.639       | 506.656    |

| Fonds                                            | 30. Jun. 2024 |            |
|--------------------------------------------------|---------------|------------|
|                                                  | Käufe         | Verkäufe   |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 880.701    | \$ 947.500 |
| Asia Strategic Interest Bond Fund                | 49.642        | 49.600     |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 145.683       | 105.480    |
| PIMCO Capital Securities Fund                    | 2.042         | 7.037      |
| Commodity Real Return Fund                       | 2             | 100        |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 42.749        | 43.180     |
| Diversified Income Fund                          | 636.699       | 620.993    |
| Diversified Income Duration Hedged Fund          | 16.455        | 18.849     |
| Diversified Income ESG Fund                      | 243           | 1.202      |
| Dynamic Bond Fund                                | 367.491       | 360.343    |
| Dynamic Multi-Asset Fund                         | 107.783       | 194.828    |
| Emerging Local Bond Fund                         | 1.372.991     | 1.315.194  |
| Emerging Local Bond ESG Fund                     | 1.672         | 0          |
| Emerging Markets Bond Fund                       | 1.278.090     | 1.350.461  |
| Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 17.418        | 104.264    |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 50.025        | 51.800     |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 244.585       | 229.674    |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 105           | 100        |
| PIMCO ESG Income Fund                            | 0             | 173        |
| Euro Bond Fund                                   | 35.561        | 53.398     |
| Euro Credit Fund                                 | 0             | 10.359     |
| Euro Income Bond Fund                            | 7.105         | 25.855     |
| Euro Long Average Duration Fund                  | 1.659         | 43.239     |
| PIMCO European High Yield Bond Fund              | 17.265        | 6.904      |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 76.632        | 2.307      |
| Global Advantage Fund                            | 69.804        | 76.400     |
| Global Bond Fund                                 | 1.866.023     | 1.659.511  |
| Global Bond ESG Fund                             | 11.134        | 10.396     |
| Global Bond Ex-US Fund                           | 377.793       | 338.453    |
| Global High Yield Bond Fund                      | 909.062       | 797.434    |
| Global Investment Grade Credit Fund              | 1.443.302     | 2.044.216  |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 3.239         | 26.173     |
| Global Low Duration Real Return Fund             | 253.608       | 250.900    |
| Global Real Return Fund                          | 761.717       | 783.500    |
| Income Fund                                      | 4.402.867     | 3.084.335  |
| Income Fund II                                   | 75.984        | 75.200     |
| Inflation Multi-Asset Fund                       | 45.218        | 45.770     |
| Low Average Duration Fund                        | 101.560       | 111.651    |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 258.128       | 315.768    |
| Low Duration Income Fund                         | 115.075       | 80.409     |
| Low Duration Opportunities Fund                  | 34.280        | 34.328     |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 4.833         | 3.600      |
| StocksPLUS™ Fund                                 | 230.114       | 78.300     |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | 215           | 100        |
| Strategic Income Fund                            | 90.854        | 90.985     |
| Total Return Bond Fund                           | 806.949       | 825.700    |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund       | 19.326        | 16.149     |
| UK Corporate Bond Fund                           | 20.273        | 15.732     |
| UK Long Term Corporate Bond Fund                 | 2.471         | 2.044      |
| US High Yield Bond Fund                          | 558.596       | 581.416    |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund          | 106.231       | 114.600    |
| US Short-Term Fund                               | 99.052        | 78.743     |

Die folgende Tabelle zeigt den Wert der umlaufenden Anteile im Besitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften in ihrer Eigenschaft als verbundene Parteien der Gesellschaft. Dabei handelt es sich zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

| Fonds                                              | 30. Jun. 2025<br>% Gehalten | 31. Dez. 2024<br>% Gehalten |
|----------------------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| Asia Strategic Interest Bond Fund                  | 36,92                       | 39,18                       |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund              | 24,86                       | 42,17                       |
| PIMCO Climate Bond Fund                            | k. A.                       | 20,28                       |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund               | 37,64                       | 22,00                       |
| Diversified Income ESG Fund                        | 99,92                       | 99,92                       |
| Emerging Local Bond ESG Fund                       | 23,71                       | 24,63                       |
| Emerging Markets Bond Fund                         | k. A.                       | 24,62                       |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund          | 60,78                       | 55,36                       |
| Emerging Markets Short-Term Local<br>Currency Fund | 39,44                       | 33,35                       |
| Euro Credit Fund                                   | k. A.                       | 21,61                       |
| Euro Income Bond Fund                              | 31,90                       | 31,43                       |
| Euro Short-Term Fund                               | 39,64                       | 26,40                       |
| PIMCO European High Yield Bond Fund                | 66,84                       | 67,98                       |
| PIMCO European Short-Term Opportunities<br>Fund    | 91,44                       | 93,01                       |
| Global Bond Ex-US Fund                             | k. A.                       | 23,04                       |
| Global High Yield Bond ESG Fund                    | 99,84                       | 100,00                      |
| Global Low Duration Real Return Fund               | k. A.                       | 22,21                       |
| Low Duration Opportunities Fund                    | 40,38                       | 33,94                       |
| Low Duration Opportunities ESG Fund                | 100,00                      | 100,00                      |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund             | 52,30                       | 40,15                       |
| Mortgage Opportunities Fund                        | 26,35                       | 28,92                       |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                          | 58,26                       | 61,91                       |
| Strategic Income Fund                              | 41,73                       | 39,70                       |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy<br>Fund      | 47,19                       | 31,67                       |
| UK Corporate Bond Fund                             | 23,15                       | 22,05                       |
| US Short-Term Fund                                 | 31,62                       | 28,71                       |

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2025 verkaufte der Income Fund Wertpapiere im Wert von 29.690 USD (30. Juni 2024: 53.558 USD) an Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“), eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaften ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Zum 30. Juni 2025 hielt der Income Fund 9.694 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2024: 9.694 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV., die durch von der Körperschaft begebene Schuldverschreibungen besichert sind. Während des Berichtszeitraums zahlte die Körperschaft Ausschüttungen in Höhe von insgesamt 36.159 USD (30. Juni 2024: 37.545 USD) an den Income Fund.

Während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024 investierte der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund in zwei strukturierte Schuldverschreibungen, Aries Capital DAC und Greenleaves Capital DAC, deren Erlöse zur Ausgabe von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen des PIMCO Commodities Diversified SP, einem separaten Portfolio der PIMCO Diversified Strategies SPC, verwendet wurden. PIMCO Diversified Strategies SPC, eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, ist eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaften. Es wurden keine Gebühren von PIMCO Diversified Strategies SPC an die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Zum 30. Juni 2025 belief sich der Wert der vom PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund gehaltenen strukturierten Schuldverschreibungen auf 11.423 USD (31. Dezember 2024: 26.771 USD).

Zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024 hielt der PIMCO Obbligazionario Prudente Fund, ein Fonds der PIMCO Select Funds plc, der als verbundener Fonds angesehen wird, einen AT1-Anspruch der Credit Suisse AG (der „AT1-Anspruch“). Dieser AT1-Anspruch bezieht sich auf eine Position in Unternehmensanleihen im Banken- und Finanzsektor.

Im Zusammenhang mit einer Rücknahme in Sachwerten des PIMCO Obbligazionario Prudente Fund und einer entsprechenden Zeichnung in Sachwerten des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, die am 15. Mai 2024 stattgefunden hat, wurde festgelegt, dass der AT1-Anspruch aufgrund der laufenden Klagen im Zusammenhang mit dem AT1-Anspruch nicht an den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund übertragen werden kann.

Zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024 wird der Forderungsbetrag vom PIMCO Obbligazionario Prudente Fund, der dem anteiligen Anteil des AT1-Anspruchs zuzuschreiben ist, im Finanzstatus des PIMCO European Short-Term Opportunities Fund als Forderungen gegenüber verbundenen Fonds ausgewiesen. Der PIMCO Obbligazionario Prudente Fund wird dem PIMCO European Short-Term Opportunities Fund einen Betrag in Höhe von 99,26 % einer etwaigen Nettorendite, die er in Zukunft in Bezug auf den AT1-Anspruch erhalten könnte, zahlen.

## Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 30. Juni 2025 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 5.319,15 (31. Dezember 2024: 5.319,15) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 3.619,69 (31. Dezember 2024: 3.619,69) Anteile des Global Bond Fund und 27.543,65 (31. Dezember 2024: 27.543,65) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2025 hielt Ryan P. Blute 28.827,68 (31. Dezember 2024: 28.827,68) Anteile des Low Average Duration Fund und 50.751,14 (31. Dezember 2024: 50.751,14) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2025 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2024: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 8.164,92 (31. Dezember 2024: 8.164,92) Anteile des Low Duration Income Fund und 1.775,83 (31. Dezember 2024: 1.775,83) Anteile des Low Duration Opportunities Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2025 hielt David M. Kennedy 16.786,79 (31. Dezember 2024: 16.786,79) Anteile des PIMCO Balanced Income and Growth Fund, 3.820,99 (31. Dezember 2024: 3.939,17) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 21.030,49 (31. Dezember 2024: 21.030,49) Anteile des Global Investment Grade Credit Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2025 hielt Myles Lee 9.271,85 (31. Dezember 2024: 9.271,85) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund und 598,86 (31. Dezember 2024: 598,86) Anteile des Euro Bond Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Die Gesellschaft beschäftigte zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 keine Mitarbeiter.

## 11. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilhaber sind. Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Parteien wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Berichtszeitraums eingehalten wurden.

## 12. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Fonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 30. Juni 2025 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (0,85190 USD/EUR) (31. Dezember 2024: 0,96572 USD/EUR) und von Pfund Sterling in US-Dollar (0,72974 USD/GBP) (31. Dezember 2024: 0,79847 USD/GBP) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen während des am 30. Juni 2025 endenden Berichtszeitraums geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (0,91582 USD/EUR) (30. Juni 2024: 0,92515 USD/EUR) und von Pfund Sterling in US-Dollar (0,77142 USD/GBP) (30. Juni 2024: 0,79066 USD/GBP) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder.



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Die Wechselkurse für den argentinischen Peso („ARS“) zum 30. Juni 2025 spiegeln die offiziellen Kurse wider. Zum 31. Dezember 2024 enthielten sie einen Abschlag von 15 % aufgrund einer Diskrepanz zwischen den offiziellen und inoffiziellen Wechselkursen Argentiniens.

| Fremdwährung  | 30. Juni 2025<br>Präsentationswährung |              |              |
|---------------|---------------------------------------|--------------|--------------|
|               | EUR                                   | GBP          | USD          |
| AED           | k. A.                                 | k. A.        | 3,67285      |
| ARS           | 1.397,49817                           | k. A.        | 1.190,52590  |
| AUD           | 1,79118                               | 2,09102      | 1,52590      |
| AZN           | k. A.                                 | k. A.        | 1,70250      |
| BRL           | 6,40669                               | 7,47916      | 5,45785      |
| CAD           | 1,60172                               | 1,86984      | 1,36450      |
| CHF           | 0,93438                               | 1,09080      | 0,79600      |
| CLP           | k. A.                                 | k. A.        | 933,42500    |
| CNH           | 8,40846                               | 9,81602      | 7,16315      |
| CNY           | 8,41122                               | 9,81924      | 7,16550      |
| COP           | k. A.                                 | k. A.        | 4.085,00000  |
| CZK           | 24,71804                              | 28,85579     | 21,05725     |
| DKK           | 7,46075                               | 8,70967      | 6,35580      |
| DOP           | k. A.                                 | k. A.        | 59,72200     |
| EGP           | k. A.                                 | k. A.        | 49,55000     |
| EUR (oder €)  | 1,00000                               | 1,16740      | 0,85190      |
| GBP (oder £)  | 0,85661                               | 1,00000      | 0,72974      |
| GHS           | k. A.                                 | k. A.        | 10,35000     |
| HKD           | 9,21472                               | k. A.        | 7,85000      |
| HUF           | 399,69979                             | 466,60863    | 340,50345    |
| IDR           | 19.057,44584                          | 22.247,61936 | 16.235,00000 |
| ILS           | 3,95294                               | 4,61465      | 3,36750      |
| INR           | 100,66933                             | 117,52115    | 85,76000     |
| JPY (oder ¥)  | 169,55668                             | 197,94009    | 144,44500    |
| KES           | k. A.                                 | k. A.        | 129,25000    |
| KRW           | 1.584,22722                           | 1.849,42329  | 1.349,60000  |
| KWD           | 0,35890                               | k. A.        | 0,30575      |
| KZT           | k. A.                                 | k. A.        | 519,63000    |
| MXN           | 22,17636                              | 25,88864     | 18,89200     |
| MYR           | k. A.                                 | k. A.        | 4,21050      |
| NGN           | 1.801,20155                           | k. A.        | 1.534,44000  |
| NOK           | 11,87900                              | 13,86752     | 10,11970     |
| NZD           | 1,93370                               | 2,25739      | 1,64731      |
| PEN           | 4,16540                               | 4,86268      | 3,54850      |
| PHP           | k. A.                                 | k. A.        | 56,33000     |
| PKR           | k. A.                                 | k. A.        | 285,05000    |
| PLN           | 4,24200                               | 4,95210      | 3,61375      |
| PYG           | k. A.                                 | k. A.        | 7.980,00000  |
| QAR           | k. A.                                 | k. A.        | 3,64100      |
| RON           | k. A.                                 | k. A.        | 4,32670      |
| RSD           | k. A.                                 | k. A.        | 99,80500     |
| RUB           | 91,79503                              | k. A.        | 78,20000     |
| SEK           | 11,18725                              | 13,05998     | 9,53040      |
| SGD           | 1,49507                               | 1,74535      | 1,27365      |
| THB           | 38,16038                              | 44,54834     | 32,50875     |
| TRY           | 46,71158                              | 54,53099     | 39,79350     |
| TWD           | 34,29049                              | 40,03064     | 29,21200     |
| UGX           | k. A.                                 | k. A.        | 3.595,00000  |
| USD (oder \$) | 1,17385                               | 1,37035      | 1,00000      |
| UYU           | k. A.                                 | k. A.        | 39,96000     |
| UZS           | k. A.                                 | k. A.        | 12.694,97000 |
| VND           | k. A.                                 | k. A.        | 26.120,50000 |
| ZAR           | 20,86077                              | 24,35282     | 17,77125     |
| ZMW           | k. A.                                 | k. A.        | 23,89500     |

| Fremdwährung  | 31. Dez. 2024<br>Präsentationswährung |              |              |
|---------------|---------------------------------------|--------------|--------------|
|               | EUR                                   | GBP          | USD          |
| AED           | k. A.                                 | k. A.        | 3,67305      |
| ARS           | 1.231,37524                           | k. A.        | 1.189,16000  |
| AUD           | 1,67245                               | 2,02277      | 1,61512      |
| AZN           | k. A.                                 | k. A.        | 1,69925      |
| BRL           | 6,39716                               | 7,73714      | 6,17785      |
| CAD           | 1,48926                               | 1,80120      | 1,43820      |
| CHF           | 0,93842                               | 1,13499      | 0,90625      |
| CLP           | k. A.                                 | k. A.        | 994,52500    |
| CNH           | 7,60212                               | 9,19449      | 7,34150      |
| CNY           | 7,55837                               | 9,14158      | 7,29925      |
| COP           | k. A.                                 | k. A.        | 4.405,54000  |
| CZK           | 25,17503                              | k. A.        | 24,31195     |
| DKK           | 7,45726                               | 9,01928      | 7,20160      |
| DOP           | k. A.                                 | k. A.        | 61,06000     |
| EGP           | k. A.                                 | k. A.        | 50,83000     |
| EUR (oder €)  | 1,00000                               | 1,20946      | 0,96572      |
| GBP (oder £)  | 0,82681                               | 1,00000      | 0,79847      |
| GHS           | k. A.                                 | k. A.        | 14,70000     |
| HKD           | 8,04371                               | k. A.        | 7,76795      |
| HUF           | 411,36503                             | 497,53114    | 397,26220    |
| IDR           | 16.666,37327                          | 20.157,37657 | 16.095,00000 |
| ILS           | 3,77300                               | 4,56331      | 3,64365      |
| INR           | 88,65304                              | 107,22265    | 85,61375     |
| JPY (oder ¥)  | 162,73919                             | 196,82717    | 157,16000    |
| KES           | k. A.                                 | k. A.        | 129,35000    |
| KRW           | 1.524,41140                           | 1.843,72053  | 1.472,15000  |
| KWD           | 0,31924                               | k. A.        | 0,30830      |
| KZT           | k. A.                                 | k. A.        | 524,61000    |
| MXN           | 21,53089                              | 26,04084     | 20,79275     |
| MYR           | k. A.                                 | k. A.        | 4,47150      |
| NGN           | k. A.                                 | k. A.        | 1.544,00000  |
| NOK           | 11,76054                              | 14,22394     | 11,35735     |
| NZD           | 1,84828                               | 2,23543      | 1,78492      |
| PEN           | 3,89027                               | 4,70514      | 3,75690      |
| PHP           | k. A.                                 | k. A.        | 57,84500     |
| PKR           | k. A.                                 | k. A.        | 278,37500    |
| PLN           | 4,27724                               | 5,17316      | 4,13060      |
| PYG           | k. A.                                 | k. A.        | 7.828,15000  |
| QAR           | k. A.                                 | k. A.        | 3,64100      |
| RON           | k. A.                                 | k. A.        | 4,80490      |
| RSD           | k. A.                                 | k. A.        | 112,95000    |
| RUB           | 113,64613                             | k. A.        | 109,75000    |
| SEK           | 11,44150                              | 13,83808     | 11,04925     |
| SGD           | 1,41263                               | 1,70852      | 1,36420      |
| THB           | k. A.                                 | k. A.        | 34,09500     |
| TRY           | 36,61580                              | 44,28549     | 35,36050     |
| TWD           | 33,94835                              | 41,05930     | 32,78450     |
| UGX           | k. A.                                 | k. A.        | 3.700,00000  |
| USD (oder \$) | 1,03550                               | 1,25240      | 1,00000      |
| UYU           | k. A.                                 | k. A.        | 43,66500     |
| UZS           | k. A.                                 | k. A.        | 12.920,48000 |
| VND           | k. A.                                 | k. A.        | 25.485,00000 |
| ZAR           | 19,53989                              | 23,63279     | 18,87000     |
| ZMW           | k. A.                                 | k. A.        | 27,88070     |

### 13. FINANZIELLE RISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Teilfonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko.

Der allgemeine Risikomanagementprozess der Teilfonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Teilfonds zu minimieren. Weitere Einzelheiten zu den verschiedenen Risiken, denen der Fonds ausgesetzt sein kann, entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 angegeben sind.

14. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Berichtszeitraums zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Jahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitgliedern der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

Folgende Transaktionen wurden in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2025 und 30. Juni 2024 über einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine verbundene Person der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft handelt:

| Fonds                                           | 30. Jun. 2025                   |                            | 30. Jun. 2024                   |                            |
|-------------------------------------------------|---------------------------------|----------------------------|---------------------------------|----------------------------|
|                                                 | Summe Käufe und Verkäufe (Tsd.) | % Summe Käufe und Verkäufe | Summe Käufe und Verkäufe (Tsd.) | % Summe Käufe und Verkäufe |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                 | \$ 39.593                       | 0,48                       | \$ 820.673                      | 8,71                       |
| Asia Strategic Interest Bond Fund               | 5.110                           | 0,37                       | 116.470                         | 15,69                      |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund           | 423.679                         | 1,50                       | 413.208                         | 4,24                       |
| Commodity Real Return Fund                      | 15.625.058                      | 34,75                      | 12.740.023                      | 27,52                      |
| Diversified Income Fund                         | 2.281.469                       | 1,77                       | 2.710.882                       | 1,52                       |
| Emerging Local Bond Fund                        | 455.772                         | 0,51                       | 1.830.598                       | 3,28                       |
| Emerging Markets Bond Fund                      | 259.930                         | 0,96                       | 1.032.277                       | 4,13                       |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 2.248                           | 0,32                       | 28.872                          | 5,77                       |
| Global Bond Fund                                | 11.190.808                      | 2,98                       | 2.911.740                       | 0,90                       |
| Global High Yield Bond Fund                     | 377.310                         | 1,86                       | 265.166                         | 1,40                       |
| Global Investment Grade Credit Fund             | 1.702.016                       | 1,74                       | 1.064.468                       | 1,21                       |
| Global Real Return Fund                         | 57.649.634                      | 36,94                      | 65.620.568                      | 36,75                      |
| Income Fund                                     | 38.924.867                      | 1,90                       | 28.327.869                      | 1,78                       |
| Income Fund II                                  | 166.529                         | 4,22                       | 154.713                         | 3,11                       |
| Low Average Duration Fund                       | 5.723.585                       | 23,26                      | 2.716.346                       | 12,45                      |
| Total Return Bond Fund                          | 8.386.509                       | 9,96                       | 421.391                         | 0,63                       |
| US High Yield Bond Fund                         | 124.656                         | 0,77                       | 698.855                         | 12,52                      |

Es wurde in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2025 und 30. Juni 2024 keine Provision für die Transaktionen in der vorstehenden Tabelle erhoben.

Einzelheiten zu Aktien, die in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2025 und 30. Juni 2024 durch Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft in durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2025 und 30. Juni 2024 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, sind Erläuterung 9 zu entnehmen.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2025 und 31. Dezember 2024 durch verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten wurden und über 20 % des Nettovermögens von durch die SFC zugelassenen Fonds betragen, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 9 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2025 und im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2024 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 9 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds wurden entweder von State Street Bank and Trust Co., in ihrer Eigenschaft als Beauftragte der Verwahrstelle, oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

15. GRUNDKAPITAL

(a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 EUR und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 EUR und 500.000.000.000 gewinnberechtigte Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

(b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschäftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

(c) Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

16. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Fonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der NIW je Anteil der vergangenen drei Berichtszeiträume (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der in diesem Abschluss angegebene NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen enthalten. Diese können dazu führen, dass die NIW oder Gesamterträgen der Anteilinhaber von denjenigen abweichen, die in diesem Abschluss angegeben sind. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025            |           | Zum<br>31. Dez. 2024 |           | Zum<br>31. Dez. 2023 |           |
|---------------------------------------|---------------------------------|-----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|                                       | PIMCO Asia High Yield Bond Fund |           |                      |           |                      |           |
| Nettovermögen                         | \$                              | 1.467.805 | \$                   | 1.833.693 | \$                   | 2.434.728 |
| Institutional:                        |                                 |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                              | 810.162   | \$                   | 1.161.904 | \$                   | 1.472.296 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                 | 76.617    |                      | 114.470   |                      | 164.619   |
| NIW je Anteil                         | \$                              | 10,57     | \$                   | 10,15     | \$                   | 8,94      |
| Erträge                               | \$                              | 101.617   | \$                   | 122.069   | \$                   | 125.117   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                 | 14.878    |                      | 17.736    |                      | 19.073    |
| NIW je Anteil                         | \$                              | 6,83      | \$                   | 6,88      | \$                   | 6,56      |
| Institutional AUD (Hedged):           |                                 |           |                      |           |                      |           |
| Erträge                               | AUD                             | 132       | AUD                  | 133       | AUD                  | 128       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                 | 20        |                      | 20        |                      | 20        |
| NIW je Anteil                         | AUD                             | 6,70      | AUD                  | 6,76      | AUD                  | 6,50      |
| Institutional CHF (Hedged):           |                                 |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | CHF                             | 2.341     | CHF                  | 2.362     | CHF                  | 2.735     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                 | 281       |                      | 290       |                      | 365       |
| NIW je Anteil                         | CHF                             | 8,33      | CHF                  | 8,15      | CHF                  | 7,49      |
| Erträge                               | CHF                             | 1.246     | CHF                  | 1.362     | CHF                  | 1.582     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                 | 211       |                      | 224       |                      | 262       |
| NIW je Anteil                         | CHF                             | 5,92      | CHF                  | 6,08      | CHF                  | 6,04      |
| Institutional EUR (Hedged):           |                                 |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                               | 185.030   | €                    | 196.355   | €                    | 275.717   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                 | 20.830    |                      | 22.834    |                      | 35.835    |
| NIW je Anteil                         | €                               | 8,88      | €                    | 8,60      | €                    | 7,69      |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025                        |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |  |
|----------------------------------------------|-----|---------------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|--|
|                                              |     | PIMCO Asia High Yield Bond<br>Fund (Forts.) |     |                      |     |                      |  |
| Erträge                                      | €   | 17.927                                      | €   | 18.695               | €   | 20.415               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.852                                       |     | 2.927                |     | 3.301                |  |
| NIW je Anteil                                | €   | 6,29                                        | €   | 6,39                 | €   | 6,18                 |  |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £   | 2.711                                       | £   | 2.311                | £   | 13.169               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 294                                         |     | 261                  |     | 1.685                |  |
| NIW je Anteil                                | £   | 9,22                                        | £   | 8,85                 | £   | 7,82                 |  |
| Erträge                                      | £   | 11.078                                      | £   | 11.481               | £   | 17.555               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.726                                       |     | 1.762                |     | 2.820                |  |
| NIW je Anteil                                | £   | 6,42                                        | £   | 6,52                 | £   | 6,22                 |  |
| Institutional SGD (Hedged):<br>Erträge       | SGD | 29.996                                      | SGD | 24.422               | SGD | 6.313                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 4.489                                       |     | 3.597                |     | 959                  |  |
| NIW je Anteil                                | SGD | 6,68                                        | SGD | 6,79                 | SGD | 6,58                 |  |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$  | 4.545                                       | \$  | 9.322                | \$  | 6.472                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 514                                         |     | 1.097                |     | 862                  |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 8,84                                        | \$  | 8,50                 | \$  | 7,51                 |  |
| Erträge                                      | \$  | 18.123                                      | \$  | 32.498               | \$  | 48.069               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.706                                       |     | 4.814                |     | 7.472                |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 6,70                                        | \$  | 6,75                 | \$  | 6,43                 |  |
| Investor AUD (Hedged):<br>Erträge            | AUD | 2.225                                       | AUD | 3.217                | AUD | 3.657                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 341                                         |     | 489                  |     | 578                  |  |
| NIW je Anteil                                | AUD | 6,52                                        | AUD | 6,58                 | AUD | 6,33                 |  |
| Investor EUR (Hedged):<br>Erträge            | €   | 883                                         | €   | 877                  | €   | 996                  |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 144                                         |     | 140                  |     | 164                  |  |
| NIW je Anteil                                | €   | 6,15                                        | €   | 6,25                 | €   | 6,05                 |  |
| Investor RMB (Hedged):<br>Erträge            | CNH | 1.870                                       | CNH | 1.831                | CNH | 1.683                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 28                                          |     | 27                   |     | 26                   |  |
| NIW je Anteil                                | CNH | 65,62                                       | CNH | 66,77                | CNH | 65,29                |  |
| Investor SGD (Hedged):<br>Erträge            | SGD | 2.426                                       | SGD | 2.926                | SGD | 2.963                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 377                                         |     | 448                  |     | 467                  |  |
| NIW je Anteil                                | SGD | 6,43                                        | SGD | 6,54                 | SGD | 6,34                 |  |
| Administrative:<br>Erträge                   | \$  | 37.438                                      | \$  | 28.441               | \$  | 22.518               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 5.478                                       |     | 4.130                |     | 3.431                |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 6,83                                        | \$  | 6,89                 | \$  | 6,56                 |  |
| Class E:<br>thesaurierend                    | \$  | 43.396                                      | \$  | 50.101               | \$  | 51.171               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 4.572                                       |     | 5.474                |     | 6.290                |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 9,49                                        | \$  | 9,15                 | \$  | 8,14                 |  |
| Erträge                                      | \$  | 40.518                                      | \$  | 41.786               | \$  | 47.824               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 5.932                                       |     | 6.070                |     | 7.288                |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 6,83                                        | \$  | 6,88                 | \$  | 6,56                 |  |
| Class E CHF (Hedged):<br>thesaurierend       | CHF | 654                                         | CHF | 654                  | CHF | 690                  |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 82                                          |     | 83                   |     | 95                   |  |
| NIW je Anteil                                | CHF | 7,99                                        | CHF | 7,86                 | CHF | 7,28                 |  |
| Erträge                                      | CHF | 243                                         | CHF | 217                  | CHF | 198                  |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 41                                          |     | 36                   |     | 33                   |  |
| NIW je Anteil                                | CHF | 5,92                                        | CHF | 6,08                 | CHF | 6,04                 |  |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €   | 41.511                                      | €   | 44.868               | €   | 41.927               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 4.873                                       |     | 5.416                |     | 5.605                |  |
| NIW je Anteil                                | €   | 8,52                                        | €   | 8,28                 | €   | 7,48                 |  |
| Erträge                                      | €   | 7.945                                       | €   | 8.771                | €   | 8.111                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.265                                       |     | 1.374                |     | 1.312                |  |
| NIW je Anteil                                | €   | 6,28                                        | €   | 6,38                 | €   | 6,18                 |  |

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025                        |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------------|-----|---------------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|
|                                              |     | PIMCO Asia High Yield Bond<br>Fund (Forts.) |     |                      |     |                      |
| Class E HKD (Unhedged):<br>Erträge           | HKD | 2.342                                       | HKD | 2.331                | HKD | 5.306                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 342                                         |     | 342                  |     | 812                  |
| NIW je Anteil                                | HKD | 6,84                                        | HKD | 6,82                 | HKD | 6,54                 |
| Class E SGD (Hedged):<br>Erträge             | SGD | 25.819                                      | SGD | 24.161               | SGD | 12.291               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 3.974                                       |     | 3.660                |     | 1.919                |
| NIW je Anteil                                | SGD | 6,50                                        | SGD | 6,60                 | SGD | 6,40                 |
| H Institutional:<br>thesaurierend            | \$  | 185                                         | \$  | 178                  | \$  | 1.327                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 20                                          |     | 20                   |     | 172                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 9,10                                        | \$  | 8,74                 | \$  | 7,71                 |
| Erträge                                      | \$  | 329                                         | \$  | 323                  | \$  | 328                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 50                                          |     | 48                   |     | 51                   |
| NIW je Anteil                                | \$  | 6,64                                        | \$  | 6,70                 | \$  | 6,38                 |
| M Retail:<br>ausschüttend II                 | \$  | 14.469                                      | \$  | 15.324               | \$  | 18.245               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.338                                       |     | 2.439                |     | 2.999                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 6,19                                        | \$  | 6,28                 | \$  | 6,08                 |
| M Retail HKD (Unhedged):<br>ausschüttend II  | HKD | 22.243                                      | HKD | 4.479                | HKD | 1.741                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 3.594                                       |     | 720                  |     | 288                  |
| NIW je Anteil                                | HKD | 6,19                                        | HKD | 6,22                 | HKD | 6,05                 |
| M Retail SGD (Hedged):<br>ausschüttend II    | SGD | 8.743                                       | SGD | 7.456                | SGD | 7.118                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.485                                       |     | 1.238                |     | 1.199                |
| NIW je Anteil                                | SGD | 5,89                                        | SGD | 6,02                 | SGD | 5,94                 |
| Class Z:<br>thesaurierend                    | \$  | 17.632                                      | \$  | 23.845               | \$  | 187.047              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.599                                       |     | 2.260                |     | 20.248               |
| NIW je Anteil                                | \$  | 11,03                                       | \$  | 10,55                | \$  | 9,24                 |
|                                              |     | Asia Strategic Interest Bond Fund           |     |                      |     |                      |
| Nettovermögen                                | \$  | 252.376                                     | \$  | 228.519              | \$  | 177.208              |
| Institutional:<br>thesaurierend              | \$  | 62.048                                      | \$  | 14.193               | \$  | 64                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 5.389                                       |     | 1.283                |     | 6                    |
| NIW je Anteil                                | \$  | 11,51                                       | \$  | 11,06                | \$  | 10,26                |
| Erträge                                      | \$  | 17.306                                      | \$  | 63.132               | \$  | 34.211               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.109                                       |     | 7.793                |     | 4.306                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 8,21                                        | \$  | 8,10                 | \$  | 7,94                 |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 11                                          | €   | 10                   | €   | 10                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1                                           |     | 1                    |     | 1                    |
| NIW je Anteil                                | €   | 11,08                                       | €   | 10,74                | €   | 10,13                |
| Erträge                                      | €   | 142                                         | €   | 144                  | €   | 10.955               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 19                                          |     | 19                   |     | 1.445                |
| NIW je Anteil                                | €   | 7,62                                        | €   | 7,59                 | €   | 7,58                 |
| Institutional GBP (Hedged):<br>Erträge       | £   | 382                                         | £   | 449                  | £   | 351                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 47                                          |     | 56                   |     | 44                   |
| NIW je Anteil                                | £   | 8,05                                        | £   | 7,99                 | £   | 7,89                 |
| Institutional SGD (Hedged):<br>Erträge       | SGD | 55.164                                      | SGD | 43.264               | SGD | 15.313               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 6.943                                       |     | 5.463                |     | 1.934                |
| NIW je Anteil                                | SGD | 7,95                                        | SGD | 7,92                 | SGD | 7,92                 |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$  | 11                                          | \$  | 11                   | \$  | 265                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1                                           |     | 1                    |     | 26                   |
| NIW je Anteil                                | \$  | 11,43                                       | \$  | 11,00                | \$  | 10,25                |
| Investor (Unhedged)<br>Erträge               | \$  | 12                                          | \$  | 11                   | \$  | 10                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1                                           |     | 1                    |     | 1                    |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,33                                       | \$  | 10,24                | \$  | 10,11                |

|                                         | Zum<br>30. Jun. 2025                          | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                         | Asia Strategic Interest Bond<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Investor EUR (Hedged):<br>thesaurierend | k. A.                                         | k. A.                | € 10                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | k. A.                                         | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                           | k. A.                                         | k. A.                | € 10,11              |
| Erträge                                 | k. A.                                         | k. A.                | € 9                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | k. A.                                         | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                           | k. A.                                         | k. A.                | € 10,03              |
| Class E:                                |                                               |                      |                      |
| thesaurierend                           | \$ 3.820                                      | \$ 2.507             | \$ 2.472             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 386                                           | 263                  | 277                  |
| NIW je Anteil                           | \$ 9,89                                       | \$ 9,54              | \$ 8,93              |
| Erträge                                 | \$ 20.669                                     | \$ 19.104            | \$ 17.469            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 2.916                                         | 2.717                | 2.511                |
| NIW je Anteil                           | \$ 7,09                                       | \$ 7,03              | \$ 6,96              |
| Class E EUR (Hedged):                   |                                               |                      |                      |
| thesaurierend                           | € 5.730                                       | € 6.041              | € 5.955              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 631                                           | 684                  | 708                  |
| NIW je Anteil                           | € 9,08                                        | € 8,84               | € 8,41               |
| Class E EUR (Unhedged):                 |                                               |                      |                      |
| thesaurierend                           | € 11.607                                      | € 14.795             | € 18.078             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 786                                           | 916                  | 1.275                |
| NIW je Anteil                           | € 14,77                                       | € 16,16              | € 14,18              |
| Class E HKD (Unhedged):                 |                                               |                      |                      |
| Erträge                                 | HKD 96                                        | HKD 1.685            | HKD 2.994            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 12                                            | 211                  | 377                  |
| NIW je Anteil                           | HKD 8,14                                      | HKD 7,99             | HKD 7,95             |
| Class E SGD (Hedged):                   |                                               |                      |                      |
| Erträge                                 | SGD 7.675                                     | SGD 3.945            | SGD 3.298            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 985                                           | 506                  | 419                  |
| NIW je Anteil                           | SGD 7,79                                      | SGD 7,80             | SGD 7,87             |
| M Retail HKD (Unhedged):                |                                               |                      |                      |
| Erträge                                 | HKD 59.524                                    | HKD 38.012           | HKD 29.265           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 9.597                                         | 6.242                | 4.830                |
| NIW je Anteil                           | HKD 6,20                                      | HKD 6,09             | HKD 6,06             |
| Class Z:                                |                                               |                      |                      |
| thesaurierend                           | \$ 70.524                                     | \$ 67.547            | \$ 65.348            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 6.732                                         | 6.732                | 7.062                |
| NIW je Anteil                           | \$ 10,48                                      | \$ 10,03             | \$ 9,25              |
|                                         | PIMCO Balanced Income and Growth Fund         |                      |                      |
| Nettovermögen                           | \$ 2.546.490                                  | \$ 1.380.013         | \$ 670.116           |
| Institutional:                          |                                               |                      |                      |
| thesaurierend                           | \$ 43.229                                     | \$ 36.841            | \$ 31.079            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 1.586                                         | 1.485                | 1.413                |
| NIW je Anteil                           | \$ 27,26                                      | \$ 24,80             | \$ 22,00             |
| Erträge                                 | \$ 10                                         | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 1                                             | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                           | \$ 10,24                                      | k. A.                | k. A.                |
| ausschüttend II                         | \$ 14.345                                     | \$ 10                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile   | 1.396                                         | 1                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                           | \$ 10,28                                      | \$ 9,69              | k. A.                |

|                                              | Zum<br>30. Jun. 2025                              | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                              | PIMCO Balanced Income and Growth<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Institutional AUD (Hedged):<br>thesaurierend | AUD 16                                            | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 2                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | AUD 10,03                                         | k. A.                | k. A.                |
| ausschüttend II                              | AUD 16                                            | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 2                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | AUD 10,03                                         | k. A.                | k. A.                |
| Institutional EUR (Hedged):                  |                                                   |                      |                      |
| thesaurierend                                | € 310.788                                         | € 308.894            | € 148.956            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 13.362                                            | 14.237               | 7.756                |
| NIW je Anteil                                | € 23,26                                           | € 21,70              | € 19,21              |
| ausschüttend II                              | € 9                                               | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 1                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | € 10,03                                           | k. A.                | k. A.                |
| Institutional GBP (Hedged):                  |                                                   |                      |                      |
| Erträge                                      | £ 792                                             | £ 452                | £ 477                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 64                                                | 39                   | 45                   |
| NIW je Anteil                                | £ 12,37                                           | £ 11,65              | £ 10,60              |
| Institutional HKD (Unhedged):                |                                                   |                      |                      |
| Erträge                                      | HKD 288                                           | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 28                                                | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | HKD 10,25                                         | k. A.                | k. A.                |
| Institutional JPY (Hedged):                  |                                                   |                      |                      |
| ausschüttend II                              | ¥ 1.438                                           | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 1                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | ¥ 1.003,00                                        | k. A.                | k. A.                |
| Institutional RMB (Hedged):                  |                                                   |                      |                      |
| thesaurierend                                | CNH 9.100                                         | CNH 8.493            | CNH 7.574            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 73                                                | 73                   | 73                   |
| NIW je Anteil                                | CNH 124,31                                        | CNH 116,02           | CNH 103,47           |
| Erträge                                      | CNH 173.197                                       | CNH 85               | CNH 76               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 1.497                                             | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                                | CNH 115,72                                        | CNH 110,16           | CNH 102,34           |
| Institutional RMB (Unhedged):                |                                                   |                      |                      |
| thesaurierend                                | CNH 42.885                                        | CNH 46.651           | CNH 76               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 331                                               | 386                  | 1                    |
| NIW je Anteil                                | CNH 129,44                                        | CNH 120,71           | CNH 103,83           |
| Erträge                                      | CNH 2.150.607                                     | CNH 79.753           | CNH 76               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 17.823                                            | 695                  | 1                    |
| NIW je Anteil                                | CNH 120,66                                        | CNH 114,72           | CNH 102,71           |
| Institutional SGD (Hedged):                  |                                                   |                      |                      |
| thesaurierend                                | SGD 13                                            | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 1                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | SGD 10,03                                         | k. A.                | k. A.                |
| Erträge                                      | SGD 13                                            | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 1                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | SGD 10,19                                         | k. A.                | k. A.                |
| ausschüttend II                              | SGD 13                                            | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 1                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | SGD 10,03                                         | k. A.                | k. A.                |
| Investor:                                    |                                                   |                      |                      |
| thesaurierend                                | \$ 14.021                                         | \$ 12.729            | \$ 11.288            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 700                                               | 697                  | 695                  |
| NIW je Anteil                                | \$ 20,02                                          | \$ 18,25             | \$ 16,24             |
| Administrative:                              |                                                   |                      |                      |
| thesaurierend                                | \$ 8.564                                          | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 773                                               | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | \$ 11,08                                          | k. A.                | k. A.                |
| Erträge                                      | \$ 4.064                                          | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        | 388                                               | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | \$ 10,47                                          | k. A.                | k. A.                |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025                              |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |    | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|---------------------------------------------------|-----|----------------------|----|----------------------|
|                                       |     | PIMCO Balanced Income and<br>Growth Fund (Forts.) |     |                      |    |                      |
| ausschüttend II                       | \$  | 77.745                                            | \$  | 10.431               |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 7.536                                             |     | 1.069                |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,32                                             | \$  | 9,75                 |    | k. A.                |
| Administrative EUR<br>(Hedged):       |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| ausschüttend II                       | €   | 10                                                |     | k. A.                |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1                                                 |     | k. A.                |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | €   | 10,36                                             |     | k. A.                |    | k. A.                |
| Administrative HKD<br>(Unhedged):     |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| ausschüttend II                       | HKD | 179.357                                           | HKD | 14.834               |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 17.192                                            |     | 1.520                |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | HKD | 10,43                                             | HKD | 9,76                 |    | k. A.                |
| Administrative SGD<br>(Hedged):       |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | SGD | 2.304                                             |     | k. A.                |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 206                                               |     | k. A.                |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | SGD | 11,18                                             |     | k. A.                |    | k. A.                |
| ausschüttend II                       | SGD | 18.804                                            | SGD | 2.156                |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.857                                             |     | 220                  |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | SGD | 10,12                                             | SGD | 9,82                 |    | k. A.                |
| BM Retail:                            |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| dekumulierend                         | \$  | 67.782                                            | \$  | 11                   |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6.549                                             |     | 1                    |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,35                                             | \$  | 9,93                 |    | k. A.                |
| Class E:                              |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 85.869                                            | \$  | 51.945               | \$ | 31.174               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 3.815                                             |     | 2.522                |    | 1.686                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 22,51                                             | \$  | 20,60                | \$ | 18,49                |
| Erträge                               | \$  | 19.843                                            | \$  | 18.846               | \$ | 12.347               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.836                                             |     | 1.864                |    | 1.302                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,81                                             | \$  | 10,11                | \$ | 9,48                 |
| Class E EUR (Hedged):                 |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | €   | 167.142                                           | €   | 169.528              | €  | 230.322              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 8.706                                             |     | 9.409                |    | 14.269               |
| NIW je Anteil                         | €   | 19,20                                             | €   | 18,02                | €  | 16,14                |
| Erträge                               | €   | 43.381                                            | €   | 40.594               | €  | 47.057               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 4.686                                             |     | 4.558                |    | 5.608                |
| NIW je Anteil                         | €   | 9,26                                              | €   | 8,91                 | €  | 8,39                 |
| H Institutional:                      |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 82                                                | \$  | 75                   | \$ | 10                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6                                                 |     | 6                    |    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$  | 12,96                                             | \$  | 11,81                | \$ | 10,49                |
| Erträge                               | \$  | 13                                                | \$  | 12                   | \$ | 10                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1                                                 |     | 1                    |    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$  | 11,37                                             | \$  | 10,57                | \$ | 9,79                 |
| M Retail:                             |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 49.181                                            | \$  | 15.716               | \$ | 10                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 3.851                                             |     | 1.348                |    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$  | 12,77                                             | \$  | 11,66                | \$ | 10,41                |
| dekumulierend                         | \$  | 2.958                                             | \$  | 11                   |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 282                                               |     | 1                    |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,48                                             | \$  | 10,01                |    | k. A.                |
| Erträge                               | \$  | 24.222                                            | \$  | 5.337                | \$ | 10                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.022                                             |     | 479                  |    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$  | 11,98                                             | \$  | 11,15                | \$ | 10,37                |
| ausschüttend II                       | \$  | 363.083                                           | \$  | 166.554              | \$ | 10                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 31.696                                            |     | 15.376               |    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$  | 11,46                                             | \$  | 10,83                | \$ | 10,35                |
| M Retail AUD (Hedged):                |     |                                                   |     |                      |    |                      |
| ausschüttend II                       | AUD | 49.986                                            | AUD | 12.529               |    | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 4.795                                             |     | 1.248                |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | AUD | 10,43                                             | AUD | 10,04                |    | k. A.                |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025                              |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|---------------------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|
|                                       |     | PIMCO Balanced Income and<br>Growth Fund (Forts.) |     |                      |     |                      |
| M Retail CHF (Hedged):                |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                       | CHF | 15.028                                            | CHF | 2.863                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.481                                             |     | 288                  |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | CHF | 10,14                                             | CHF | 9,94                 |     | k. A.                |
| M Retail EUR (Hedged):                |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                       | €   | 1.453                                             |     | k. A.                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 144                                               |     | k. A.                |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | €   | 10,09                                             |     | k. A.                |     | k. A.                |
| M Retail GBP (Hedged):                |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                       | £   | 8.373                                             | £   | 1.606                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 800                                               |     | 160                  |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | £   | 10,46                                             | £   | 10,06                |     | k. A.                |
| M Retail HKD (Unhedged):              |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | HKD | 8.224                                             | HKD | 1.422                | HKD | 81                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 641                                               |     | 123                  |     | 8                    |
| NIW je Anteil                         | HKD | 12,84                                             | HKD | 11,59                | HKD | 10,40                |
| Erträge                               | HKD | 11.845                                            | HKD | 5.484                | HKD | 81                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 984                                               |     | 495                  |     | 8                    |
| NIW je Anteil                         | HKD | 12,04                                             | HKD | 11,09                | HKD | 10,37                |
| ausschüttend II                       | HKD | 931.925                                           | HKD | 346.297              | HKD | 81                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 80.954                                            |     | 32.152               |     | 8                    |
| NIW je Anteil                         | HKD | 11,51                                             | HKD | 10,77                | HKD | 10,34                |
| M Retail JPY (Hedged):                |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                       | ¥   | 10.471.484                                        | ¥   | 6.577.715            |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 10.532                                            |     | 6.744                |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | ¥   | 994,00                                            | ¥   | 975,00               |     | k. A.                |
| M Retail RMB (Hedged):                |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                       | CNH | 77.230                                            | CNH | 16.757               |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 750                                               |     | 168                  |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | CNH | 102,97                                            | CNH | 99,91                |     | k. A.                |
| M Retail SGD (Hedged):                |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | SGD | 7.761                                             | SGD | 7.005                | SGD | 1.420                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 625                                               |     | 603                  |     | 137                  |
| NIW je Anteil                         | SGD | 12,41                                             | SGD | 11,61                | SGD | 10,37                |
| Erträge                               | SGD | 22.805                                            | SGD | 2.497                | SGD | 14                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.960                                             |     | 225                  |     | 1                    |
| NIW je Anteil                         | SGD | 11,64                                             | SGD | 11,11                | SGD | 10,33                |
| ausschüttend II                       | SGD | 229.289                                           | SGD | 90.688               | SGD | 14                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 20.621                                            |     | 8.411                |     | 1                    |
| NIW je Anteil                         | SGD | 11,12                                             | SGD | 10,78                | SGD | 10,31                |
| UM Retail:                            |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                       | \$  | 26.783                                            | \$  | 28.525               |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.469                                             |     | 2.782                |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,85                                             | \$  | 10,25                |     | k. A.                |
| UM Retail SGD (Hedged):               |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                       | SGD | 221.674                                           | SGD | 223.694              |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 21.039                                            |     | 21.916               |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | SGD | 10,54                                             | SGD | 10,21                |     | k. A.                |
| Class Z:                              |     |                                                   |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 113.022                                           | \$  | 133.139              | \$  | 110.390              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 5.433                                             |     | 7.066                |     | 6.669                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 20,81                                             | \$  | 18,84                | \$  | 16,55                |

|                                              | Zum<br>30. Jun. 2025          |           | Zum<br>31. Dez. 2024 |           | Zum<br>31. Dez. 2023 |           |
|----------------------------------------------|-------------------------------|-----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|                                              | PIMCO Capital Securities Fund |           |                      |           |                      |           |
| Nettovermögen                                | \$                            | 5.033.982 | \$                   | 4.753.034 | \$                   | 5.137.886 |
| Institutional:<br>thesaurierend              | \$                            | 1.166.713 | \$                   | 1.108.196 | \$                   | 1.271.099 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 47.212    |                      | 47.016    |                      | 59.553    |
| NIW je Anteil                                | \$                            | 24,71     | \$                   | 23,57     | \$                   | 21,34     |
| Erträge                                      | \$                            | 308.948   | \$                   | 331.795   | \$                   | 194.714   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 28.206    |                      | 30.952    |                      | 19.008    |
| NIW je Anteil                                | \$                            | 10,95     | \$                   | 10,72     | \$                   | 10,24     |
| Institutional AUD (Hedged):<br>thesaurierend | AUD                           | 9.194     | AUD                  | 8.773     |                      | k. A.     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 816       |                      | 816       |                      | k. A.     |
| NIW je Anteil                                | AUD                           | 11,27     | AUD                  | 10,75     |                      | k. A.     |
| Erträge                                      | AUD                           | 17        | AUD                  | 16        |                      | k. A.     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 2         |                      | 2         |                      | k. A.     |
| NIW je Anteil                                | AUD                           | 10,47     | AUD                  | 10,25     |                      | k. A.     |
| Institutional BRL (Hedged):<br>thesaurierend | \$                            | 19.610    | \$                   | 20.683    | \$                   | 13.282    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 1.693     |                      | 2.203     |                      | 1.272     |
| NIW je Anteil                                | \$                            | 11,58     | \$                   | 9,39      | \$                   | 10,44     |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend | CHF                           | 31.747    | CHF                  | 31.483    | CHF                  | 36.703    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 1.848     |                      | 1.885     |                      | 2.326     |
| NIW je Anteil                                | CHF                           | 17,18     | CHF                  | 16,71     | CHF                  | 15,78     |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €                             | 627.730   | €                    | 654.175   | €                    | 1.018.876 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 38.262    |                      | 41.448    |                      | 70.150    |
| NIW je Anteil                                | €                             | 16,41     | €                    | 15,78     | €                    | 14,52     |
| Erträge                                      | €                             | 464.210   | €                    | 469.491   | €                    | 384.027   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 42.144    |                      | 43.203    |                      | 36.374    |
| NIW je Anteil                                | €                             | 11,01     | €                    | 10,87     | €                    | 10,56     |
| ausschüttend II                              | €                             | 3.367     | €                    | 4.379     | €                    | 5.467     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 410       |                      | 539       |                      | 687       |
| NIW je Anteil                                | €                             | 8,20      | €                    | 8,12      | €                    | 7,96      |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £                             | 47.316    | £                    | 48.863    | £                    | 47.691    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 2.677     |                      | 2.901     |                      | 3.119     |
| NIW je Anteil                                | £                             | 17,67     | £                    | 16,85     | £                    | 15,29     |
| Erträge                                      | £                             | 48.324    | £                    | 52.227    | £                    | 64.345    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 4.011     |                      | 4.434     |                      | 5.682     |
| NIW je Anteil                                | £                             | 12,05     | £                    | 11,78     | £                    | 11,32     |
| Institutional SGD (Hedged):<br>Erträge       | SGD                           | 120.377   | SGD                  | 126.649   | SGD                  | 2.530     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 13.493    |                      | 14.385    |                      | 295       |
| NIW je Anteil                                | SGD                           | 8,92      | SGD                  | 8,80      | SGD                  | 8,56      |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$                            | 160.571   | \$                   | 180.837   | \$                   | 190.106   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 9.641     |                      | 11.364    |                      | 13.146    |
| NIW je Anteil                                | \$                            | 16,66     | \$                   | 15,91     | \$                   | 14,46     |
| Erträge                                      | \$                            | 46.953    | \$                   | 45.695    | \$                   | 50.228    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                               | 4.306     |                      | 4.282     |                      | 4.925     |
| NIW je Anteil                                | \$                            | 10,90     | \$                   | 10,67     | \$                   | 10,20     |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025                      |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |  |
|---------------------------------------|-----|-------------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|--|
|                                       |     | PIMCO Capital Securities<br>Fund (Forts.) |     |                      |     |                      |  |
| Investor AUD (Hedged):                |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| Erträge                               | AUD | 3.369                                     | AUD | 5.170                | AUD | 14.433               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 346                                       |     | 542                  |     | 1.568                |  |
| NIW je Anteil                         | AUD | 9,74                                      | AUD | 9,54                 | AUD | 9,21                 |  |
| Investor CAD (Hedged):                |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| Erträge                               | CAD | 2.987                                     | CAD | 2.935                | CAD | 4.254                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 295                                       |     | 294                  |     | 442                  |  |
| NIW je Anteil                         | CAD | 10,13                                     | CAD | 9,99                 | CAD | 9,63                 |  |
| Investor EUR (Hedged):                |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| thesaurierend                         | €   | 14.286                                    | €   | 17.269               | €   | 23.439               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.010                                     |     | 1.267                |     | 1.863                |  |
| NIW je Anteil                         | €   | 14,14                                     | €   | 13,63                | €   | 12,58                |  |
| Investor GBP (Hedged):                |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| Erträge                               | £   | 572                                       | £   | 918                  | £   | 2.992                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 61                                        |     | 101                  |     | 343                  |  |
| NIW je Anteil                         | £   | 9,31                                      | £   | 9,10                 | £   | 8,72                 |  |
| Investor SGD (Hedged):                |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| Erträge                               | SGD | 7.288                                     | SGD | 3.794                | SGD | 3.958                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 737                                       |     | 389                  |     | 417                  |  |
| NIW je Anteil                         | SGD | 9,89                                      | SGD | 9,76                 | SGD | 9,49                 |  |
| Administrative:                       |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| thesaurierend                         | \$  | 150.289                                   | \$  | 151.169              | \$  | 140.565              |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6.474                                     |     | 6.811                |     | 6.959                |  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 23,21                                     | \$  | 22,19                | \$  | 20,20                |  |
| Erträge                               | \$  | 74.418                                    | \$  | 73.524               | \$  | 75.290               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 5.052                                     |     | 5.101                |     | 5.466                |  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 14,73                                     | \$  | 14,41                | \$  | 13,77                |  |
| ausschüttend II                       |     | k. A.                                     |     | k. A.                | \$  | 11                   |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | k. A.                                     |     | k. A.                |     | 1                    |  |
| NIW je Anteil                         |     | k. A.                                     |     | k. A.                | \$  | 9,82                 |  |
| Administrative EUR<br>(Hedged):       |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| thesaurierend                         | €   | 9.729                                     | €   | 10.342               | €   | 11.090               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 512                                       |     | 564                  |     | 654                  |  |
| NIW je Anteil                         | €   | 19,01                                     | €   | 18,34                | €   | 16,96                |  |
| Administrative SGD<br>(Hedged):       |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| ausschüttend II                       |     | k. A.                                     |     | k. A.                | SGD | 15                   |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | k. A.                                     |     | k. A.                |     | 1                    |  |
| NIW je Anteil                         |     | k. A.                                     |     | k. A.                | SGD | 9,67                 |  |
| Class E:                              |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| thesaurierend                         | \$  | 299.540                                   | \$  | 307.284              | \$  | 305.773              |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 17.743                                    |     | 18.999               |     | 20.690               |  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 16,88                                     | \$  | 16,17                | \$  | 14,78                |  |
| Erträge                               | \$  | 71.619                                    | \$  | 67.570               | \$  | 60.223               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6.562                                     |     | 6.326                |     | 5.900                |  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,91                                     | \$  | 10,68                | \$  | 10,21                |  |
| Class E CHF (Hedged):                 |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| thesaurierend                         | CHF | 5.710                                     | CHF | 5.729                | CHF | 5.686                |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 493                                       |     | 506                  |     | 527                  |  |
| NIW je Anteil                         | CHF | 11,58                                     | CHF | 11,31                | CHF | 10,78                |  |
| Class E EUR (Hedged):                 |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| thesaurierend                         | €   | 412.927                                   | €   | 430.252              | €   | 414.817              |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 29.688                                    |     | 32.012               |     | 33.239               |  |
| NIW je Anteil                         | €   | 13,91                                     | €   | 13,44                | €   | 12,48                |  |
| Erträge                               | €   | 62.184                                    | €   | 63.832               | €   | 63.510               |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6.853                                     |     | 7.132                |     | 7.303                |  |
| NIW je Anteil                         | €   | 9,07                                      | €   | 8,95                 | €   | 8,70                 |  |
| M Retail:                             |     |                                           |     |                      |     |                      |  |
| ausschüttend II                       | \$  | 211.015                                   | \$  | 214.506              | \$  | 205.669              |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 22.618                                    |     | 23.302               |     | 22.969               |  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 9,33                                      | \$  | 9,21                 | \$  | 8,95                 |  |



|                                       | PIMCO Climate Bond Fund |         |     |         |     |         |
|---------------------------------------|-------------------------|---------|-----|---------|-----|---------|
| Nettovermögen                         | \$                      | 349.303 | \$  | 318.213 | \$  | 262.316 |
| Institutional:                        |                         |         |     |         |     |         |
| thesaurierend                         | \$                      | 49.500  | \$  | 49.257  | \$  | 26.436  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                         | 4.747   |     | 4.937   |     | 2.759   |
| NIW je Anteil                         | \$                      | 10,43   | \$  | 9,98    | \$  | 9,58    |
| Institutional AUD (Hedged):           |                         |         |     |         |     |         |
| Erträge                               | AUD                     | 6.002   | AUD | 5.466   | AUD | 2.219   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                         | 566     |     | 531     |     | 216     |
| NIW je Anteil                         | AUD                     | 10,60   | AUD | 10,29   | AUD | 10,28   |
| Institutional CHF (Hedged):           |                         |         |     |         |     |         |
| thesaurierend                         | CHF                     | 465     | CHF | 440     | CHF | 819     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                         | 52      |     | 50      |     | 94      |
| NIW je Anteil                         | CHF                     | 8,94    | CHF | 8,73    | CHF | 8,76    |
| Institutional EUR (Hedged):           |                         |         |     |         |     |         |
| thesaurierend                         | €                       | 40.907  | €   | 41.458  | €   | 40.309  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                         | 4.248   |     | 4.459   |     | 4.440   |
| NIW je Anteil                         | €                       | 9,63    | €   | 9,30    | €   | 9,08    |
| Erträge                               | €                       | 77.497  | €   | 76.438  | €   | 75.831  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                         | 8.932   |     | 8.999   |     | 8.881   |
| NIW je Anteil                         | €                       | 8,68    | €   | 8,49    | €   | 8,54    |

|                                       | Commodity Real Return Fund |         |    |         |    |         |
|---------------------------------------|----------------------------|---------|----|---------|----|---------|
| Nettovermögen                         | \$                         | 726.012 | \$ | 739.034 | \$ | 858.902 |
| Institutional:                        |                            |         |    |         |    |         |
| thesaurierend                         | \$                         | 328.275 | \$ | 322.068 | \$ | 311.581 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                            | 33.308  |    | 34.852  |    | 35.010  |
| NIW je Anteil                         | \$                         | 9,86    | \$ | 9,24    | \$ | 8,90    |
| Institutional EUR (Hedged):           |                            |         |    |         |    |         |
| thesaurierend                         | €                          | 81.520  | €  | 81.086  | €  | 112.842 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                            | 8.948   |    | 9.390   |    | 13.338  |
| NIW je Anteil                         | €                          | 9,11    | €  | 8,64    | €  | 8,46    |
| Institutional EUR (Unhedged):         |                            |         |    |         |    |         |
| thesaurierend                         | €                          | 35.493  | €  | 38.289  | €  | 55.160  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                            | 2.864   |    | 2.907   |    | 4.639   |
| NIW je Anteil                         | €                          | 12,39   | €  | 13,17   | €  | 11,89   |
| Institutional GBP (Hedged):           |                            |         |    |         |    |         |
| thesaurierend                         | £                          | 11.204  | £  | 19.222  | £  | 18.532  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                            | 845     |    | 1.542   |    | 1.537   |
| NIW je Anteil                         | £                          | 13,26   | £  | 12,47   | £  | 12,06   |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025                 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
| Commodity Real Return Fund (Forts.)   |     |                                      |                      |                      |
| Institutional GBP (Unhedged):         |     |                                      |                      |                      |
| Erträge                               | £   | 1.374                                | £ 24.945             | £ 18.467             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 176                                  | 3.061                | 2.340                |
| NIW je Anteil                         | £   | 7,83                                 | £ 8,15               | £ 7,89               |
| Investor:                             |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 18.874                               | \$ 19.264            | \$ 21.974            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.240                                | 2.434                | 2.873                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 8,43                                 | \$ 7,91              | \$ 7,65              |
| Class E:                              |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 124.677                              | \$ 129.651           | \$ 162.379           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 16.174                               | 17.859               | 23.016               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 7,71                                 | \$ 7,26              | \$ 7,06              |
| Class E EUR (Hedged):                 |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | €   | 80.360                               | € 80.872             | € 111.508            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 11.787                               | 12.461               | 17.383               |
| NIW je Anteil                         | €   | 6,82                                 | € 6,49               | € 6,41               |
| Class E SGD (Hedged):                 |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | SGD | 2.429                                | SGD 2.218            | SGD 1.207            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 224                                  | 216                  | 119                  |
| NIW je Anteil                         | SGD | 10,82                                | SGD 10,29            | SGD 10,18            |
| H Institutional:                      |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 3.357                                | \$ 3.755             | \$ 6.125             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 390                                  | 465                  | 786                  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 8,60                                 | \$ 8,07              | \$ 7,79              |
|                                       |     | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$  | 252.372                              | \$ 125.468           | \$ 100.063           |
| Institutional:                        |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 87.813                               | \$ 57.768            | \$ 48.421            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 5.312                                | 3.630                | 3.281                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 16,53                                | \$ 15,91             | \$ 14,76             |
| Institutional CHF (Hedged):           |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | CHF | 10.606                               | CHF 10.365           | CHF 11.825           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 941                                  | 937                  | 1.105                |
| NIW je Anteil                         | CHF | 11,26                                | CHF 11,07            | CHF 10,71            |
| Institutional EUR (Hedged):           |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | €   | 51.191                               | € 26.749             | € 15.758             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 3.736                                | 2.010                | 1.256                |
| NIW je Anteil                         | €   | 13,70                                | € 13,31              | € 12,54              |
| Institutional GBP (Hedged):           |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | £   | 203                                  | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 19                                   | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | £   | 10,42                                | k. A.                | k. A.                |
| Class E:                              |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 20.674                               | \$ 17.153            | \$ 8.932             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.549                                | 1.329                | 740                  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 13,35                                | \$ 12,90             | \$ 12,08             |
| Class E EUR (Hedged):                 |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | €   | 12.701                               | € 11.000             | € 10.187             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.146                                | 1.017                | 990                  |
| NIW je Anteil                         | €   | 11,08                                | € 10,82              | € 10,29              |
| H Institutional:                      |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 176                                  | \$ 11                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 16                                   | 1                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 11,02                                | \$ 10,62             | k. A.                |
| Class Z:                              |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 55.108                               | \$ 10                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 5.279                                | 1                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,44                                | \$ 10,01             | k. A.                |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|----------------------|----------------------|----------------------|
| Diversified Income Fund               |     |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$  | 9.741.000            | \$ 8.784.448         | \$ 7.439.798         |
| Institutional:                        |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 431.655              | \$ 439.820           | \$ 624.037           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 14.988               | 15.997               | 24.230               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 28,80                | \$ 27,50             | \$ 25,76             |
| Erträge                               | \$  | 320.632              | \$ 294.391           | \$ 297.569           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 23.650               | 22.117               | 22.611               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 13,56                | \$ 13,31             | \$ 13,16             |
| Institutional CAD (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | CAD | 275.409              | CAD 463.149          | CAD 465.402          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 23.636               | 41.335               | 43.934               |
| NIW je Anteil                         | CAD | 11,65                | CAD 11,20            | CAD 10,59            |
| Institutional CHF (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | CHF | 8.204                | CHF 8.274            | CHF 13.431           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 620                  | 642                  | 1.065                |
| NIW je Anteil                         | CHF | 13,24                | CHF 12,89            | CHF 12,61            |
| Erträge                               | CHF | 5.408                | CHF 5.241            | CHF 5.215            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 777                  | 752                  | 724                  |
| NIW je Anteil                         | CHF | 6,96                 | CHF 6,97             | CHF 7,20             |
| Institutional EUR (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | €   | 815.326              | € 864.356            | € 889.868            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 45.659               | 50.262               | 54.327               |
| NIW je Anteil                         | €   | 17,86                | € 17,20              | € 16,38              |
| Erträge                               | €   | 192.659              | € 183.650            | € 201.004            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 24.298               | 23.406               | 25.470               |
| NIW je Anteil                         | €   | 7,93                 | € 7,85               | € 7,89               |
| Institutional GBP (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | £   | 406.131              | £ 455.284            | £ 519.724            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 26.376               | 30.989               | 37.644               |
| NIW je Anteil                         | £   | 15,40                | £ 14,69              | £ 13,81              |
| Erträge                               | £   | 230.078              | £ 234.301            | £ 267.079            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 37.753               | 39.226               | 44.733               |
| NIW je Anteil                         | £   | 6,09                 | £ 5,97               | £ 5,97               |
| Institutional MXN (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | MXN | 1.392.504            | MXN 1.242.611        | MXN 407.573          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 10.359               | 9.954                | 3.696                |
| NIW je Anteil                         | MXN | 134,43               | MXN 124,83           | MXN 110,27           |
| Institutional SEK (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | SEK | 198.758              | SEK 191.664          | SEK 180.061          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.075                | 1.075                | 1.058                |
| NIW je Anteil                         | SEK | 184,93               | SEK 178,29           | SEK 170,25           |
| Institutional SGD (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | SGD | 4.941                | SGD 5.274            | SGD 8.210            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 589                  | 636                  | 982                  |
| NIW je Anteil                         | SGD | 8,38                 | SGD 8,30             | SGD 8,36             |
| Investor:                             |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 34.170               | \$ 30.952            | \$ 37.372            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.361                | 2.236                | 2.872                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 14,48                | \$ 13,84             | \$ 13,01             |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                               | Zum<br>30. Jun. 2025             | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------------------------|----------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                               | Diversified Income Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                       | \$ 25.015                        | \$ 68.729            | \$ 97.875            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 2.729                            | 7.638                | 11.003               |
| NIW je Anteil                                 | \$ 9,17                          | \$ 9,00              | \$ 8,89              |
| Investor EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | € 16.437                         | € 19.887             | € 18.112             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 980                              | 1.229                | 1.171                |
| NIW je Anteil                                 | € 16,77                          | € 16,18              | € 15,46              |
| Erträge                                       | € 7.331                          | € 8.720              | € 9.072              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 978                              | 1.175                | 1.216                |
| NIW je Anteil                                 | € 7,50                           | € 7,42               | € 7,46               |
| Administrative:<br>Erträge                    | \$ 63.579                        | \$ 69.014            | \$ 70.001            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 6.360                            | 7.033                | 7.208                |
| NIW je Anteil                                 | \$ 10,00                         | \$ 9,81              | \$ 9,71              |
| Administrative EUR (Hedged):<br>thesaurierend | € 3.233                          | € 3.195              | € 3.265              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 198                              | 203                  | 217                  |
| NIW je Anteil                                 | € 16,32                          | € 15,75              | € 15,08              |
| Administrative GBP (Hedged):<br>Erträge       | £ 5.590                          | £ 7.115              | £ 7.739              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 612                              | 794                  | 870                  |
| NIW je Anteil                                 | £ 9,14                           | £ 8,96               | £ 8,89               |
| Administrative JPY (Hedged):<br>thesaurierend | ¥ 320.961                        | ¥ 232.630            | ¥ 367.541            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 375                              | 278                  | 441                  |
| NIW je Anteil                                 | ¥ 856,00                         | ¥ 835,00             | ¥ 833,00             |
| Administrative SEK (Hedged):<br>thesaurierend | SEK 79                           | SEK 76               | SEK 73               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 1                                | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                                 | SEK 92,74                        | SEK 89,62            | SEK 86,00            |
| Administrative SGD (Hedged):<br>Erträge       | SGD 141.590                      | SGD 117.737          | SGD 63.405           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 16.423                           | 13.797               | 7.369                |
| NIW je Anteil                                 | SGD 8,62                         | SGD 8,53             | SGD 8,60             |
| BM Retail:<br>dekumulierend                   | \$ 1.961.918                     | \$ 1.058.480         | \$ 10                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 208.263                          | 111.286              | 1                    |
| NIW je Anteil                                 | \$ 9,42                          | \$ 9,51              | \$ 9,95              |
| ausschüttend II                               | \$ 299.707                       | \$ 228.683           | \$ 33.787            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 32.318                           | 24.838               | 3.628                |
| NIW je Anteil                                 | \$ 9,27                          | \$ 9,21              | \$ 9,31              |
| Class E:<br>thesaurierend                     | \$ 497.859                       | \$ 536.183           | \$ 577.044           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 20.527                           | 23.051               | 26.246               |
| NIW je Anteil                                 | \$ 24,25                         | \$ 23,26             | \$ 21,99             |
| Erträge                                       | \$ 260.042                       | \$ 274.182           | \$ 300.411           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 21.483                           | 23.069               | 25.563               |
| NIW je Anteil                                 | \$ 12,10                         | \$ 11,89             | \$ 11,75             |
| Class E CHF (Hedged):<br>thesaurierend        | CHF 5.585                        | CHF 5.623            | CHF 5.734            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 623                              | 642                  | 663                  |
| NIW je Anteil                                 | CHF 8,96                         | CHF 8,76             | CHF 8,65             |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend        | € 799.339                        | € 858.568            | € 949.425            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 52.258                           | 58.024               | 66.761               |
| NIW je Anteil                                 | € 15,30                          | € 14,80              | € 14,22              |
| Erträge                                       | € 467.702                        | € 511.531            | € 618.912            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 51.702                           | 57.128               | 68.720               |
| NIW je Anteil                                 | € 9,05                           | € 8,95               | € 9,01               |
| Class E SGD (Hedged):<br>Erträge              | SGD 15.004                       | SGD 14.060           | SGD 17.307           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         | 1.796                            | 1.701                | 2.078                |
| NIW je Anteil                                 | SGD 8,35                         | SGD 8,27             | SGD 8,33             |

|                                        | Zum<br>30. Jun. 2025             | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------|----------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                        | Diversified Income Fund (Forts.) |                      |                      |
| H Institutional:<br>thesaurierend      | \$ 1.219.575                     | \$ 1.317.568         | \$ 456.350           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 56.374                           | 63.736               | 23.526               |
| NIW je Anteil                          | \$ 21,63                         | \$ 20,67             | \$ 19,40             |
| Erträge                                | \$ 616                           | \$ 592               | \$ 197               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 67                               | 65                   | 22                   |
| NIW je Anteil                          | \$ 9,25                          | \$ 9,08              | \$ 8,98              |
| M Retail:<br>dekumulierend             | \$ 159.990                       | \$ 93.200            | \$ 10                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 16.737                           | 9.700                | 1                    |
| NIW je Anteil                          | \$ 9,56                          | \$ 9,61              | \$ 9,95              |
| Erträge                                | \$ 105.076                       | \$ 116.582           | \$ 129.257           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 10.155                           | 11.476               | 12.858               |
| NIW je Anteil                          | \$ 10,35                         | \$ 10,16             | \$ 10,05             |
| ausschüttend II                        | \$ 181.258                       | \$ 179.723           | \$ 164.458           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 22.700                           | 22.751               | 20.705               |
| NIW je Anteil                          | \$ 7,99                          | \$ 7,90              | \$ 7,94              |
| M Retail AUD (Hedged):<br>Erträge      | AUD 46.457                       | AUD 44.049           | AUD 43.631           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 5.016                            | 4.843                | 4.793                |
| NIW je Anteil                          | AUD 9,26                         | AUD 9,09             | AUD 9,10             |
| N Retail:<br>ausschüttend II           | \$ 11                            | \$ 10                | \$ 9                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 1                                | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                          | \$ 10,30                         | \$ 9,88              | \$ 9,34              |
| Class T:<br>thesaurierend              | \$ 19.490                        | \$ 21.617            | \$ 24.098            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 1.504                            | 1.736                | 2.039                |
| NIW je Anteil                          | \$ 12,96                         | \$ 12,45             | \$ 11,82             |
| Erträge                                | \$ 4.776                         | \$ 5.172             | \$ 6.268             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 502                              | 554                  | 679                  |
| NIW je Anteil                          | \$ 9,51                          | \$ 9,33              | \$ 9,23              |
| Class T EUR (Hedged):<br>thesaurierend | € 31.704                         | € 33.260             | € 36.498             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 2.992                            | 3.238                | 3.682                |
| NIW je Anteil                          | € 10,60                          | € 10,27              | € 9,91               |
| Erträge                                | € 16.300                         | € 17.152             | € 18.999             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 2.103                            | 2.236                | 2.463                |
| NIW je Anteil                          | € 7,75                           | € 7,67               | € 7,71               |
| W Class:<br>thesaurierend              | \$ 20.484                        | \$ 21.697            | \$ 29.812            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 1.911                            | 2.122                | 3.117                |
| NIW je Anteil                          | \$ 10,72                         | \$ 10,22             | \$ 9,56              |
| Erträge                                | \$ 9.056                         | \$ 9.203             | \$ 11.290            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 1.053                            | 1.090                | 1.352                |
| NIW je Anteil                          | \$ 8,60                          | \$ 8,44              | \$ 8,35              |
| W Class CHF (Hedged):<br>thesaurierend | CHF 1.009                        | CHF 1.140            | CHF 1.522            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile  | 110                              | 127                  | 174                  |
| NIW je Anteil                          | CHF 9,21                         | CHF 8,96             | CHF 8,76             |

|                                              | Zum<br>30. Jun. 2025                       |         | Zum<br>31. Dez. 2024 |         | Zum<br>31. Dez. 2023 |         |
|----------------------------------------------|--------------------------------------------|---------|----------------------|---------|----------------------|---------|
|                                              | Diversified Income Fund (Forts.)           |         |                      |         |                      |         |
| Erträge                                      | CHF                                        | 78      | CHF                  | 78      | CHF                  | 428     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 10      |                      | 10      |                      | 56      |
| NIW je Anteil                                | CHF                                        | 7,40    | CHF                  | 7,41    | CHF                  | 7,65    |
| W Class EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €                                          | 3.784   | €                    | 3.789   | €                    | 4.968   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 385     |                      | 400     |                      | 552     |
| NIW je Anteil                                | €                                          | 9,84    | €                    | 9,47    | €                    | 9,01    |
| Erträge                                      | €                                          | 543     | €                    | 694     | €                    | 1.078   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 69      |                      | 89      |                      | 137     |
| NIW je Anteil                                | €                                          | 7,91    | €                    | 7,82    | €                    | 7,87    |
| W Class GBP (Hedged):<br>thesaurierend       | £                                          | 449     | £                    | 300     | £                    | 281     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 43      |                      | 30      |                      | 30      |
| NIW je Anteil                                | £                                          | 10,44   | £                    | 9,95    | £                    | 9,34    |
| Erträge                                      | £                                          | 17      | £                    | 16      | £                    | 334     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 2       |                      | 2       |                      | 41      |
| NIW je Anteil                                | £                                          | 8,39    | £                    | 8,22    | £                    | 8,16    |
| W Class SGD (Hedged):<br>Erträge             | SGD                                        | 1.163   | SGD                  | 1.563   | SGD                  | 1.574   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 141     |                      | 192     |                      | 192     |
| NIW je Anteil                                | SGD                                        | 8,24    | SGD                  | 8,15    | SGD                  | 8,21    |
|                                              | Diversified Income Duration<br>Hedged Fund |         |                      |         |                      |         |
| Nettovermögen                                | \$                                         | 329.604 | \$                   | 296.525 | \$                   | 412.839 |
| Institutional:<br>thesaurierend              | \$                                         | 27.924  | \$                   | 25.938  | \$                   | 18.800  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 1.543   |                      | 1.485   |                      | 1.197   |
| NIW je Anteil                                | \$                                         | 18,10   | \$                   | 17,48   | \$                   | 15,70   |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €                                          | 17.654  | €                    | 21.182  | €                    | 13.663  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 1.153   |                      | 1.420   |                      | 1.004   |
| NIW je Anteil                                | €                                          | 15,31   | €                    | 14,91   | €                    | 13,61   |
| ausschüttend II                              | €                                          | 8.366   | €                    | 8.925   | €                    | 9.164   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 1.159   |                      | 1.225   |                      | 1.266   |
| NIW je Anteil                                | €                                          | 7,22    | €                    | 7,29    | €                    | 7,24    |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £                                          | 76.507  | £                    | 76.976  | £                    | 153.980 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 4.391   |                      | 4.577   |                      | 10.174  |
| NIW je Anteil                                | £                                          | 17,43   | £                    | 16,82   | £                    | 15,14   |
| Erträge                                      | £                                          | 5.663   | £                    | 2.139   | £                    | 41.868  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 682     |                      | 258     |                      | 5.208   |
| NIW je Anteil                                | £                                          | 8,30    | £                    | 8,28    | £                    | 8,04    |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$                                         | 5.853   | \$                   | 5.592   | \$                   | 5.078   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 391     |                      | 387     |                      | 389     |
| NIW je Anteil                                | \$                                         | 14,95   | \$                   | 14,46   | \$                   | 13,04   |
| Class E:<br>thesaurierend                    | \$                                         | 30.303  | \$                   | 25.811  | \$                   | 18.689  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 2.103   |                      | 1.847   |                      | 1.475   |
| NIW je Anteil                                | \$                                         | 14,41   | \$                   | 13,97   | \$                   | 12,67   |
| Erträge                                      | \$                                         | 43.503  | \$                   | 43.284  | \$                   | 30.961  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 4.437   |                      | 4.423   |                      | 3.261   |
| NIW je Anteil                                | \$                                         | 9,80    | \$                   | 9,79    | \$                   | 9,49    |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €                                          | 46.850  | €                    | 43.160  | €                    | 40.505  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 3.421   |                      | 3.222   |                      | 3.284   |
| NIW je Anteil                                | €                                          | 13,69   | €                    | 13,40   | €                    | 12,34   |
| Erträge                                      | €                                          | 20.344  | €                    | 20.232  | €                    | 17.818  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |                                            | 2.676   |                      | 2.645   |                      | 2.363   |
| NIW je Anteil                                | €                                          | 7,60    | €                    | 7,65    | €                    | 7,54    |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025        |           | Zum<br>31. Dez. 2024 |           | Zum<br>31. Dez. 2023 |           |
|---------------------------------------|-----------------------------|-----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|                                       | Diversified Income ESG Fund |           |                      |           |                      |           |
| Nettovermögen                         | \$                          | 52.697    | \$                   | 49.578    | \$                   | 57.563    |
| Institutional:                        |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                          | 11.366    | \$                   | 10.864    | \$                   | 10.289    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 947       |                      | 947       |                      | 947       |
| NIW je Anteil                         | \$                          | 12,00     | \$                   | 11,47     | \$                   | 10,87     |
| Institutional EUR (Hedged):           |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                           | 34.926    | €                    | 37.105    | €                    | 42.539    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 3.092     |                      | 3.407     |                      | 4.056     |
| NIW je Anteil                         | €                           | 11,30     | €                    | 10,89     | €                    | 10,49     |
| Institutional GBP (Hedged):           |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | £                           | 226       | £                    | 216       | £                    | 205       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 19        |                      | 19        |                      | 19        |
| NIW je Anteil                         | £                           | 11,81     | £                    | 11,28     | £                    | 10,71     |
| Class E:                              |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                          | 12        | \$                   | 11        | \$                   | 11        |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 1         |                      | 1         |                      | 1         |
| NIW je Anteil                         | \$                          | 11,70     | \$                   | 11,23     | \$                   | 10,73     |
| Class E EUR (Hedged):                 |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                           | 10        | €                    | 10        | €                    | 10        |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 1         |                      | 1         |                      | 1         |
| NIW je Anteil                         | €                           | 11,00     | €                    | 10,66     | €                    | 10,36     |
|                                       | Dynamic Bond Fund           |           |                      |           |                      |           |
| Nettovermögen                         | \$                          | 4.346.816 | \$                   | 3.669.925 | \$                   | 3.445.573 |
| Institutional:                        |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                          | 378.152   | \$                   | 329.051   | \$                   | 339.706   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 23.397    |                      | 21.239    |                      | 23.366    |
| NIW je Anteil                         | \$                          | 16,16     | \$                   | 15,49     | \$                   | 14,54     |
| Erträge                               | \$                          | 76.546    | \$                   | 86.104    | \$                   | 84.564    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 6.992     |                      | 8.046     |                      | 8.063     |
| NIW je Anteil                         | \$                          | 10,95     | \$                   | 10,70     | \$                   | 10,49     |
| Institutional CAD (Hedged):           |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | CAD                         | 9.803     | CAD                  | 9.839     | CAD                  | 10.727    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 835       |                      | 868       |                      | 999       |
| NIW je Anteil                         | CAD                         | 11,74     | CAD                  | 11,34     | CAD                  | 10,73     |
| Institutional CHF (Hedged):           |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | CHF                         | 3.343     | CHF                  | 3.271     | CHF                  | 2.845     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 314       |                      | 314       |                      | 279       |
| NIW je Anteil                         | CHF                         | 10,65     | CHF                  | 10,42     | CHF                  | 10,20     |
| Institutional EUR (Hedged):           |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                           | 49.746    | €                    | 44.317    | €                    | 92.451    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 3.694     |                      | 3.402     |                      | 7.438     |
| NIW je Anteil                         | €                           | 13,47     | €                    | 13,03     | €                    | 12,43     |
| Erträge                               | €                           | 3.692     | €                    | 3.660     | €                    | 5.783     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 406       |                      | 408       |                      | 648       |
| NIW je Anteil                         | €                           | 9,09      | €                    | 8,96      | €                    | 8,93      |
| Institutional GBP (Hedged):           |                             |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | £                           | 2.541.278 | £                    | 2.297.577 | £                    | 1.929.593 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 178.401   |                      | 168.298   |                      | 150.264   |
| NIW je Anteil                         | £                           | 14,24     | £                    | 13,65     | £                    | 12,84     |
| Erträge                               | £                           | 3.678     | £                    | 4.356     | £                    | 95.339    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                             | 500       |                      | 491       |                      | 10.814    |
| NIW je Anteil                         | £                           | 7,35      | £                    | 8,88      | £                    | 8,82      |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                               | Zum<br>30. Jun. 2025       |        | Zum<br>31. Dez. 2024 |        | Zum<br>31. Dez. 2023 |        |
|-----------------------------------------------|----------------------------|--------|----------------------|--------|----------------------|--------|
|                                               | Dynamic Bond Fund (Forts.) |        |                      |        |                      |        |
| Institutional NOK (Hedged):<br>thesaurierend  | NOK                        | 150    | NOK                  | 168    | NOK                  | 3.465  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 11     |                      | 13     |                      | 273    |
| NIW je Anteil                                 | NOK                        | 14,01  | NOK                  | 13,43  | NOK                  | 12,72  |
| Investor:<br>thesaurierend                    | \$                         | 39.285 | \$                   | 39.173 | \$                   | 44.681 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 2.900  |                      | 3.012  |                      | 3.648  |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 13,55  | \$                   | 13,01  | \$                   | 12,25  |
| Erträge                                       | \$                         | 582    | \$                   | 832    | \$                   | 1.272  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 59     |                      | 87     |                      | 136    |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 9,79   | \$                   | 9,57   | \$                   | 9,38   |
| Investor EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €                          | 2.101  | €                    | 2.190  | €                    | 2.053  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 185    |                      | 199    |                      | 195    |
| NIW je Anteil                                 | €                          | 11,36  | €                    | 11,01  | €                    | 10,54  |
| Administrative:<br>thesaurierend              | \$                         | 11.217 | \$                   | 12.311 | \$                   | 15.191 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 750    |                      | 856    |                      | 1.121  |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 14,96  | \$                   | 14,38  | \$                   | 13,56  |
| Administrative EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €                          | 1.288  | €                    | 994    | €                    | 959    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 103    |                      | 82     |                      | 83     |
| NIW je Anteil                                 | €                          | 12,48  | €                    | 12,10  | €                    | 11,60  |
| Administrative SEK (Hedged):<br>thesaurierend | SEK                        | 47.936 | SEK                  | 49.342 | SEK                  | 55.239 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 417    |                      | 442    |                      | 515    |
| NIW je Anteil                                 | SEK                        | 114,96 | SEK                  | 111,64 | SEK                  | 107,23 |
| Class E:<br>thesaurierend                     | \$                         | 66.772 | \$                   | 65.913 | \$                   | 67.914 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 5.204  |                      | 5.336  |                      | 5.807  |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 12,83  | \$                   | 12,35  | \$                   | 11,70  |
| Erträge                                       | \$                         | 13.231 | \$                   | 12.048 | \$                   | 13.906 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 1.322  |                      | 1.232  |                      | 1.451  |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 10,01  | \$                   | 9,78   | \$                   | 9,59   |
| Class E CHF (Hedged):<br>thesaurierend        | CHF                        | 6.634  | CHF                  | 6.634  | CHF                  | 7.671  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 713    |                      | 725    |                      | 850    |
| NIW je Anteil                                 | CHF                        | 9,31   | CHF                  | 9,14   | CHF                  | 9,03   |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend        | €                          | 64.103 | €                    | 63.848 | €                    | 66.769 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 5.472  |                      | 5.609  |                      | 6.094  |
| NIW je Anteil                                 | €                          | 11,71  | €                    | 11,38  | €                    | 10,96  |
| Class E GBP (Hedged):<br>thesaurierend        | £                          | 1.438  | £                    | 1.428  | £                    | 1.882  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 118    |                      | 122    |                      | 169    |
| NIW je Anteil                                 | £                          | 12,18  | £                    | 11,73  | £                    | 11,13  |
| G Retail EUR (Hedged):<br>Erträge             | €                          | 5.213  | €                    | 5.119  | €                    | 5.890  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 632    |                      | 638    |                      | 736    |
| NIW je Anteil                                 | €                          | 8,25   | €                    | 8,02   | €                    | 8,00   |
| H Institutional:<br>thesaurierend             | \$                         | 38.047 | \$                   | 26.938 | \$                   | 44.168 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 3.153  |                      | 2.327  |                      | 4.058  |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 12,07  | \$                   | 11,58  | \$                   | 10,88  |
| Class R:<br>thesaurierend                     | \$                         | 5.164  | \$                   | 5.505  | \$                   | 4.839  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 392    |                      | 436    |                      | 408    |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 13,16  | \$                   | 12,62  | \$                   | 11,85  |
| Class Z:<br>thesaurierend                     | \$                         | 55.535 | \$                   | 60.681 | \$                   | 15.699 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile         |                            | 4.948  |                      | 5.665  |                      | 1.576  |
| NIW je Anteil                                 | \$                         | 11,22  | \$                   | 10,71  | \$                   | 9,96   |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |           |
|---------------------------------------|----------------------------|----------------------|----------------------|-----------|
|                                       | Dynamic Bond Fund (Forts.) |                      |                      |           |
| Class Z AUD (Hedged):                 |                            |                      |                      |           |
| Erträge                               | k. A.                      | k. A.                | AUD                  | 16.551    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 1.767     |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | AUD                  | 9,36      |
|                                       | Dynamic Multi-Asset Fund   |                      |                      |           |
| Nettovermögen                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 3.262.045 |
| Institutional:                        |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 1.030.988 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 86.743    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 11,89     |
| ausschüttend II                       | k. A.                      | k. A.                | €                    | 120.582   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 11.229    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 10,74     |
| Institutional CHF (Hedged):           |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | CHF                  | 2.459     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 245       |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | CHF                  | 10,04     |
| Institutional GBP (Hedged):           |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | £                    | 407.097   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 31.957    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | £                    | 12,74     |
| Erträge                               | k. A.                      | k. A.                | £                    | 10.386    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 955       |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | £                    | 10,88     |
| Institutional ILS (Hedged):           |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | ILS                  | 16.594    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 1.668     |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | ILS                  | 9,95      |
| Institutional SGD (Hedged):           |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | SGD                  | 81.668    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 9.303     |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | SGD                  | 8,78      |
| Institutional USD (Hedged):           |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 113.739   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 8.164     |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 13,93     |
| ausschüttend II                       | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 4.415     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 531       |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 8,31      |
| Investor:                             |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 9.375     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 1.014     |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 9,25      |
| BM Retail AUD (Hedged):               |                            |                      |                      |           |
| ausschüttend II                       | k. A.                      | k. A.                | AUD                  | 161       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 18        |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | AUD                  | 8,75      |
| BM Retail USD (Hedged):               |                            |                      |                      |           |
| ausschüttend II                       | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 604       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 67        |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 8,97      |
| Class E:                              |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 1.109.492 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 101.172   |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 10,97     |
| Erträge                               | k. A.                      | k. A.                | €                    | 3.256     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 361       |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | €                    | 9,02      |
| Class E USD (Hedged):                 |                            |                      |                      |           |
| thesaurierend                         | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 125.652   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                      | k. A.                |                      | 10.789    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                      | k. A.                | \$                   | 11,65     |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)     |                      |                      |                      |
| H Institutional USD (Hedged):         |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                | k. A.                | \$ 656               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 67                   |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | \$ 9,74              |
| M Retail AUD (Hedged):                |                      |                      |                      |
| ausschüttend II                       | k. A.                | k. A.                | AUD 325              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 41                   |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | AUD 7,85             |
| M Retail SGD (Hedged):                |                      |                      |                      |
| ausschüttend II                       | k. A.                | k. A.                | SGD 9.292            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 1.158                |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | SGD 8,02             |
| M Retail USD (Hedged):                |                      |                      |                      |
| ausschüttend II                       | k. A.                | k. A.                | \$ 45.217            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 5.059                |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | \$ 8,94              |
| Class T:                              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                | k. A.                | € 67.018             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 6.648                |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | € 10,08              |
| Class T USD (Hedged):                 |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                | k. A.                | \$ 3.019             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 353                  |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | \$ 8,56              |
| Class Z:                              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                | k. A.                | € 104.488            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 9.677                |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | € 10,80              |
| Emerging Local Bond Fund              |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$ 4.261.729         | \$ 2.840.608         | \$ 2.880.941         |
| Institutional:                        |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 2.299.160         | \$ 1.818.589         | \$ 1.787.853         |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 138.792              | 124.801              | 122.115              |
| NIW je Anteil                         | \$ 16,57             | \$ 14,57             | \$ 14,64             |
| Erträge                               | \$ 220.045           | \$ 101.066           | \$ 86.891            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 32.187               | 16.227               | 12.960               |
| NIW je Anteil                         | \$ 6,84              | \$ 6,23              | \$ 6,70              |
| Institutional EUR (Unhedged):         |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 637.679            | € 495.517            | € 409.418            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 40.970               | 31.927               | 28.009               |
| NIW je Anteil                         | € 15,56              | € 15,52              | € 14,62              |
| Erträge                               | € 174.525            | € 171.761            | € 160.464            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 26.017               | 24.787               | 22.947               |
| NIW je Anteil                         | € 6,71               | € 6,93               | € 6,99               |
| Institutional GBP (Unhedged):         |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | £ 45.969             | £ 36.430             | £ 6.345              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1.925                | 1.585                | 280                  |
| NIW je Anteil                         | £ 23,88              | £ 22,99              | £ 22,69              |
| Investor:                             |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 8.408             | \$ 5.832             | \$ 8.219             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 679                  | 534                  | 747                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 12,39             | \$ 10,91             | \$ 11,00             |
| Investor EUR (Unhedged):              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                | k. A.                | € 664                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 64                   |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | € 10,34              |
| Class E:                              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 47.038            | \$ 34.706            | \$ 41.451            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 3.346                | 2.792                | 3.286                |
| NIW je Anteil                         | \$ 14,06             | \$ 12,43             | \$ 12,61             |
| Erträge                               | \$ 21.825            | \$ 14.581            | \$ 15.039            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 3.409                | 2.500                | 2.395                |
| NIW je Anteil                         | \$ 6,40              | \$ 5,83              | \$ 6,28              |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| Emerging Local Bond Fund (Forts.)     |                      |                      |                      |
| Class E EUR (Unhedged):               |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 82.803             | € 76.471             | € 76.314             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 5.019                | 4.626                | 4.853                |
| NIW je Anteil                         | € 16,50              | € 16,53              | € 15,73              |
| Erträge                               | € 2.180              | € 3.022              | € 1.590              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 239                  | 321                  | 167                  |
| NIW je Anteil                         | € 9,11               | € 9,41               | € 9,50               |
| H Institutional:                      |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 508.368           | \$ 593               | \$ 189.970           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 43.756               | 58                   | 18.463               |
| NIW je Anteil                         | \$ 11,62             | \$ 10,23             | \$ 10,29             |
| Class Z:                              |                      |                      |                      |
| Erträge                               | \$ 40.730            | \$ 46.333            | \$ 27.121            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 4.973                | 6.210                | 3.377                |
| NIW je Anteil                         | \$ 8,19              | \$ 7,46              | \$ 8,03              |
| Emerging Local Bond ESG Fund          |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$ 133.358           | \$ 116.904           | \$ 102.408           |
| Institutional:                        |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 3.800             | \$ 4.410             | \$ 5.975             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 279                  | 369                  | 489                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 13,60             | \$ 11,95             | \$ 12,22             |
| Erträge                               | \$ 46                | \$ 31                | \$ 12                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 4                    | 3                    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$ 11,34             | \$ 10,31             | \$ 11,26             |
| Institutional EUR (Unhedged):         |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 101.301            | € 99.656             | € 85.778             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 8.637                | 8.541                | 7.664                |
| NIW je Anteil                         | € 11,73              | € 11,67              | € 11,19              |
| Erträge                               | € 11                 | € 11                 | € 10                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                    | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | € 9,78               | € 10,08              | € 10,31              |
| Institutional GBP (Unhedged):         |                      |                      |                      |
| Erträge                               | £ 9                  | £ 8                  | £ 8                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                    | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | £ 9,47               | £ 9,42               | £ 10,13              |
| Investor:                             |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                | k. A.                | \$ 12                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | \$ 12,16             |
| Erträge                               | k. A.                | k. A.                | \$ 12                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | \$ 11,26             |
| Investor EUR (Unhedged):              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                | k. A.                | € 10                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | € 11,14              |
| Erträge                               | k. A.                | k. A.                | € 10                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | k. A.                | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                | k. A.                | € 10,31              |
| Class E:                              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 13                | \$ 12                | \$ 12                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                    | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$ 13,22             | \$ 11,67             | \$ 12,05             |
| Erträge                               | \$ 13                | \$ 12                | \$ 12                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                    | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | \$ 11,34             | \$ 10,31             | \$ 11,25             |
| Class E EUR (Unhedged):               |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 10                 | € 10                 | € 10                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                    | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                         | € 11,40              | € 11,40              | € 11,03              |



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025                  |           | Zum<br>31. Dez. 2024 |           | Zum<br>31. Dez. 2023 |           |
|---------------------------------------|---------------------------------------|-----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|                                       | Emerging Local Bond ESG Fund (Forts.) |           |                      |           |                      |           |
| Erträge                               | €                                     | 10        | €                    | 10        | €                    | 10        |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 1         |                      | 1         |                      | 1         |
| NIW je Anteil                         | €                                     | 9,77      | €                    | 10,07     | €                    | 10,31     |
| Class Z:                              |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                                    | 10.524    | \$                   | 9.201     | \$                   | 1.550     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 742       |                      | 742       |                      | 123       |
| NIW je Anteil                         | \$                                    | 14,19     | \$                   | 12,41     | \$                   | 12,57     |
|                                       | Emerging Markets Bond Fund            |           |                      |           |                      |           |
| Nettovermögen                         | \$                                    | 4.694.594 | \$                   | 4.179.583 | \$                   | 3.846.285 |
| Institutional:                        |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                                    | 1.393.291 | \$                   | 1.424.377 | \$                   | 1.269.939 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 23.853    |                      | 26.027    |                      | 25.159    |
| NIW je Anteil                         | \$                                    | 58,41     | \$                   | 54,73     | \$                   | 50,48     |
| Erträge                               | \$                                    | 154.204   | \$                   | 142.911   | \$                   | 91.725    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 9.565     |                      | 9.092     |                      | 5.909     |
| NIW je Anteil                         | \$                                    | 16,12     | \$                   | 15,72     | \$                   | 15,52     |
| Institutional CHF (Hedged):           |                                       |           |                      |           |                      |           |
| Erträge                               | CHF                                   | 17.760    | CHF                  | 17.165    | CHF                  | 77.520    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 1.257     |                      | 1.222     |                      | 5.347     |
| NIW je Anteil                         | CHF                                   | 14,13     | CHF                  | 14,04     | CHF                  | 14,50     |
| Institutional EUR (Hedged):           |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                                     | 835.356   | €                    | 640.030   | €                    | 705.340   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 19.164    |                      | 15.533    |                      | 18.243    |
| NIW je Anteil                         | €                                     | 43,59     | €                    | 41,20     | €                    | 38,66     |
| Erträge                               | €                                     | 539.159   | €                    | 432.534   | €                    | 438.978   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 75.799    |                      | 61.899    |                      | 62.494    |
| NIW je Anteil                         | €                                     | 7,11      | €                    | 6,99      | €                    | 7,02      |
| Institutional EUR<br>(Unhedged):      |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                                     | 149.639   | €                    | 188.191   | €                    | 179.735   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 11.312    |                      | 13.395    |                      | 14.796    |
| NIW je Anteil                         | €                                     | 13,23     | €                    | 14,05     | €                    | 12,15     |
| Institutional GBP (Hedged):           |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | £                                     | 23.984    | £                    | 21.958    | £                    | 20.841    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 798       |                      | 780       |                      | 800       |
| NIW je Anteil                         | £                                     | 30,06     | £                    | 28,15     | £                    | 26,06     |
| Erträge                               | £                                     | 49.456    | £                    | 47.257    | £                    | 26.761    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 13.111    |                      | 12.870    |                      | 7.338     |
| NIW je Anteil                         | £                                     | 3,77      | £                    | 3,67      | £                    | 3,65      |
| Institutional NOK (Hedged):           |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | NOK                                   | 362.729   |                      | k. A.     |                      | k. A.     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 3.535     |                      | k. A.     |                      | k. A.     |
| NIW je Anteil                         | NOK                                   | 102,61    |                      | k. A.     |                      | k. A.     |
| Institutional SEK (Hedged):           |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | SEK                                   | 95.959    |                      | k. A.     |                      | k. A.     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 933       |                      | k. A.     |                      | k. A.     |
| NIW je Anteil                         | SEK                                   | 102,80    |                      | k. A.     |                      | k. A.     |
| Institutional SGD (Hedged):           |                                       |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | SGD                                   | 31.256    | SGD                  | 29.366    | SGD                  | 24.108    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                       | 2.552     |                      | 2.538     |                      | 2.217     |
| NIW je Anteil                         | SGD                                   | 12,25     | SGD                  | 11,57     | SGD                  | 10,87     |

|                        |                                       | Zum<br>30. Jun. 2025                   |         | Zum<br>31. Dez. 2024 |         | Zum<br>31. Dez. 2023 |         |
|------------------------|---------------------------------------|----------------------------------------|---------|----------------------|---------|----------------------|---------|
|                        |                                       | Emerging Markets Bond<br>Fund (Forts.) |         |                      |         |                      |         |
| Investor:              |                                       |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | thesaurierend                         | \$                                     | 5.982   | \$                   | 4.668   | \$                   | 4.491   |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 111     |                      | 92      |                      | 96      |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 53,87   | \$                   | 50,56   | \$                   | 46,80   |
| Investor EUR (Hedged): |                                       | €                                      | 4.389   | €                    | 3.762   | €                    | 3.537   |
|                        | thesaurierend                         |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 441     |                      | 399     |                      | 398     |
|                        | NIW je Anteil                         | €                                      | 9,96    | €                    | 9,43    | €                    | 8,88    |
| Administrative:        |                                       |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | thesaurierend                         | \$                                     | 25.538  | \$                   | 27.182  | \$                   | 30.109  |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 487     |                      | 552     |                      | 659     |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 52,47   | \$                   | 49,28   | \$                   | 45,68   |
| BM Retail:             |                                       |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | dekumulierend                         | \$                                     | 9.641   | \$                   | 5.419   | \$                   | 10      |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 1.022   |                      | 573     |                      | 1       |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 9,43    | \$                   | 9,45    | \$                   | 9,94    |
|                        | ausschüttend II                       | \$                                     | 1.062   | \$                   | 1.960   | \$                   | 862     |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 114     |                      | 213     |                      | 92      |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 9,31    | \$                   | 9,19    | \$                   | 9,35    |
| Class E:               |                                       |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | thesaurierend                         | \$                                     | 169.833 | \$                   | 164.774 | \$                   | 135.062 |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 3.448   |                      | 3.555   |                      | 3.131   |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 49,25   | \$                   | 46,35   | \$                   | 43,14   |
|                        | Erträge                               | \$                                     | 49.296  | \$                   | 48.537  | \$                   | 66.773  |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 5.074   |                      | 5.124   |                      | 7.136   |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 9,71    | \$                   | 9,47    | \$                   | 9,36    |
| Class E EUR (Hedged):  |                                       | €                                      | 127.793 | €                    | 128.913 | €                    | 134.655 |
|                        | thesaurierend                         |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 3.483   |                      | 3.700   |                      | 4.082   |
|                        | NIW je Anteil                         | €                                      | 36,69   | €                    | 34,84   | €                    | 32,99   |
| Class E SGD (Hedged):  |                                       | SGD                                    | 13.603  | SGD                  | 12.777  | SGD                  | 9.601   |
|                        | thesaurierend                         |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 203     |                      | 201     |                      | 159     |
|                        | NIW je Anteil                         | SGD                                    | 66,96   | SGD                  | 63,54   | SGD                  | 60,26   |
| H Institutional:       |                                       |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | thesaurierend                         | \$                                     | 658.139 | \$                   | 701.032 | \$                   | 417.764 |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 11.612  |                      | 13.190  |                      | 8.507   |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 56,68   | \$                   | 53,15   | \$                   | 49,11   |
|                        | Erträge                               | \$                                     | 284     | \$                   | 276     | \$                   | 272     |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 34      |                      | 34      |                      | 34      |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 8,26    | \$                   | 8,06    | \$                   | 7,96    |
| M Retail:              |                                       |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | dekumulierend                         | \$                                     | 31.171  | \$                   | 30.040  | \$                   | 10      |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 3.257   |                      | 3.149   |                      | 1       |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 9,57    | \$                   | 9,54    | \$                   | 9,94    |
|                        | Erträge                               | \$                                     | 10.652  | \$                   | 10.703  | \$                   | 8.479   |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 1.218   |                      | 1.256   |                      | 1.006   |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 8,74    | \$                   | 8,52    | \$                   | 8,43    |
|                        | ausschüttend II                       | \$                                     | 7.314   | \$                   | 10.269  | \$                   | 4.243   |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 1.034   |                      | 1.477   |                      | 606     |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 7,08    | \$                   | 6,95    | \$                   | 7,00    |
| M Retail AUD (Hedged): |                                       | AUD                                    | 5.039   | AUD                  | 4.429   | AUD                  | 5.240   |
|                        | Erträge                               |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 659     |                      | 594     |                      | 702     |
|                        | NIW je Anteil                         | AUD                                    | 7,65    | AUD                  | 7,46    | AUD                  | 7,47    |
| Class Z:               |                                       |                                        |         |                      |         |                      |         |
|                        | Erträge                               | \$                                     | 26.512  | \$                   | 25.278  | \$                   | 19.360  |
|                        | ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                        | 2.473   |                      | 2.419   |                      | 1.876   |
|                        | NIW je Anteil                         | \$                                     | 10,72   | \$                   | 10,45   | \$                   | 10,32   |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025           |           | Zum<br>31. Dez. 2024 |           | Zum<br>31. Dez. 2023 |           |
|---------------------------------------|--------------------------------|-----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|                                       | Emerging Markets Bond ESG Fund |           |                      |           |                      |           |
| Nettovermögen                         | \$                             | 2.996.313 | \$                   | 2.676.135 | \$                   | 2.693.921 |
| Institutional:                        |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                             | 810.572   | \$                   | 832.226   | \$                   | 714.848   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 45.145    |                      | 49.059    |                      | 45.724    |
| NIW je Anteil                         | \$                             | 17,95     | \$                   | 16,96     | \$                   | 15,63     |
| Erträge                               | \$                             | 303.022   | \$                   | 308.216   | \$                   | 276.510   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 36.976    |                      | 38.328    |                      | 34.964    |
| NIW je Anteil                         | \$                             | 8,20      | \$                   | 8,04      | \$                   | 7,91      |
| Institutional CHF (Hedged):           |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | CHF                            | 561.159   | CHF                  | 517.230   | CHF                  | 257.904   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 62.869    |                      | 60.140    |                      | 31.142    |
| NIW je Anteil                         | CHF                            | 8,93      | CHF                  | 8,60      | CHF                  | 8,28      |
| Institutional EUR (Hedged):           |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                              | 820.863   | €                    | 757.945   | €                    | 915.574   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 69.767    |                      | 67.583    |                      | 87.099    |
| NIW je Anteil                         | €                              | 11,77     | €                    | 11,21     | €                    | 10,51     |
| Erträge                               | €                              | 112.141   | €                    | 96.146    | €                    | 146.989   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 16.283    |                      | 14.116    |                      | 21.564    |
| NIW je Anteil                         | €                              | 6,89      | €                    | 6,81      | €                    | 6,82      |
| Institutional GBP (Hedged):           |                                |           |                      |           |                      |           |
| Erträge                               | £                              | 12.819    | £                    | 17.436    | £                    | 108.520   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 1.647     |                      | 2.288     |                      | 14.385    |
| NIW je Anteil                         | £                              | 7,78      | £                    | 7,62      | £                    | 7,54      |
| Institutional GBP<br>(Unhedged):      |                                |           |                      |           |                      |           |
| Erträge                               | £                              | 5.247     | £                    | 6.483     | £                    | 5.452     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 692       |                      | 797       |                      | 692       |
| NIW je Anteil                         | £                              | 7,58      | £                    | 8,14      | £                    | 7,88      |
| Investor NOK (Hedged):                |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | NOK                            | 6.023     | NOK                  | 3.746     | NOK                  | 4.544     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 47        |                      | 31        |                      | 40        |
| NIW je Anteil                         | NOK                            | 127,29    | NOK                  | 120,38    | NOK                  | 112,37    |
| Investor SEK (Hedged):                |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | SEK                            | 27.968    | SEK                  | 26.674    | SEK                  | 27.789    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 246       |                      | 246       |                      | 271       |
| NIW je Anteil                         | SEK                            | 113,69    | SEK                  | 108,60    | SEK                  | 102,52    |
| Administrative:                       |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | \$                             | 669       | \$                   | 633       | \$                   | 345       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 62        |                      | 62        |                      | 37        |
| NIW je Anteil                         | \$                             | 10,71     | \$                   | 10,14     | \$                   | 9,39      |
| Erträge                               | \$                             | 782       | \$                   | 768       | \$                   | 755       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 95        |                      | 95        |                      | 95        |
| NIW je Anteil                         | \$                             | 8,20      | \$                   | 8,05      | \$                   | 7,91      |
| Administrative EUR<br>(Hedged):       |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | €                              | 713       | €                    | 740       |                      | k. A.     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 63        |                      | 69        |                      | k. A.     |
| NIW je Anteil                         | €                              | 11,29     | €                    | 10,78     |                      | k. A.     |
| Administrative SEK<br>(Hedged):       |                                |           |                      |           |                      |           |
| thesaurierend                         | SEK                            | 356       | SEK                  | 407       | SEK                  | 250       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |                                | 4         |                      | 5         |                      | 3         |
| NIW je Anteil                         | SEK                            | 92,51     | SEK                  | 88,49     | SEK                  | 83,60     |

|                                          |     | Zum<br>30. Jun. 2025                         | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |     |         |
|------------------------------------------|-----|----------------------------------------------|----------------------|----------------------|-----|---------|
|                                          |     | Emerging Markets Bond ESG<br>Fund (Forts.)   |                      |                      |     |         |
| Class E:                                 |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | \$  | 6.501                                        | \$                   | 6.083                | \$  | 3.444   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 679                                          |                      | 668                  |     | 407     |
| NIW je Anteil                            | \$  | 9,59                                         | \$                   | 9,10                 | \$  | 8,46    |
| Erträge                                  | \$  | 591                                          | \$                   | 615                  | \$  | 512     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 75                                           |                      | 80                   |     | 67      |
| NIW je Anteil                            | \$  | 7,87                                         | \$                   | 7,71                 | \$  | 7,59    |
| Class E EUR (Hedged):                    |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | €   | 38.184                                       | €                    | 37.595               | €   | 58.741  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 3.804                                        |                      | 3.911                |     | 6.460   |
| NIW je Anteil                            | €   | 10,04                                        | €                    | 9,61                 | €   | 9,09    |
| Class Z:                                 |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | \$  | 13                                           | \$                   | 12                   | \$  | 3.909   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 1                                            |                      | 1                    |     | 353     |
| NIW je Anteil                            | \$  | 12,86                                        | \$                   | 12,10                | \$  | 11,06   |
|                                          |     | Emerging Markets Corporate<br>Bond Fund      |                      |                      |     |         |
| Nettovermögen                            | \$  | 162.964                                      | \$                   | 146.021              | \$  | 157.713 |
| Institutional:                           |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | \$  | 10.152                                       | \$                   | 9.210                | \$  | 12.120  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 553                                          |                      | 523                  |     | 733     |
| NIW je Anteil                            | \$  | 18,37                                        | \$                   | 17,62                | \$  | 16,54   |
| Institutional EUR (Hedged):              |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | €   | 97.750                                       | €                    | 94.542               | €   | 90.459  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 6.661                                        |                      | 6.658                |     | 6.680   |
| NIW je Anteil                            | €   | 14,67                                        | €                    | 14,20                | €   | 13,54   |
| Class E:                                 |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | \$  | 8.335                                        | \$                   | 10.215               | \$  | 11.521  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 614                                          |                      | 780                  |     | 930     |
| NIW je Anteil                            | \$  | 13,58                                        | \$                   | 13,09                | \$  | 12,39   |
| Class E CHF (Hedged):                    |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | CHF | 6.149                                        | CHF                  | 7.726                | CHF | 8.772   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 609                                          |                      | 779                  |     | 895     |
| NIW je Anteil                            | CHF | 10,09                                        | CHF                  | 9,92                 | CHF | 9,80    |
| Class E EUR (Hedged):                    |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | €   | 18.748                                       | €                    | 19.481               | €   | 21.477  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 1.489                                        |                      | 1.592                |     | 1.824   |
| NIW je Anteil                            | €   | 12,59                                        | €                    | 12,24                | €   | 11,78   |
|                                          |     | PIMCO Emerging Markets<br>Opportunities Fund |                      |                      |     |         |
| Nettovermögen                            | \$  | 432.459                                      | \$                   | 327.198              | \$  | 282.790 |
| Institutional:                           |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | \$  | 69.721                                       | \$                   | 65.773               | \$  | 64.011  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 5.133                                        |                      | 5.366                |     | 5.588   |
| NIW je Anteil                            | \$  | 13,58                                        | \$                   | 12,26                | \$  | 11,46   |
| Institutional EUR (Partially<br>Hedged): |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | €   | 153.681                                      | €                    | 104.475              | €   | 77.402  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 12.717                                       |                      | 8.962                |     | 7.282   |
| NIW je Anteil                            | €   | 12,08                                        | €                    | 11,66                | €   | 10,63   |
| Institutional GBP (Partially<br>Hedged): |     |                                              |                      |                      |     |         |
| Erträge                                  | £   | 986                                          | £                    | 917                  | £   | 829     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 101                                          |                      | 95                   |     | 85      |
| NIW je Anteil                            | £   | 9,78                                         | £                    | 9,64                 | £   | 9,70    |
| Class E:                                 |     |                                              |                      |                      |     |         |
| thesaurierend                            | \$  | 1.426                                        | \$                   | 123                  | \$  | 11      |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 113                                          |                      | 11                   |     | 1       |
| NIW je Anteil                            | \$  | 12,61                                        | \$                   | 11,43                | \$  | 10,78   |
| Erträge                                  | \$  | 603                                          | \$                   | 144                  | \$  | 11      |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 54                                           |                      | 14                   |     | 1       |
| NIW je Anteil                            | \$  | 11,11                                        | \$                   | 10,50                | \$  | 10,65   |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| Class E EUR (Partially Hedged):<br>thesaurierend | Zum<br>30. Jun. 2025                                  |         | Zum<br>31. Dez. 2024 |         | Zum<br>31. Dez. 2023 |         |
|--------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|---------|----------------------|---------|----------------------|---------|
|                                                  | PIMCO Emerging Markets Opportunities<br>Fund (Forts.) |         |                      |         |                      |         |
|                                                  | €                                                     | 18.178  | €                    | 9.813   | €                    | 759     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 1.602   |                      | 892     |                      | 75      |
| NIW je Anteil                                    | €                                                     | 11,35   | €                    | 11,00   | €                    | 10,12   |
| Class Z:                                         |                                                       |         |                      |         |                      |         |
| thesaurierend                                    | \$                                                    | 157.623 | \$                   | 141.665 | \$                   | 131.360 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 11.634  |                      | 11.634  |                      | 11.634  |
| NIW je Anteil                                    | \$                                                    | 13,55   | \$                   | 12,18   | \$                   | 11,29   |
|                                                  | Emerging Markets Short-Term Local<br>Currency Fund    |         |                      |         |                      |         |
| Nettovermögen                                    | \$                                                    | 14.130  | \$                   | 15.660  | \$                   | 19.946  |
| Institutional EUR (Unhedged):<br>thesaurierend   | €                                                     | 1.222   | €                    | 3.797   | €                    | 6.118   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 76      |                      | 234     |                      | 408     |
| NIW je Anteil                                    | €                                                     | 16,02   | €                    | 16,20   | €                    | 14,99   |
| Class E:                                         |                                                       |         |                      |         |                      |         |
| thesaurierend                                    | \$                                                    | 3.961   | \$                   | 3.442   | \$                   | 4.075   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 273     |                      | 265     |                      | 315     |
| NIW je Anteil                                    | \$                                                    | 14,49   | \$                   | 12,98   | \$                   | 12,93   |
| Class E EUR (Unhedged):<br>thesaurierend         | €                                                     | 7.441   | €                    | 8.002   | €                    | 8.249   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 501     |                      | 531     |                      | 586     |
| NIW je Anteil                                    | €                                                     | 14,86   | €                    | 15,10   | €                    | 14,09   |
|                                                  | PIMCO ESG Income Fund                                 |         |                      |         |                      |         |
| Nettovermögen                                    | \$                                                    | 528.132 | \$                   | 351.843 | \$                   | 271.208 |
| Institutional:                                   |                                                       |         |                      |         |                      |         |
| thesaurierend                                    | \$                                                    | 71.382  | \$                   | 56.954  | \$                   | 44.067  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 6.535   |                      | 5.464   |                      | 4.416   |
| NIW je Anteil                                    | \$                                                    | 10,92   | \$                   | 10,42   | \$                   | 9,98    |
| Erträge                                          | \$                                                    | 7       | \$                   | 7       | \$                   | 6       |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 1       |                      | 1       |                      | 1       |
| NIW je Anteil                                    | \$                                                    | 9,44    | \$                   | 9,23    | \$                   | 9,28    |
| Institutional AUD (Hedged):<br>Erträge           | AUD                                                   | 58.346  | AUD                  | 61.367  | AUD                  | 71.681  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 6.439   |                      | 6.923   |                      | 7.954   |
| NIW je Anteil                                    | AUD                                                   | 9,06    | AUD                  | 8,86    | AUD                  | 9,01    |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend     | CHF                                                   | 648     | CHF                  | 2.028   | CHF                  | 1.264   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 68      |                      | 219     |                      | 137     |
| NIW je Anteil                                    | CHF                                                   | 9,49    | CHF                  | 9,24    | CHF                  | 9,24    |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend     | €                                                     | 78.548  | €                    | 53.433  | €                    | 43.366  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 7.755   |                      | 5.477   |                      | 4.567   |
| NIW je Anteil                                    | €                                                     | 10,13   | €                    | 9,76    | €                    | 9,50    |
| Erträge                                          | €                                                     | 43.170  | €                    | 44.222  | €                    | 42.423  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 4.943   |                      | 5.127   |                      | 4.808   |
| NIW je Anteil                                    | €                                                     | 8,73    | €                    | 8,63    | €                    | 8,82    |
| Institutional GBP (Hedged):<br>Erträge           | £                                                     | 69.738  | £                    | 12.766  | £                    | 382     |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 7.568   |                      | 1.416   |                      | 42      |
| NIW je Anteil                                    | £                                                     | 9,22    | £                    | 9,01    | £                    | 9,10    |
| Institutional NOK (Hedged):<br>thesaurierend     | NOK                                                   | 788.414 | NOK                  | 608.917 | NOK                  | 286.985 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 7.013   |                      | 5.679   |                      | 2.768   |
| NIW je Anteil                                    | NOK                                                   | 112,43  | NOK                  | 107,23  | NOK                  | 103,69  |
| Institutional SEK (Hedged):<br>thesaurierend     | SEK                                                   | 547.299 | SEK                  | 502.524 | SEK                  | 177.546 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile            |                                                       | 5.416   |                      | 5.159   |                      | 1.868   |
| NIW je Anteil                                    | SEK                                                   | 101,05  | SEK                  | 97,42   | SEK                  | 95,05   |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025           |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|--------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|
|                                       |     | PIMCO ESG Income Fund (Forts.) |     |                      |     |                      |
| Institutional SGD (Hedged):           |     |                                |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | SGD | 2.397                          | SGD | 1.896                | SGD | 411                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 266                            |     | 213                  |     | 45                   |
| NIW je Anteil                         | SGD | 9,02                           | SGD | 8,91                 | SGD | 9,13                 |
| Administrative EUR (Hedged):          |     |                                |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | €   | 10                             | €   | 9                    |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1                              |     | 1                    |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | €   | 10,24                          | €   | 9,88                 |     | k. A.                |
| Administrative SEK (Hedged):          |     |                                |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | SEK | 35.245                         | SEK | 30.695               | SEK | 52.396               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 333                            |     | 300                  |     | 523                  |
| NIW je Anteil                         | SEK | 105,79                         | SEK | 102,24               | SEK | 100,24               |
| Class E:                              |     |                                |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 3.320                          | \$  | 3.335                | \$  | 2.429                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 316                            |     | 331                  |     | 249                  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,52                          | \$  | 10,08                | \$  | 9,74                 |
| Erträge                               | \$  | 1.377                          | \$  | 1.061                | \$  | 444                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 148                            |     | 116                  |     | 48                   |
| NIW je Anteil                         | \$  | 9,28                           | \$  | 9,12                 | \$  | 9,25                 |
| Class E CHF (Hedged):                 |     |                                |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | CHF | 577                            | CHF | 579                  | CHF | 9                    |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 72                             |     | 72                   |     | 1                    |
| NIW je Anteil                         | CHF | 8,04                           | CHF | 8,07                 | CHF | 8,57                 |
| Class E EUR (Hedged):                 |     |                                |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | €   | 6.612                          | €   | 6.900                | €   | 6.379                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 680                            |     | 734                  |     | 691                  |
| NIW je Anteil                         | €   | 9,72                           | €   | 9,40                 | €   | 9,23                 |
| Erträge                               | €   | 4.392                          | €   | 2.745                | €   | 1.798                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 511                            |     | 322                  |     | 204                  |
| NIW je Anteil                         | €   | 8,60                           | €   | 8,53                 | €   | 8,81                 |
| Class R AUD (Hedged):                 |     |                                |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | AUD | 22.613                         | AUD | 23.071               | AUD | 26.623               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.507                          |     | 2.611                |     | 2.955                |
| NIW je Anteil                         | AUD | 9,02                           | AUD | 8,84                 | AUD | 9,01                 |
| Class Z:                              |     |                                |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 5.163                          | \$  | 4.961                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 487                            |     | 492                  |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,60                          | \$  | 10,08                |     | k. A.                |
|                                       |     | Euro Bond Fund                 |     |                      |     |                      |
| Nettovermögen                         | €   | 1.638.898                      | €   | 1.675.554            | €   | 1.671.713            |
| Institutional:                        |     |                                |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | €   | 1.170.073                      | €   | 1.203.768            | €   | 1.122.219            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 48.210                         |     | 50.327               |     | 48.219               |
| NIW je Anteil                         | €   | 24,27                          | €   | 23,92                | €   | 23,27                |
| Erträge                               | €   | 25.908                         | €   | 25.983               | €   | 31.807               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.771                          |     | 1.777                |     | 2.175                |
| NIW je Anteil                         | €   | 14,63                          | €   | 14,62                | €   | 14,63                |
| Institutional CHF (Hedged):           |     |                                |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | CHF | 263.154                        | CHF | 263.054              | CHF | 327.426              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 8.431                          |     | 8.448                |     | 10.517               |
| NIW je Anteil                         | CHF | 31,21                          | CHF | 31,14                | CHF | 31,13                |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| <b>Euro Bond Fund (Forts.)</b>        |                      |                      |                      |
| Investor:                             |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 22.710             | € 23.314             | € 20.023             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1.014                | 1.054                | 927                  |
| NIW je Anteil                         | € 22,40              | € 22,11              | € 21,59              |
| Class E:                              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 116.684            | € 118.440            | € 120.775            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 5.723                | 5.868                | 6.094                |
| NIW je Anteil                         | € 20,39              | € 20,18              | € 19,82              |
| Erträge                               | € 21.890             | € 23.734             | € 24.717             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 2.074                | 2.250                | 2.342                |
| NIW je Anteil                         | € 10,56              | € 10,55              | € 10,55              |
| <b>Euro Credit Fund</b>               |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                         | € 489.966            | € 506.513            | € 537.186            |
| Institutional:                        |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 314.252            | € 336.100            | € 347.915            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 19.059               | 20.806               | 22.389               |
| NIW je Anteil                         | € 16,49              | € 16,15              | € 15,54              |
| ausschüttend II                       | € 317                | € 336                | € 6.860              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 33                   | 35                   | 719                  |
| NIW je Anteil                         | € 9,52               | € 9,52               | € 9,54               |
| Class E:                              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 26.604             | € 30.859             | € 40.494             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 2.100                | 2.475                | 3.346                |
| NIW je Anteil                         | € 12,67              | € 12,47              | € 12,10              |
| H Institutional:                      |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 148.791            | € 139.130            | € 141.817            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 14.938               | 14.263               | 15.125               |
| NIW je Anteil                         | € 9,96               | € 9,76               | € 9,38               |
| ausschüttend II                       | € 2                  | € 88                 | € 100                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 0                    | 10                   | 11                   |
| NIW je Anteil                         | € 8,67               | € 8,67               | € 8,68               |
| <b>Euro Income Bond Fund</b>          |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                         | € 1.873.185          | € 1.676.869          | € 1.387.227          |
| Institutional:                        |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 514.281            | € 473.586            | € 323.024            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 31.214               | 29.590               | 21.389               |
| NIW je Anteil                         | € 16,48              | € 16,00              | € 15,10              |
| Erträge                               | € 78.678             | € 63.630             | € 65.612             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 7.830                | 6.390                | 6.705                |
| NIW je Anteil                         | € 10,05              | € 9,96               | € 9,79               |
| Investor:                             |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 19.716             | € 14.459             | € 14.845             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1.879                | 1.416                | 1.536                |
| NIW je Anteil                         | € 10,49              | € 10,21              | € 9,67               |
| Erträge                               | € 10.264             | € 10.224             | € 8.086              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1.058                | 1.061                | 851                  |
| NIW je Anteil                         | € 9,70               | € 9,63               | € 9,50               |
| Administrative:                       |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 1.425              | € 1.577              | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 131                  | 149                  | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | € 10,86              | € 10,58              | k. A.                |
| Class E:                              |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 737.539            | € 643.783            | € 573.864            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 50.925               | 45.557               | 42.654               |
| NIW je Anteil                         | € 14,48              | € 14,13              | € 13,45              |
| Erträge                               | € 435.274            | € 408.562            | € 359.021            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 49.667               | 46.815               | 41.468               |
| NIW je Anteil                         | € 8,76               | € 8,73               | € 8,66               |

|                                                     | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| <b>Euro Income Bond Fund (Forts.)</b>               |                      |                      |                      |
| Class T:                                            |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 56.643             | € 43.963             | € 30.390             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 5.132                | 4.074                | 2.946                |
| NIW je Anteil                                       | € 11,04              | € 10,79              | € 10,32              |
| Erträge                                             | € 19.365             | € 17.085             | € 12.385             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 2.519                | 2.227                | 1.620                |
| NIW je Anteil                                       | € 7,69               | € 7,67               | € 7,64               |
| <b>Euro Long Average Duration Fund</b>              |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                                       | € 1.212.557          | € 1.188.893          | € 923.969            |
| Institutional:                                      |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 1.211.209          | € 1.187.154          | € 923.958            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 63.468               | 59.552               | 44.105               |
| NIW je Anteil                                       | € 19,08              | € 19,93              | € 20,95              |
| Class E:                                            |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 1.348              | € 1.739              | € 11                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 132                  | 163                  | 1                    |
| NIW je Anteil                                       | € 10,19              | € 10,69              | € 11,33              |
| <b>Euro Short-Term Fund</b>                         |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                                       | € 358.744            | € 265.893            | € 193.514            |
| Institutional:                                      |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 238.685            | € 171.411            | € 165.347            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 18.254               | 13.309               | 13.404               |
| NIW je Anteil                                       | € 13,08              | € 12,88              | € 12,34              |
| Investor:                                           |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 5.443              | € 4.337              | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 526                  | 425                  | k. A.                |
| NIW je Anteil                                       | € 10,34              | € 10,20              | k. A.                |
| Class E:                                            |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 114.616            | € 90.145             | € 28.167             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 10.125               | 8.055                | 2.608                |
| NIW je Anteil                                       | € 11,32              | € 11,19              | € 10,80              |
| <b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>          |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                                       | € 467.533            | € 383.525            | € 367.767            |
| Institutional:                                      |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 277.531            | € 215.760            | € 219.781            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 22.589               | 18.136               | 19.847               |
| NIW je Anteil                                       | € 12,29              | € 11,90              | € 11,07              |
| Class E:                                            |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 18.641             | € 12.225             | € 4.061              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 1.510                | 1.018                | 360                  |
| NIW je Anteil                                       | € 12,34              | € 12,01              | € 11,28              |
| Erträge                                             | € 139                | € 78                 | € 10                 |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 13                   | 7                    | 1                    |
| NIW je Anteil                                       | € 10,86              | € 10,79              | € 10,61              |
| Class Z:                                            |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 171.222            | € 155.462            | € 143.915            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 13.536               | 12.727               | 12.727               |
| NIW je Anteil                                       | € 12,65              | € 12,22              | € 11,31              |
| <b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b> |                      |                      |                      |
| Nettovermögen                                       | € 1.028.144          | € 955.095            | € 130.610            |
| Institutional:                                      |                      |                      |                      |
| thesaurierend                                       | € 958.011            | € 897.651            | € 67.680             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile               | 77.437               | 74.419               | 5.907                |
| NIW je Anteil                                       | € 12,37              | € 12,06              | € 11,46              |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                          |     | Zum<br>30. Jun. 2025                                     |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum 31. Dez. 2023 |  |
|------------------------------------------|-----|----------------------------------------------------------|-----|----------------------|-----|-------------------|--|
|                                          |     | PIMCO European Short-Term<br>Opportunities Fund (Forts.) |     |                      |     |                   |  |
| Class E:                                 |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | €   | 15.170                                                   | €   | 12.790               | €   | 11.471            |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 1.451                                                    |     | 1.250                |     | 1.175             |  |
| NIW je Anteil                            | €   | 10,45                                                    | €   | 10,23                | €   | 9,77              |  |
| H Institutional:                         |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | €   | 54.963                                                   | €   | 44.654               | €   | 51.459            |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 5.139                                                    |     | 4.278                |     | 5.184             |  |
| NIW je Anteil                            | €   | 10,69                                                    | €   | 10,44                | €   | 9,93              |  |
|                                          |     | Global Advantage Fund                                    |     |                      |     |                   |  |
| Nettovermögen                            | \$  | 440.884                                                  | \$  | 404.337              | \$  | 432.290           |  |
| Institutional:                           |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | \$  | 9.293                                                    | \$  | 7.549                | \$  | 7.698             |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 601                                                      |     | 530                  |     | 540               |  |
| NIW je Anteil                            | \$  | 15,47                                                    | \$  | 14,25                | \$  | 14,26             |  |
| Institutional CHF (Partially<br>Hedged): |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| Erträge                                  | CHF | 75.956                                                   | CHF | 107.327              | CHF | 108.735           |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 8.996                                                    |     | 12.443               |     | 12.443            |  |
| NIW je Anteil                            | CHF | 8,44                                                     | CHF | 8,63                 | CHF | 8,74              |  |
| Institutional EUR (Partially<br>Hedged): |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | €   | 224.910                                                  | €   | 207.312              | €   | 206.079           |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 15.940                                                   |     | 14.783               |     | 15.268            |  |
| NIW je Anteil                            | €   | 14,11                                                    | €   | 14,02                | €   | 13,50             |  |
| Institutional NOK (Partially<br>Hedged): |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | NOK | 669.376                                                  | NOK | 658.128              | NOK | 620.678           |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 4.115                                                    |     | 4.112                |     | 4.106             |  |
| NIW je Anteil                            | NOK | 162,68                                                   | NOK | 160,06               | NOK | 151,18            |  |
| Class E EUR (Partially<br>Hedged):       |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | €   | 5.121                                                    | €   | 5.542                | €   | 6.009             |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 421                                                      |     | 456                  |     | 509               |  |
| NIW je Anteil                            | €   | 12,16                                                    | €   | 12,14                | €   | 11,80             |  |
|                                          |     | Global Bond Fund                                         |     |                      |     |                   |  |
| Nettovermögen                            | \$  | 16.939.308                                               | \$  | 15.803.937           | \$  | 13.077.262        |  |
| Institutional:                           |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | \$  | 7.249.468                                                | \$  | 7.494.424            | \$  | 4.616.460         |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 196.705                                                  |     | 210.411              |     | 134.931           |  |
| NIW je Anteil                            | \$  | 36,85                                                    | \$  | 35,62                | \$  | 34,21             |  |
| Erträge                                  | \$  | 386.186                                                  | \$  | 279.660              | \$  | 210.566           |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 20.599                                                   |     | 15.127               |     | 11.420            |  |
| NIW je Anteil                            | \$  | 18,75                                                    | \$  | 18,49                | \$  | 18,44             |  |
| Institutional (Currency<br>Exposure):    |     |                                                          |     |                      |     |                   |  |
| thesaurierend                            | \$  | 875.038                                                  | \$  | 443.063              | \$  | 307.999           |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 26.322                                                   |     | 14.400               |     | 9.940             |  |
| NIW je Anteil                            | \$  | 33,24                                                    | \$  | 30,77                | \$  | 30,99             |  |
| Erträge                                  | \$  | 19.065                                                   | \$  | 18.092               | \$  | 19.480            |  |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile |     | 977                                                      |     | 982                  |     | 1.011             |  |
| NIW je Anteil                            | \$  | 19,51                                                    | \$  | 18,42                | \$  | 19,27             |  |

|                                                            | Zum<br>30. Jun. 2025      |           | Zum<br>31. Dez. 2024 |           | Zum 31. Dez. 2023 |           |
|------------------------------------------------------------|---------------------------|-----------|----------------------|-----------|-------------------|-----------|
|                                                            | Global Bond Fund (Forts.) |           |                      |           |                   |           |
| Institutional AUD (Hedged):<br>thesaurierend               | AUD                       | 75.791    | AUD                  | 48.080    | k. A.             |           |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 7.085     |                      | 4.648     | k. A.             |           |
| NIW je Anteil                                              | AUD                       | 10,70     | AUD                  | 10,34     | k. A.             |           |
| Institutional CAD (Hedged):<br>thesaurierend               | CAD                       | 53.701    | CAD                  | 46.576    | CAD               | 50.875    |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 4.680     |                      | 4.168     | 4.696             |           |
| NIW je Anteil                                              | CAD                       | 11,48     | CAD                  | 11,18     | CAD               | 10,83     |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend               | CHF                       | 405.537   | CHF                  | 375.487   | CHF               | 365.291   |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 12.935    |                      | 12.143    | 11.784            |           |
| NIW je Anteil                                              | CHF                       | 31,35     | CHF                  | 30,92     | CHF               | 31,00     |
| Erträge                                                    | CHF                       | 92.871    | CHF                  | 134.921   | CHF               | 142.984   |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 5.513     |                      | 7.962     | 8.104             |           |
| NIW je Anteil                                              | CHF                       | 16,84     | CHF                  | 16,95     | CHF               | 17,64     |
| Institutional EUR (Currency<br>Exposure):<br>thesaurierend | €                         | 132.756   | €                    | 179.536   | €                 | 191.275   |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 9.906     |                      | 12.770    | 14.411            |           |
| NIW je Anteil                                              | €                         | 13,40     | €                    | 14,06     | €                 | 13,27     |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend               | €                         | 1.797.583 | €                    | 1.895.699 | €                 | 1.986.158 |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 64.263    |                      | 69.491    | 74.563            |           |
| NIW je Anteil                                              | €                         | 27,97     | €                    | 27,28     | €                 | 26,64     |
| Erträge                                                    | €                         | 308.629   | €                    | 305.250   | €                 | 597.513   |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 18.982    |                      | 18.877    | 36.436            |           |
| NIW je Anteil                                              | €                         | 16,26     | €                    | 16,17     | €                 | 16,40     |
| Institutional GBP (Currency<br>Exposure):<br>thesaurierend | £                         | 2.543     | £                    | 2.572     | £                 | 2.186     |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 237       |                      | 236       | 203               |           |
| NIW je Anteil                                              | £                         | 10,74     | £                    | 10,88     | £                 | 10,76     |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend               | £                         | 193.687   | £                    | 246.287   | £                 | 189.318   |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 8.132     |                      | 10.706    | 8.545             |           |
| NIW je Anteil                                              | £                         | 23,82     | £                    | 23,00     | £                 | 22,16     |
| Erträge                                                    | £                         | 111.973   | £                    | 120.734   | £                 | 117.923   |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 8.746     |                      | 9.560     | 9.288             |           |
| NIW je Anteil                                              | £                         | 12,80     | £                    | 12,63     | £                 | 12,70     |
| Institutional NOK (Hedged):<br>thesaurierend               | NOK                       | 2.385.945 | NOK                  | 2.452.611 | NOK               | 2.483.411 |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 10.265    |                      | 10.933    | 11.421            |           |
| NIW je Anteil                                              | NOK                       | 232,42    | NOK                  | 224,34    | NOK               | 217,44    |
| Institutional NZD (Hedged):<br>Erträge                     | NZD                       | 96.941    | NZD                  | 95.661    | NZD               | 148.154   |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 2.256     |                      | 2.253     | 3.487             |           |
| NIW je Anteil                                              | NZD                       | 42,96     | NZD                  | 42,47     | NZD               | 42,48     |
| Institutional RMB<br>(Unhedged):<br>Erträge                | CNH                       | 75        | CNH                  | 74        | k. A.             |           |
| ausgegebene und<br>umlaufende<br>Anteile                   |                           | 1         |                      | 1         | k. A.             |           |
| NIW je Anteil                                              | CNH                       | 101,99    | CNH                  | 103,32    | k. A.             |           |

|                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025      | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------|-----|---------------------------|----------------------|----------------------|
|                              |     | Global Bond Fund (Forts.) |                      |                      |
| Institutional SEK (Hedged):  |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | SEK | 404.564                   | SEK 441.453          | SEK 458.269          |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 1.865                     | 2.085                | 2.212                |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | SEK | 216,94                    | SEK 211,74           | SEK 207,22           |
| Institutional SGD (Hedged):  |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | SGD | 979.912                   | SGD 882.913          | SGD 229.722          |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 51.224                    | 47.347               | 12.592               |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | SGD | 19,13                     | SGD 18,65            | SGD 18,24            |
| Erträge                      | SGD | 134                       | SGD 143              | SGD 115              |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 13                        | 14                   | 11                   |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | SGD | 10,23                     | SGD 10,17            | SGD 10,33            |
| Investor:                    |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | \$  | 170.577                   | \$ 223.988           | \$ 201.431           |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 5.071                     | 6.878                | 6.417                |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | \$  | 33,64                     | \$ 32,57             | \$ 31,39             |
| Erträge                      | \$  | 39.754                    | \$ 61.677            | \$ 54.670            |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 2.524                     | 3.971                | 3.529                |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | \$  | 15,75                     | \$ 15,53             | \$ 15,49             |
| Investor CHF (Hedged):       |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | CHF | 91.025                    | CHF 97.065           | CHF 125.907          |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 7.613                     | 8.217                | 10.594               |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | CHF | 11,96                     | CHF 11,81            | CHF 11,88            |
| Investor EUR (Hedged):       |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | €   | 85.905                    | € 87.352             | € 84.542             |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 3.300                     | 3.435                | 3.393                |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | €   | 26,03                     | € 25,43              | € 24,92              |
| Investor GBP (Hedged):       |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | £   | 9.230                     | £ 9.062              | £ 6.747              |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 416                       | 422                  | 325                  |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | £   | 22,21                     | £ 21,49              | £ 20,77              |
| Investor NOK (Hedged):       |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | NOK | 52.979                    | NOK 56.086           | NOK 62.521           |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 244                       | 267                  | 306                  |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | NOK | 217,42                    | NOK 210,22           | NOK 204,47           |
| Administrative:              |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | \$  | 21.856                    | \$ 14.351            | \$ 13.375            |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 671                       | 455                  | 439                  |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | \$  | 32,59                     | \$ 31,57             | \$ 30,48             |
| Administrative SEK (Hedged): |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | SEK | 44.948                    | SEK 60.541           | SEK 124.505          |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 478                       | 658                  | 1.376                |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | SEK | 94,02                     | SEK 91,99            | SEK 90,48            |
| Class E:                     |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | \$  | 367.473                   | \$ 376.135           | \$ 369.607           |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 11.877                    | 12.523               | 12.696               |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | \$  | 30,94                     | \$ 30,04             | \$ 29,11             |
| Erträge                      | \$  | 132.534                   | \$ 144.043           | \$ 143.056           |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 9.788                     | 10.788               | 10.742               |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | \$  | 13,54                     | \$ 13,35             | \$ 13,32             |
| Class E (Currency Exposure): |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | \$  | 35.613                    | \$ 35.147            | \$ 38.405            |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 2.742                     | 2.911                | 3.130                |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | \$  | 12,99                     | \$ 12,07             | \$ 12,27             |
| Erträge                      | \$  | 17.343                    | \$ 17.691            | \$ 19.849            |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 1.661                     | 1.794                | 1.925                |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | \$  | 10,44                     | \$ 9,86              | \$ 10,31             |
| Class E CHF (Hedged):        |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | CHF | 2.292                     | CHF 2.435            | CHF 2.398            |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 251                       | 269                  | 262                  |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | CHF | 9,12                      | CHF 9,04             | CHF 9,14             |
| Class E EUR (Hedged):        |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                | €   | 584.990                   | € 637.289            | € 698.781            |
| ausgegebene und umlaufende   |     | 24.903                    | 27.695               | 30.821               |
| Anteile                      |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                | €   | 23,49                     | € 23,01              | € 22,67              |

|                                      |     | Zum<br>30. Jun. 2025      | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|--------------------------------------|-----|---------------------------|----------------------|----------------------|
|                                      |     | Global Bond Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                              | €   | 39.005                    | € 38.813             | € 40.788             |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 4.371                     | 4.373                | 4.531                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | €   | 8,92                      | € 8,88               | € 9,00               |
| G Retail EUR (Hedged):               |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | €   | 90.189                    | € 94.897             | € 68.720             |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 9.874                     | 10.606               | 7.568                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | €   | 9,13                      | € 8,95               | € 9,08               |
| H Institutional:                     |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$  | 783.087                   | \$ 687.222           | \$ 743.816           |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 22.069                    | 20.022               | 22.522               |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 35,48                     | \$ 34,32             | \$ 33,03             |
| Erträge                              | \$  | 1.951                     | \$ 1.974             | \$ 2.227             |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 206                       | 212                  | 239                  |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 9,46                      | \$ 9,33              | \$ 9,30              |
| H Institutional (Currency Exposure): |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$  | 398.018                   | \$ 22.113            | \$ 150.642           |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 42.659                    | 2.558                | 17.281               |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 9,33                      | \$ 8,64              | \$ 8,72              |
| M Retail:                            |     |                           |                      |                      |
| ausschüttend II                      | \$  | 717                       | \$ 838               | \$ 854               |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 78                        | 91                   | 92                   |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 9,23                      | \$ 9,16              | \$ 9,27              |
| M Retail HKD (Unhedged):             |     |                           |                      |                      |
| ausschüttend II                      | HKD | 16.136                    | HKD 18.218           | HKD 18.703           |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 1.736                     | 1.994                | 2.013                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | HKD | 9,30                      | HKD 9,13             | HKD 9,29             |
| M Retail SGD (Hedged):               |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | SGD | 41.762                    | SGD 33.083           | SGD 13.975           |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 4.223                     | 3.341                | 1.370                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | SGD | 9,89                      | SGD 9,90             | SGD 10,20            |
| Class R EUR (Hedged):                |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | €   | 6.179                     | € 6.875              | € 6.081              |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 531                       | 605                  | 547                  |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | €   | 11,63                     | € 11,36              | € 11,12              |
| Class T:                             |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$  | 15.740                    | \$ 16.840            | \$ 17.137            |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 1.312                     | 1.444                | 1.511                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 12,00                     | \$ 11,67             | \$ 11,34             |
| Erträge                              | \$  | 4.971                     | \$ 5.021             | \$ 5.367             |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 461                       | 472                  | 506                  |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 10,79                     | \$ 10,64             | \$ 10,61             |
| Class T EUR (Hedged):                |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | €   | 23.829                    | € 24.726             | € 24.878             |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 2.383                     | 2.520                | 2.566                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | €   | 10,00                     | € 9,81               | € 9,70               |
| W Class:                             |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$  | 134.623                   | \$ 145.178           | \$ 118.273           |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 12.869                    | 14.367               | 12.197               |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 10,46                     | \$ 10,10             | \$ 9,70              |
| Erträge                              | \$  | 58.866                    | \$ 60.726            | \$ 54.179            |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 6.372                     | 6.666                | 5.964                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 9,24                      | \$ 9,11              | \$ 9,08              |
| ausschüttend II                      | \$  | 7.204                     | \$ 3.246             | \$ 529               |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 682                       | 311                  | 51                   |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | \$  | 10,56                     | \$ 10,43             | \$ 10,43             |
| W Class CHF (Hedged):                |     |                           |                      |                      |
| thesaurierend                        | CHF | 38.081                    | CHF 37.669           | CHF 32.887           |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 4.220                     | 4.234                | 3.691                |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | CHF | 9,02                      | CHF 8,90             | CHF 8,91             |
| Erträge                              | CHF | 7.792                     | CHF 7.574            | CHF 4.389            |
| ausgegebene und umlaufende           |     | 978                       | 945                  | 526                  |
| Anteile                              |     |                           |                      |                      |
| NIW je Anteil                        | CHF | 7,97                      | CHF 8,01             | CHF 8,34             |



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                           |     | Zum<br>30. Jun. 2025 |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-------------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|
| Global Bond Fund (Forts.)                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| W Class EUR (Hedged):                     |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                             | €   | 64.159               | €   | 55.338               | €   | 23.248               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 6.651                |     | 5.886                |     | 2.535                |
| NIW je Anteil                             | €   | 9,65                 | €   | 9,40                 | €   | 9,17                 |
| Erträge                                   | €   | 4.232                | €   | 5.564                | €   | 4.237                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 496                  |     | 656                  |     | 493                  |
| NIW je Anteil                             | €   | 8,52                 | €   | 8,48                 | €   | 8,59                 |
| W Class GBP (Hedged):                     |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                             | £   | 23.088               | £   | 16.645               | £   | 16.595               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 2.251                |     | 1.682                |     | 1.743                |
| NIW je Anteil                             | £   | 10,25                | £   | 9,90                 | £   | 9,52                 |
| Erträge                                   | £   | 12.285               | £   | 11.968               | £   | 8.538                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 1.356                |     | 1.341                |     | 957                  |
| NIW je Anteil                             | £   | 9,06                 | £   | 8,92                 | £   | 8,92                 |
| W Class NOK (Hedged):                     |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                             | NOK | 9.723                | NOK | 9.482                | NOK | 11.384               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 97                   |     | 98                   |     | 122                  |
| NIW je Anteil                             | NOK | 100,29               | NOK | 96,75                | NOK | 93,68                |
| W Class SGD (Hedged):                     |     |                      |     |                      |     |                      |
| ausschüttend II                           | SGD | 13.389               | SGD | 17.871               | SGD | 10.799               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 1.320                |     | 1.769                |     | 1.049                |
| NIW je Anteil                             | SGD | 10,14                | SGD | 10,10                | SGD | 10,30                |
| Nettovermögen                             | \$  | 4.080.338            | \$  | 3.964.473            | \$  | 3.561.180            |
| Institutional:                            |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                             | \$  | 356.277              | \$  | 579.646              | \$  | 365.875              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 29.199               |     | 49.098               |     | 32.142               |
| NIW je Anteil                             | \$  | 12,20                | \$  | 11,81                | \$  | 11,38                |
| Erträge                                   | \$  | 43.027               | \$  | 40.771               | \$  | 47.502               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 4.416                |     | 4.245                |     | 4.956                |
| NIW je Anteil                             | \$  | 9,74                 | \$  | 9,60                 | \$  | 9,58                 |
| Institutional AUD (Hedged):               |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                             | AUD | 24.604               |     | k. A.                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 2.384                |     | k. A.                |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                             | AUD | 10,32                |     | k. A.                |     | k. A.                |
| Institutional CHF (Hedged):               |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                             | CHF | 820.694              | CHF | 735.914              | CHF | 599.209              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 86.337               |     | 78.387               |     | 63.416               |
| NIW je Anteil                             | CHF | 9,51                 | CHF | 9,39                 | CHF | 9,45                 |
| Institutional EUR (Hedged):               |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                             | €   | 1.015.181            | €   | 978.456              | €   | 928.944              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 98.315               |     | 97.074               |     | 94.043               |
| NIW je Anteil                             | €   | 10,33                | €   | 10,08                | €   | 9,88                 |
| Erträge                                   | €   | 38.685               | €   | 41.698               | €   | 47.447               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 4.379                |     | 4.749                |     | 5.326                |
| NIW je Anteil                             | €   | 8,83                 | €   | 8,78                 | €   | 8,91                 |
| Institutional GBP (Currency<br>Exposure): |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                                   | £   | 7.430                | £   | 24.153               | £   | 686                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile     |     | 845                  |     | 2.637                |     | 73                   |
| NIW je Anteil                             | £   | 8,80                 | £   | 9,16                 | £   | 9,38                 |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025 |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|
| Global Bond ESG Fund (Forts.)         |     |                      |     |                      |     |                      |
| Institutional GBP (Hedged):           |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | £   | 20.964               | £   | 161.745              | £   | 101.214              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.033                |     | 16.225               |     | 10.501               |
| NIW je Anteil                         | £   | 10,31                | £   | 9,97                 | £   | 9,64                 |
| Erträge                               | £   | 91.466               | £   | 112.981              | £   | 79.564               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 9.552                |     | 11.983               |     | 8.333                |
| NIW je Anteil                         | £   | 9,58                 | £   | 9,43                 | £   | 9,55                 |
| Institutional GBP (Unhedged):         |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | £   | 7.369                | £   | 9.484                | £   | 8.646                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 850                  |     | 1.013                |     | 928                  |
| NIW je Anteil                         | £   | 8,67                 | £   | 9,36                 | £   | 9,31                 |
| Institutional NOK (Hedged):           |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | NOK | 7.139.930            | NOK | 6.806.984            | NOK | 6.352.155            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 629.607              |     | 621.090              |     | 595.694              |
| NIW je Anteil                         | NOK | 11,34                | NOK | 10,96                | NOK | 10,66                |
| Institutional NZD (Hedged):           |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | NZD | 62.233               | NZD | 60.358               | NZD | 70.237               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6.121                |     | 6.010                |     | 6.984                |
| NIW je Anteil                         | NZD | 10,17                | NZD | 10,04                | NZD | 10,06                |
| Institutional SEK (Hedged):           |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | SEK | 498.275              | SEK | 425.576              | SEK | 357.538              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 5.229                |     | 4.570                |     | 3.909                |
| NIW je Anteil                         | SEK | 95,28                | SEK | 93,12                | SEK | 91,47                |
| Investor:                             |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 5.517                | \$  | 5.562                | \$  | 12.932               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 478                  |     | 497                  |     | 1.195                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 11,54                | \$  | 11,19                | \$  | 10,82                |
| Administrative SEK (Hedged):          |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | SEK | 147.609              | SEK | 165.604              | SEK | 89.882               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.384                |     | 1.585                |     | 871                  |
| NIW je Anteil                         | SEK | 106,65               | SEK | 104,48               | SEK | 103,14               |
| Class E:                              |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | \$  | 4.505                | \$  | 4.197                | \$  | 4.640                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 446                  |     | 421                  |     | 467                  |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,10                | \$  | 9,96                 | \$  | 9,94                 |
| Class E CHF (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | CHF | 3.763                | CHF | 3.533                | CHF | 1.699                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 385                  |     | 364                  |     | 172                  |
| NIW je Anteil                         | CHF | 9,79                 | CHF | 9,71                 | CHF | 9,86                 |
| Class E EUR (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | €   | 35.938               | €   | 38.281               | €   | 41.956               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 3.747                |     | 4.070                |     | 4.512                |
| NIW je Anteil                         | €   | 9,59                 | €   | 9,40                 | €   | 9,30                 |
| Class Z AUD (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | AUD | 540.822              | AUD | 564.460              | AUD | 490.444              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 54.596               |     | 57.806               |     | 49.785               |
| NIW je Anteil                         | AUD | 9,91                 | AUD | 9,76                 | AUD | 9,85                 |
| Nettovermögen                         | \$  | 944.405              | \$  | 1.096.286            | \$  | 800.126              |
| Institutional:                        |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 555.820              | \$  | 587.687              | \$  | 461.455              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 20.977               |     | 22.704               |     | 18.846               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 26,50                | \$  | 25,89                | \$  | 24,49                |

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025            | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------------|-----|---------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                              |     | Global Bond Ex-US Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                      | \$  | 85.814 \$                       | 71.993 \$            | 38.610               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 5.276                           | 4.442                | 2.428                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 16,26 \$                        | 16,21 \$             | 15,90                |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 24.097 €                        | 22.739 €             | 22.817               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.330                           | 1.273                | 1.329                |
| NIW je Anteil                                | €   | 18,11 €                         | 17,86 €              | 17,16                |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$  | 6.552 \$                        | 6.424 \$             | 6.785                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 265                             | 265                  | 295                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 24,75 \$                        | 24,22 \$             | 22,99                |
| Administrative:<br>thesaurierend             | \$  | 10.900 \$                       | 10.660 \$            | 10.238               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 456                             | 456                  | 460                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 23,88 \$                        | 23,39 \$             | 22,23                |
| Class E:<br>Erträge                          | \$  | 17.748 \$                       | 40.100 \$            | 42.176               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.124                           | 2.548                | 2.731                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 15,80 \$                        | 15,74 \$             | 15,44                |
| Class E (Currency Exposure):<br>Erträge      | \$  | 8.258 \$                        | 30.683 \$            | 54.158               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 970                             | 3.914                | 6.463                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 8,51 \$                         | 7,84 \$              | 8,38                 |
| H Institutional:<br>thesaurierend            | \$  | 105.414 \$                      | 133.385 \$           | 46.259               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 8.881                           | 11.495               | 4.207                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 11,87 \$                        | 11,60 \$             | 11,00                |
| Class Z:<br>thesaurierend                    | \$  | 125.613 \$                      | 191.808 \$           | 115.239              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 10.957                          | 17.167               | 10.957               |
| NIW je Anteil                                | \$  | 11,46 \$                        | 11,17 \$             | 10,52                |
| Nettovermögen                                | \$  | 2.885.126 \$                    | 2.868.819 \$         | 2.980.250            |
| Institutional:<br>thesaurierend              | \$  | 585.364 \$                      | 614.526 \$           | 633.820              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 17.927                          | 19.485               | 21.624               |
| NIW je Anteil                                | \$  | 32,65 \$                        | 31,54 \$             | 29,31                |
| Erträge                                      | \$  | 116.468 \$                      | 250.283 \$           | 298.704              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 10.876                          | 23.503               | 28.490               |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,71 \$                        | 10,65 \$             | 10,48                |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend | CHF | 28.779 CHF                      | 28.390 CHF           | 24.625               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.594                           | 1.596                | 1.428                |
| NIW je Anteil                                | CHF | 18,05 CHF                       | 17,79 CHF            | 17,24                |
| Erträge                                      | CHF | 3.958 CHF                       | 4.994 CHF            | 3.467                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 540                             | 672                  | 454                  |
| NIW je Anteil                                | CHF | 7,33 CHF                        | 7,43 CHF             | 7,64                 |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 510.872 €                       | 547.812 €            | 698.966              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 19.134                          | 21.055               | 28.447               |
| NIW je Anteil                                | €   | 26,70 €                         | 26,02 €              | 24,57                |

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025                 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------------|-----|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                              |     | Global High Yield Bond Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                      | €   | 207.660 €                            | 226.032 €            | 136.798              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 20.265                               | 22.005               | 13.305               |
| NIW je Anteil                                | €   | 10,25 €                              | 10,27 €              | 10,28                |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £   | 87.358 £                             | 61.412 £             | 45.376               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 4.762                                | 3.466                | 2.749                |
| NIW je Anteil                                | £   | 18,35 £                              | 17,72 £              | 16,51                |
| Erträge                                      | £   | 301.374 £                            | 255.038 £            | 215.523              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 56.580                               | 48.078               | 41.123               |
| NIW je Anteil                                | £   | 5,33 £                               | 5,30 £               | 5,24                 |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$  | 4.325 \$                             | 4.005 \$             | 2.146                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 284                                  | 272                  | 156                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 15,22 \$                             | 14,73 \$             | 13,73                |
| Erträge                                      | \$  | 12 \$                                | 12 \$                | 11                   |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1                                    | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,95 \$                             | 10,89 \$             | 10,72                |
| Investor EUR (Hedged):<br>thesaurierend      | €   | 2.335 €                              | 2.296 €              | 5.450                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 92                                   | 93                   | 232                  |
| NIW je Anteil                                | €   | 25,37 €                              | 24,77 €              | 23,47                |
| Administrative:<br>thesaurierend             | \$  | 27.263 \$                            | 26.904 \$            | 22.199               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 908                                  | 925                  | 818                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 30,02 \$                             | 29,07 \$             | 27,15                |
| Erträge                                      | \$  | 15.457 \$                            | 16.643 \$            | 16.634               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.475                                | 1.597                | 1.621                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,48 \$                             | 10,42 \$             | 10,26                |
| BM Retail:<br>ausschüttend II                | \$  | 28.573 \$                            | 27.706 \$            | 3.173                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.961                                | 2.856                | 324                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 9,65 \$                              | 9,70 \$              | 9,78                 |
| Class E:<br>thesaurierend                    | \$  | 133.056 \$                           | 137.990 \$           | 123.931              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 4.824                                | 5.158                | 4.939                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 27,58 \$                             | 26,76 \$             | 25,09                |
| Erträge                                      | \$  | 69.394 \$                            | 71.937 \$            | 96.084               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 6.577                                | 6.857                | 9.302                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,55 \$                             | 10,49 \$             | 10,33                |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €   | 192.070 €                            | 205.795 €            | 224.500              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 7.582                                | 8.299                | 9.501                |
| NIW je Anteil                                | €   | 25,33 €                              | 24,80 €              | 23,63                |
| Erträge                                      | €   | 23.153 €                             | 24.418 €             | 27.762               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.764                                | 2.908                | 3.303                |
| NIW je Anteil                                | €   | 8,38 €                               | 8,40 €               | 8,40                 |
| Class E GBP (Hedged):<br>Erträge             | £   | 1.947 £                              | 3.422 £              | 3.519                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 173                                  | 305                  | 318                  |
| NIW je Anteil                                | £   | 11,28 £                              | 11,20 £              | 11,06                |
| Class E SGD (Hedged):<br>Erträge             | SGD | 22.188 SGD                           | 14.356 SGD           | 8.215                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.348                                | 1.516                | 865                  |
| NIW je Anteil                                | SGD | 9,45 SGD                             | 9,47 SGD             | 9,50                 |
| H Institutional:<br>thesaurierend            | \$  | 121.339 \$                           | 141.380 \$           | 128.939              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 3.883                                | 4.681                | 4.586                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 31,25 \$                             | 30,20 \$             | 28,12                |
| Erträge                                      | \$  | 15.664 \$                            | 10.288 \$            | 7.523                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.650                                | 1.090                | 809                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 9,49 \$                              | 9,44 \$              | 9,29                 |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025                    | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                       | Global High Yield Bond<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| M Retail:                             |                                         |                      |                      |
| Erträge                               | \$ 16.049                               | \$ 16.073            | \$ 16.994            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1.542                                   | 1.553                | 1.667                |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,41                                | \$ 10,35             | \$ 10,20             |
| ausschüttend II                       | \$ 48.730                               | \$ 49.841            | \$ 34.630            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 6.014                                   | 6.144                | 4.268                |
| NIW je Anteil                         | \$ 8,10                                 | \$ 8,11              | \$ 8,11              |
| Class R:                              |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 2.109                                | \$ 2.126             | \$ 2.439             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 118                                     | 123                  | 152                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 17,83                                | \$ 17,24             | \$ 16,06             |
| Class T:                              |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 6.839                                | \$ 7.201             | \$ 5.769             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 470                                     | 509                  | 433                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 14,54                                | \$ 14,13             | \$ 13,31             |
| Erträge                               | \$ 1.741                                | \$ 1.857             | \$ 2.662             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 177                                     | 190                  | 277                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 9,83                                 | \$ 9,77              | \$ 9,62              |
|                                       | Global High Yield Bond ESG Fund         |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$ 10.964                               | \$ 10.456            | k. A.                |
| Institutional:                        |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 10.014                               | \$ 9.653             | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 921                                     | 921                  | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,87                                | \$ 10,48             | k. A.                |
| Institutional EUR (Hedged):           |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 249                                   | € 242                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 23                                      | 23                   | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | € 10,68                                 | € 10,38              | k. A.                |
| Institutional GBP (Hedged):           |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | £ 216                                   | £ 208                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 20                                      | 20                   | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | £ 10,86                                 | £ 10,47              | k. A.                |
| Institutional SEK (Hedged):           |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | SEK 2.848                               | SEK 2.773            | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 27                                      | 27                   | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | SEK 105,98                              | SEK 103,21           | k. A.                |
| Class E:                              |                                         |                      |                      |
| Erträge                               | \$ 11                                   | \$ 10                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                                       | 1                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,24                                | \$ 10,17             | k. A.                |
| Class E EUR (Hedged):                 |                                         |                      |                      |
| Erträge                               | € 25                                    | € 10                 | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 2                                       | 1                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | € 10,06                                 | € 10,07              | k. A.                |
| Class E GBP (Hedged):                 |                                         |                      |                      |
| Erträge                               | £ 9                                     | £ 8                  | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                                       | 1                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | £ 10,24                                 | £ 10,15              | k. A.                |
| Class Z:                              |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 11                                   | \$ 11                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1                                       | 1                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,94                                | \$ 10,51             | k. A.                |
|                                       | Global Investment Grade Credit Fund     |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$ 8.326.698                            | \$ 8.618.950         | \$ 10.713.722        |
| Institutional:                        |                                         |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 1.932.812                            | \$ 2.085.815         | \$ 3.012.636         |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 87.610                                  | 98.150               | 148.124              |
| NIW je Anteil                         | \$ 22,06                                | \$ 21,25             | \$ 20,34             |
| Erträge                               | \$ 476.265                              | \$ 526.458           | \$ 587.774           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 41.187                                  | 46.279               | 51.901               |
| NIW je Anteil                         | \$ 11,56                                | \$ 11,38             | \$ 11,32             |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025                            | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                       | Global Investment Grade Credit<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Institutional (Currency Exposure):    |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 139.783                                      | \$ 123.221           | \$ 117.937           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 8.550                                           | 8.131                | 7.912                |
| NIW je Anteil                         | \$ 16,35                                        | \$ 15,16             | \$ 14,91             |
| Erträge                               | \$ 12.753                                       | \$ 12.177            | \$ 19.023            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1.468                                           | 1.481                | 2.261                |
| NIW je Anteil                         | \$ 8,69                                         | \$ 8,22              | \$ 8,41              |
| Institutional AUD (Hedged):           |                                                 |                      |                      |
| Erträge                               | AUD 3.226                                       | AUD 3.480            | AUD 6.260            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 360                                             | 395                  | 705                  |
| NIW je Anteil                         | AUD 8,96                                        | AUD 8,81             | AUD 8,87             |
| Institutional CHF (Hedged):           |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                         | CHF 387.246                                     | CHF 467.528          | CHF 529.814          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 24.601                                          | 30.208               | 34.237               |
| NIW je Anteil                         | CHF 15,74                                       | CHF 15,48            | CHF 15,47            |
| Erträge                               | CHF 27.920                                      | CHF 28.641           | CHF 31.431           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 4.031                                           | 4.120                | 4.344                |
| NIW je Anteil                         | CHF 6,93                                        | CHF 6,95             | CHF 7,24             |
| Institutional CZK (Hedged):           |                                                 |                      |                      |
| Erträge                               | CZK 188.930                                     | CZK 186.294          | CZK 195.936          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 21.305                                          | 21.305               | 22.425               |
| NIW je Anteil                         | CZK 8,87                                        | CZK 8,74             | CZK 8,74             |
| Institutional EUR                     |                                                 |                      |                      |
| (Currency Exposure):                  |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 53.751                                        | € 53.067             | € 47.238             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 3.860                                           | 3.626                | 3.501                |
| NIW je Anteil                         | € 13,93                                         | € 14,64              | € 13,49              |
| Institutional EUR (Hedged):           |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 770.170                                       | € 886.073            | € 1.004.207          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 40.578                                          | 48.038               | 55.930               |
| NIW je Anteil                         | € 18,98                                         | € 18,45              | € 17,95              |
| Erträge                               | € 337.522                                       | € 345.966            | € 365.512            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 34.864                                          | 36.026               | 37.572               |
| NIW je Anteil                         | € 9,68                                          | € 9,60               | € 9,73               |
| Institutional GBP (Hedged):           |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                         | £ 94.274                                        | £ 120.135            | £ 125.032            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 4.295                                           | 5.686                | 6.164                |
| NIW je Anteil                         | £ 21,95                                         | £ 21,13              | £ 20,29              |
| Erträge                               | £ 422.582                                       | £ 580.490            | £ 637.646            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 36.170                                          | 50.498               | 55.185               |
| NIW je Anteil                         | £ 11,68                                         | £ 11,50              | £ 11,55              |
| Institutional HKD (Unhedged):         |                                                 |                      |                      |
| Erträge                               | HKD 84.367                                      | HKD 82.078           | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 8.197                                           | 8.191                | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | HKD 10,29                                       | HKD 10,02            | k. A.                |
| Institutional NOK (Hedged):           |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                         | NOK 302.865                                     | NOK 292.087          | NOK 287.785          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile | 1.965                                           | 1.970                | 2.009                |
| NIW je Anteil                         | NOK 154,10                                      | NOK 148,24           | NOK 143,24           |

|                                               |     | Zum<br>30. Jun. 2025                            | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------------------------|-----|-------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                               |     | Global Investment Grade Credit<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Institutional SEK (Hedged):<br>thesaurierend  | SEK | 2.335.175                                       | SEK 2.577.248        | SEK 2.820.196        |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 144.546                                         | 163.987              | 183.913              |
| NIW je Anteil                                 | SEK | 16,16                                           | SEK 15,72            | SEK 15,33            |
| Institutional SGD (Hedged):<br>Erträge        | SGD | 60.812                                          | SGD 50.838           | SGD 98.125           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 6.725                                           | 5.668                | 10.785               |
| NIW je Anteil                                 | SGD | 9,04                                            | SGD 8,97             | SGD 9,10             |
| Investor:<br>thesaurierend                    | \$  | 247.931                                         | \$ 287.174           | \$ 337.303           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 10.404                                          | 12.488               | 15.273               |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 23,83                                           | \$ 23,00             | \$ 22,08             |
| Erträge                                       | \$  | 50.514                                          | \$ 69.267            | \$ 143.565           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 4.106                                           | 5.722                | 11.912               |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 12,30                                           | \$ 12,10             | \$ 12,05             |
| Investor AUD (Hedged):<br>Erträge             | AUD | 3.383                                           | AUD 2.758            | AUD 8.369            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 385                                             | 319                  | 961                  |
| NIW je Anteil                                 | AUD | 8,79                                            | AUD 8,64             | AUD 8,70             |
| Investor CHF (Hedged):<br>thesaurierend       | CHF | 4.511                                           | CHF 4.470            | CHF 4.911            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 395                                             | 397                  | 435                  |
| NIW je Anteil                                 | CHF | 11,43                                           | CHF 11,26            | CHF 11,29            |
| Erträge                                       | CHF | 2.517                                           | CHF 2.941            | CHF 4.293            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 282                                             | 328                  | 461                  |
| NIW je Anteil                                 | CHF | 8,92                                            | CHF 8,96             | CHF 9,32             |
| Investor EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €   | 21.263                                          | € 26.998             | € 31.093             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 1.198                                           | 1.563                | 1.843                |
| NIW je Anteil                                 | €   | 17,74                                           | € 17,27              | € 16,87              |
| Erträge                                       | €   | 8.113                                           | € 8.126              | € 10.366             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 799                                             | 807                  | 1.016                |
| NIW je Anteil                                 | €   | 10,15                                           | € 10,07              | € 10,20              |
| Investor GBP (Hedged):<br>Erträge             | £   | 3.722                                           | £ 3.838              | £ 4.257              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 325                                             | 341                  | 379                  |
| NIW je Anteil                                 | £   | 11,45                                           | £ 11,25              | £ 11,24              |
| Investor SGD (Hedged):<br>Erträge             | SGD | 2.752                                           | SGD 7.401            | SGD 7.115            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 312                                             | 846                  | 802                  |
| NIW je Anteil                                 | SGD | 8,81                                            | SGD 8,74             | SGD 8,88             |
| Administrative:<br>thesaurierend              | \$  | 93.378                                          | \$ 94.258            | \$ 88.580            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 4.595                                           | 4.803                | 4.693                |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 20,32                                           | \$ 19,62             | \$ 18,88             |
| Erträge                                       | \$  | 68.270                                          | \$ 83.600            | \$ 70.601            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 5.740                                           | 7.145                | 6.060                |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 11,89                                           | \$ 11,70             | \$ 11,65             |
| Administrative CHF (Hedged):<br>thesaurierend | CHF | 118                                             | CHF 164              | CHF 173              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 12                                              | 17                   | 17                   |
| NIW je Anteil                                 | CHF | 10,02                                           | CHF 9,87             | CHF 9,92             |

|                                               |     | Zum<br>30. Jun. 2025                            | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------------------------|-----|-------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                               |     | Global Investment Grade Credit<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Administrative EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 8.214                                           | € 10.968             | € 10.048             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 492                                             | 674                  | 632                  |
| NIW je Anteil                                 | €   | 16,69                                           | € 16,26              | € 15,91              |
| Erträge                                       | €   | 6.532                                           | € 7.189              | € 9.002              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 666                                             | 739                  | 914                  |
| NIW je Anteil                                 | €   | 9,80                                            | € 9,72               | € 9,85               |
| Administrative GBP (Hedged):<br>Erträge       | £   | 5.626                                           | £ 5.696              | £ 6.900              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 494                                             | 509                  | 617                  |
| NIW je Anteil                                 | £   | 11,39                                           | £ 11,19              | £ 11,18              |
| Administrative HKD (Unhedged):<br>Erträge     | HKD | 30.150                                          | HKD 27.840           | HKD 35.963           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 3.294                                           | 3.124                | 4.033                |
| NIW je Anteil                                 | HKD | 9,15                                            | HKD 8,91             | HKD 8,92             |
| Administrative SEK (Hedged):<br>thesaurierend | SEK | 51.650                                          | SEK 54.105           | SEK 61.831           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 4.580                                           | 4.919                | 5.733                |
| NIW je Anteil                                 | SEK | 11,28                                           | SEK 11,00            | SEK 10,78            |
| Administrative SGD (Hedged):<br>Erträge       | SGD | 10.840                                          | SGD 12.867           | SGD 19.497           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 1.274                                           | 1.525                | 2.276                |
| NIW je Anteil                                 | SGD | 8,51                                            | SGD 8,44             | SGD 8,56             |
| BM Retail:<br>dekumulierend                   | \$  | 63.259                                          | \$ 28.418            | \$ 10                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 6.825                                           | 3.026                | 1                    |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 9,27                                            | \$ 9,39              | \$ 9,95              |
| Class E:<br>thesaurierend                     | \$  | 599.734                                         | \$ 674.947           | \$ 726.293           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 31.525                                          | 36.668               | 40.860               |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 19,02                                           | \$ 18,41             | \$ 17,78             |
| Erträge                                       | \$  | 182.901                                         | \$ 200.786           | \$ 249.811           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 14.577                                          | 16.265               | 20.324               |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 12,55                                           | \$ 12,35             | \$ 12,29             |
| Class E CHF (Hedged):<br>thesaurierend        | CHF | 38.526                                          | CHF 42.271           | CHF 48.855           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 3.760                                           | 4.177                | 4.786                |
| NIW je Anteil                                 | CHF | 10,25                                           | CHF 10,12            | CHF 10,21            |
| Class E EUR (Currency Exposure):<br>Erträge   | €   | 1.260                                           | € 1.352              | € 1.375              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 140                                             | 140                  | 148                  |
| NIW je Anteil                                 | €   | 9,00                                            | € 9,66               | € 9,26               |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend        | €   | 271.693                                         | € 293.534            | € 350.203            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 17.026                                          | 18.845               | 22.889               |
| NIW je Anteil                                 | €   | 15,96                                           | € 15,58              | € 15,30              |
| Erträge                                       | €   | 170.416                                         | € 179.306            | € 191.362            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 20.412                                          | 21.646               | 22.805               |
| NIW je Anteil                                 | €   | 8,35                                            | € 8,28               | € 8,39               |
| Class E GBP (Hedged):<br>Erträge              | £   | 19.534                                          | £ 20.299             | £ 20.954             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 1.642                                           | 1.737                | 1.795                |
| NIW je Anteil                                 | £   | 11,89                                           | £ 11,69              | £ 11,68              |
| Class E SGD (Hedged):<br>Erträge              | SGD | 45.176                                          | SGD 51.239           | SGD 48.801           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 4.987                                           | 5.703                | 5.352                |
| NIW je Anteil                                 | SGD | 9,06                                            | SGD 8,98             | SGD 9,12             |
| H Institutional:<br>thesaurierend             | \$  | 253.977                                         | \$ 260.760           | \$ 485.344           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 11.113                                          | 11.835               | 22.978               |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 22,85                                           | \$ 22,03             | \$ 21,12             |
| Erträge                                       | \$  | 16.342                                          | \$ 16.106            | \$ 18.189            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 1.751                                           | 1.754                | 1.990                |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 9,33                                            | \$ 9,18              | \$ 9,14              |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                      | Zum<br>30. Jun. 2025                            | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|--------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                      | Global Investment Grade Credit<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| H Institutional (Currency Exposure): |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$ 156.527                                      | \$ 12.740            | \$ 85.535            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 16.186                                          | 1.420                | 9.678                |
| NIW je Anteil                        | \$ 9,67                                         | \$ 8,97              | \$ 8,84              |
| M Retail:                            |                                                 |                      |                      |
| dekumulierend                        | \$ 53.116                                       | \$ 40.699            | \$ 10                |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 5.649                                           | 4.287                | 1                    |
| NIW je Anteil                        | \$ 9,40                                         | \$ 9,49              | \$ 9,96              |
| Erträge                              | \$ 24.007                                       | \$ 27.149            | \$ 28.765            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 2.529                                           | 2.907                | 3.092                |
| NIW je Anteil                        | \$ 9,49                                         | \$ 9,34              | \$ 9,30              |
| ausschüttend II                      | \$ 81.542                                       | \$ 83.511            | \$ 89.186            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 9.819                                           | 10.152               | 10.736               |
| NIW je Anteil                        | \$ 8,30                                         | \$ 8,23              | \$ 8,31              |
| M Retail HKD (Unhedged):             |                                                 |                      |                      |
| Erträge                              | HKD 8.999                                       | HKD 8.995            | HKD 9.098            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 983                                             | 1.009                | 1.019                |
| NIW je Anteil                        | HKD 9,16                                        | HKD 8,92             | HKD 8,93             |
| Class R:                             |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$ 5.436                                        | \$ 7.754             | \$ 11.284            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 391                                             | 578                  | 876                  |
| NIW je Anteil                        | \$ 13,91                                        | \$ 13,42             | \$ 12,88             |
| Erträge                              | \$ 3.705                                        | \$ 4.571             | \$ 4.627             |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 394                                             | 494                  | 502                  |
| NIW je Anteil                        | \$ 9,41                                         | \$ 9,26              | \$ 9,22              |
| Class R EUR (Hedged):                |                                                 |                      |                      |
| Erträge                              | € 1.867                                         | € 1.892              | € 2.174              |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 240                                             | 245                  | 278                  |
| NIW je Anteil                        | € 7,79                                          | € 7,73               | € 7,83               |
| Class R GBP (Hedged):                |                                                 |                      |                      |
| Erträge                              | £ 4.132                                         | £ 5.562              | £ 6.122              |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 476                                             | 652                  | 718                  |
| NIW je Anteil                        | £ 8,68                                          | £ 8,53               | £ 8,52               |
| Class T:                             |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$ 21.550                                       | \$ 23.322            | \$ 26.285            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 1.830                                           | 2.043                | 2.375                |
| NIW je Anteil                        | \$ 11,78                                        | \$ 11,42             | \$ 11,07             |
| Class T EUR (Hedged):                |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | € 3.083                                         | € 3.114              | € 4.398              |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 316                                             | 326                  | 467                  |
| NIW je Anteil                        | € 9,75                                          | € 9,54               | € 9,41               |
| W Class:                             |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | \$ 79.114                                       | \$ 79.909            | \$ 43.413            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 7.731                                           | 8.110                | 4.609                |
| NIW je Anteil                        | \$ 10,23                                        | \$ 9,85              | \$ 9,42              |
| Erträge                              | \$ 20.662                                       | \$ 20.149            | \$ 20.522            |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 2.388                                           | 2.367                | 2.421                |
| NIW je Anteil                        | \$ 8,65                                         | \$ 8,51              | \$ 8,48              |
| W Class CHF (Hedged):                |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | CHF 16.037                                      | CHF 17.421           | CHF 20.410           |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 1.822                                           | 2.014                | 2.362                |
| NIW je Anteil                        | CHF 8,80                                        | CHF 8,65             | CHF 8,64             |
| W Class EUR (Hedged):                |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | € 13.730                                        | € 14.094             | € 15.763             |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 1.459                                           | 1.542                | 1.773                |
| NIW je Anteil                        | € 9,41                                          | € 9,14               | € 8,89               |
| Erträge                              | € 4.793                                         | € 4.926              | € 5.515              |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 603                                             | 625                  | 690                  |
| NIW je Anteil                        | € 7,95                                          | € 7,89               | € 7,99               |
| W Class GBP (Hedged):                |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend                        | £ 3.107                                         | £ 4.238              | £ 3.652              |
| ausgegebene und umlaufende           |                                                 |                      |                      |
| Anteile                              | 311                                             | 441                  | 396                  |
| NIW je Anteil                        | £ 9,99                                          | £ 9,62               | £ 9,22               |

|                             | Zum<br>30. Jun. 2025                            | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------|-------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                             | Global Investment Grade Credit<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                     | £ 6.851                                         | £ 12.197             | £ 13.232             |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 811                                             | 1.470                | 1.596                |
| NIW je Anteil               | £ 8,44                                          | £ 8,30               | £ 8,29               |
| W Class SGD (Hedged):       |                                                 |                      |                      |
| Erträge                     | SGD 13.274                                      | SGD 13.473           | SGD 14.814           |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 1.605                                           | 1.642                | 1.780                |
| NIW je Anteil               | SGD 8,27                                        | SGD 8,20             | SGD 8,32             |
|                             | Global Investment Grade Credit<br>ESG Fund      |                      |                      |
| Nettovermögen               | \$ 2.544.914                                    | \$ 2.115.617         | \$ 2.170.207         |
| Institutional:              |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend               | \$ 167.780                                      | \$ 132.347           | \$ 64.347            |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 13.744                                          | 11.271               | 5.695                |
| NIW je Anteil               | \$ 12,21                                        | \$ 11,74             | \$ 11,30             |
| Erträge                     | \$ 60.909                                       | \$ 128.969           | \$ 121.717           |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 6.385                                           | 13.791               | 13.032               |
| NIW je Anteil               | \$ 9,54                                         | \$ 9,35              | \$ 9,34              |
| Institutional CHF (Hedged): |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend               | CHF 178.992                                     | CHF 169.761          | CHF 190.076          |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 18.090                                          | 17.480               | 19.472               |
| NIW je Anteil               | CHF 9,89                                        | CHF 9,71             | CHF 9,76             |
| Erträge                     | CHF 2.539                                       | CHF 2.137            | CHF 3.016            |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 328                                             | 276                  | 374                  |
| NIW je Anteil               | CHF 7,73                                        | CHF 7,73             | CHF 8,07             |
| Institutional EUR (Hedged): |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend               | € 850.923                                       | € 574.679            | € 538.219            |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 79.735                                          | 55.491               | 53.109               |
| NIW je Anteil               | € 10,67                                         | € 10,36              | € 10,13              |
| Erträge                     | € 166.330                                       | € 178.249            | € 243.292            |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 20.063                                          | 21.749               | 29.217               |
| NIW je Anteil               | € 8,29                                          | € 8,20               | € 8,33               |
| Institutional GBP (Hedged): |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend               | £ 59.756                                        | £ 75.998             | £ 31.445             |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 5.182                                           | 6.858                | 2.940                |
| NIW je Anteil               | £ 11,53                                         | £ 11,08              | £ 10,70              |
| Erträge                     | £ 108.780                                       | £ 111.796            | £ 270.851            |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 11.703                                          | 12.254               | 29.628               |
| NIW je Anteil               | £ 9,29                                          | £ 9,12               | £ 9,14               |
| Institutional SEK (Hedged): |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend               | SEK 28.421                                      | SEK 30.935           | SEK 32.957           |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 246                                             | 276                  | 299                  |
| NIW je Anteil               | SEK 115,52                                      | SEK 112,20           | SEK 110,07           |
| Investor:                   |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend               | \$ 156                                          | \$ 151               | \$ 130               |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | 16                                              | 16                   | 14                   |
| NIW je Anteil               | \$ 9,97                                         | \$ 9,60              | \$ 9,27              |
| Investor EUR (Hedged):      |                                                 |                      |                      |
| thesaurierend               | k. A.                                           | k. A.                | € 10                 |
| ausgegebene und umlaufende  |                                                 |                      |                      |
| Anteile                     | k. A.                                           | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil               | k. A.                                           | k. A.                | € 10,50              |

|                                               |     | Zum<br>30. Jun. 2025                                | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------------------------|-----|-----------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                               |     | Global Investment Grade Credit ESG<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                       | €   | 11                                                  | 10                   | 10                   |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 1                                                   | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                                 | €   | 10,18                                               | 10,06                | 10,23                |
| Administrative SEK (Hedged):<br>thesaurierend | SEK | 5.757.253                                           | SEK 6.640.716        | SEK 4.672.844        |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 60.122                                              | 71.207               | 50.829               |
| NIW je Anteil                                 | SEK | 95,76                                               | SEK 93,26            | SEK 91,93            |
| Class E:                                      |     |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                                 | \$  | 12.161                                              | \$ 12.549            | \$ 10.138            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 1.221                                               | 1.305                | 1.086                |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 9,96                                                | \$ 9,62              | \$ 9,34              |
| Erträge                                       | \$  | 2.624                                               | \$ 2.722             | \$ 3.728             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 289                                                 | 305                  | 419                  |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 9,09                                                | \$ 8,91              | \$ 8,90              |
| Class E CHF (Hedged):<br>thesaurierend        | CHF | 470                                                 | CHF 475              | CHF 402              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 56                                                  | 57                   | 48                   |
| NIW je Anteil                                 | CHF | 8,47                                                | CHF 8,35             | CHF 8,46             |
| Erträge                                       | CHF | 8                                                   | CHF 8                | CHF 24               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 1                                                   | 1                    | 3                    |
| NIW je Anteil                                 | CHF | 7,73                                                | CHF 7,74             | CHF 8,07             |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend        | €   | 33.210                                              | € 27.452             | € 16.648             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 3.660                                               | 3.104                | 1.906                |
| NIW je Anteil                                 | €   | 9,07                                                | € 8,84               | € 8,73               |
| Erträge                                       | €   | 423                                                 | € 657                | € 638                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 51                                                  | 80                   | 77                   |
| NIW je Anteil                                 | €   | 8,28                                                | € 8,19               | € 8,32               |
| Class E GBP (Hedged):<br>thesaurierend        | £   | 734                                                 | £ 709                | £ 690                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 76                                                  | 76                   | 76                   |
| NIW je Anteil                                 | £   | 9,64                                                | £ 9,31               | £ 9,06               |
| Class Z:                                      |     |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                                 |     | k. A.                                               | k. A.                | \$ 4.612             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | k. A.                                               | k. A.                | 434                  |
| NIW je Anteil                                 |     | k. A.                                               | k. A.                | \$ 10,63             |
|                                               |     | Global Low Duration Real Return Fund                |                      |                      |
| Nettvermögen                                  | \$  | 1.663.427                                           | \$ 1.216.904         | \$ 1.177.052         |
| Institutional:                                |     |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                                 | \$  | 89.851                                              | \$ 115.710           | \$ 59.349            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 6.585                                               | 8.870                | 4.779                |
| NIW je Anteil                                 | \$  | 13,64                                               | \$ 13,05             | \$ 12,42             |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend  | CHF | 73.017                                              | CHF 71.417           | CHF 37.402           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 7.089                                               | 7.103                | 3.747                |
| NIW je Anteil                                 | CHF | 10,30                                               | CHF 10,05            | CHF 9,98             |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend  | €   | 511.261                                             | € 262.485            | € 267.868            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile         |     | 45.137                                              | 24.016               | 25.334               |
| NIW je Anteil                                 | €   | 11,33                                               | € 10,93              | € 10,57              |

|                                                     |     | Zum<br>30. Jun. 2025                             | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------------------------------|-----|--------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                                     |     | Global Low Duration Real Return<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                             | €   | 24.584                                           | € 24.218             | € 24.318             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 2.737                                            | 2.747                | 2.748                |
| NIW je Anteil                                       | €   | 8,98                                             | € 8,82               | € 8,85               |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend        | £   | 78.949                                           | £ 56.093             | £ 34.278             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 6.320                                            | 4.698                | 3.010                |
| NIW je Anteil                                       | £   | 12,49                                            | £ 11,94              | £ 11,39              |
| Erträge                                             | £   | 67.312                                           | £ 74.704             | £ 67.020             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 6.999                                            | 7.991                | 7.240                |
| NIW je Anteil                                       | £   | 9,62                                             | £ 9,35               | £ 9,26               |
| Institutional SGD (Hedged):<br>thesaurierend        | SGD | 658.324                                          | SGD 633.360          | SGD 609.791          |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 58.959                                           | 58.812               | 58.427               |
| NIW je Anteil                                       | SGD | 11,17                                            | SGD 10,77            | SGD 10,44            |
| Investor:                                           |     |                                                  |                      |                      |
| thesaurierend                                       | \$  | 4.269                                            | \$ 4.088             | \$ 4.357             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 326                                              | 326                  | 364                  |
| NIW je Anteil                                       | \$  | 13,10                                            | \$ 12,54             | \$ 11,98             |
| Class E:                                            |     |                                                  |                      |                      |
| thesaurierend                                       | \$  | 24.493                                           | \$ 20.131            | \$ 24.371            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 1.988                                            | 1.702                | 2.145                |
| NIW je Anteil                                       | \$  | 12,32                                            | \$ 11,83             | \$ 11,36             |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend              | €   | 90.961                                           | € 70.697             | € 118.010            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 8.897                                            | 7.134                | 12.201               |
| NIW je Anteil                                       | €   | 10,22                                            | € 9,91               | € 9,67               |
|                                                     |     | Global Real Return Fund                          |                      |                      |
| Nettvermögen                                        | \$  | 1.903.969                                        | \$ 2.090.147         | \$ 2.381.093         |
| Institutional:                                      |     |                                                  |                      |                      |
| thesaurierend                                       | \$  | 196.249                                          | \$ 205.925           | \$ 286.542           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 8.330                                            | 9.058                | 12.657               |
| NIW je Anteil                                       | \$  | 23,56                                            | \$ 22,73             | \$ 22,64             |
| Erträge                                             | \$  | 1.713                                            | \$ 3.593             | \$ 5.867             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 110                                              | 234                  | 373                  |
| NIW je Anteil                                       | \$  | 15,63                                            | \$ 15,35             | \$ 15,71             |
| Institutional (Currency Exposure):<br>thesaurierend | \$  | 114.319                                          | \$ 114.885           | \$ 49.161            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 10.437                                           | 11.394               | 4.759                |
| NIW je Anteil                                       | \$  | 10,95                                            | \$ 10,08             | \$ 10,33             |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend        | CHF | 41.893                                           | CHF 43.126           | CHF 52.476           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 3.250                                            | 3.398                | 3.973                |
| NIW je Anteil                                       | CHF | 12,89                                            | CHF 12,69            | CHF 13,21            |
| Erträge                                             | CHF | 25.531                                           | CHF 25.635           | CHF 27.158           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 3.272                                            | 3.282                | 3.248                |
| NIW je Anteil                                       | CHF | 7,80                                             | CHF 7,81             | CHF 8,36             |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend        | €   | 460.313                                          | € 537.601            | € 664.628            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile               |     | 24.465                                           | 29.357               | 35.832               |
| NIW je Anteil                                       | €   | 18,81                                            | € 18,31              | € 18,55              |



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025             | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------------|-----|----------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                              |     | Global Real Return Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                      | €   | 74.342                           | € 78.497             | € 84.433             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 6.073                            | 6.479                | 6.690                |
| NIW je Anteil                                | €   | 12,24                            | € 12,12              | € 12,62              |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £   | 7.122                            | £ 25.949             | £ 34.169             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 560                              | 2.115                | 2.789                |
| NIW je Anteil                                | £   | 12,73                            | £ 12,27              | £ 12,25              |
| Erträge                                      | £   | 21.871                           | £ 182.969            | £ 185.264            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.782                            | 23.661               | 23.332               |
| NIW je Anteil                                | £   | 7,86                             | £ 7,73               | £ 7,94               |
| Institutional SGD (Hedged):<br>thesaurierend | SGD | 478.100                          | SGD 449.951          | SGD 243.298          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 28.907                           | 27.964               | 14.905               |
| NIW je Anteil                                | SGD | 16,54                            | SGD 16,09            | SGD 16,32            |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$  | 20.438                           | \$ 25.849            | \$ 33.204            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 936                              | 1.225                | 1.575                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 21,83                            | \$ 21,10             | \$ 21,08             |
| Erträge                                      | \$  | 4.036                            | \$ 4.372             | \$ 12.287            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 297                              | 327                  | 898                  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 13,61                            | \$ 13,35             | \$ 13,68             |
| Investor CHF (Hedged):<br>Erträge            | CHF | 907                              | CHF 830              | CHF 1.598            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 92                               | 84                   | 152                  |
| NIW je Anteil                                | CHF | 9,82                             | CHF 9,83             | CHF 10,53            |
| Investor EUR (Hedged):<br>thesaurierend      | €   | 3.744                            | € 4.534              | € 20.092             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 214                              | 266                  | 1.160                |
| NIW je Anteil                                | €   | 17,48                            | € 17,04              | € 17,32              |
| Administrative:<br>thesaurierend             | \$  | 32.125                           | \$ 31.590            | \$ 36.683            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.511                            | 1.536                | 1.782                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 21,27                            | \$ 20,57             | \$ 20,59             |
| Class E:<br>thesaurierend                    | \$  | 107.040                          | \$ 87.449            | \$ 124.585           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 5.415                            | 4.565                | 6.472                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 19,77                            | \$ 19,16             | \$ 19,25             |
| Erträge                                      | \$  | 19.713                           | \$ 21.615            | \$ 28.387            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 1.508                            | 1.686                | 2.155                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 13,07                            | \$ 12,82             | \$ 13,17             |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €   | 112.495                          | € 125.937            | € 216.460            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 7.119                            | 8.151                | 13.708               |
| NIW je Anteil                                | €   | 15,80                            | € 15,45              | € 15,79              |
| H Institutional:<br>thesaurierend            | \$  | 137.049                          | \$ 147.143           | \$ 145.477           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 6.025                            | 6.698                | 6.639                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 22,75                            | \$ 21,97             | \$ 21,91             |
| Class R:<br>thesaurierend                    |     | k. A.                            | k. A.                | \$ 903               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | k. A.                            | k. A.                | 73                   |
| NIW je Anteil                                |     | k. A.                            | k. A.                | \$ 12,40             |

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025             | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------------|-----|----------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                              |     | Global Real Return Fund (Forts.) |                      |                      |
| Class R GBP (Hedged):<br>thesaurierend       | £   | 4.584                            | £ 5.100              | £ 6.705              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 385                              | 444                  | 583                  |
| NIW je Anteil                                | £   | 11,91                            | £ 11,49              | £ 11,51              |
| Nettovermögen                                | \$  | 99.023.220                       | \$ 89.286.860        | \$ 70.543.117        |
| Institutional:<br>thesaurierend              | \$  | 16.641.508                       | \$ 15.407.659        | \$ 10.887.096        |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 872.769                          | 851.558              | 634.431              |
| NIW je Anteil                                | \$  | 19,07                            | \$ 18,09             | \$ 17,16             |
| Erträge                                      | \$  | 7.324.628                        | \$ 7.324.286         | \$ 5.004.823         |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 670.522                          | 685.413              | 464.458              |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,92                            | \$ 10,69             | \$ 10,78             |
| Institutional AUD (Hedged):<br>thesaurierend | AUD | 131.659                          | AUD 117.318          | AUD 100.109          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 10.609                           | 9.962                | 8.864                |
| NIW je Anteil                                | AUD | 12,41                            | AUD 11,78            | AUD 11,29            |
| Erträge                                      | AUD | 30.560                           | AUD 7.242            | AUD 246              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 2.986                            | 723                  | 24                   |
| NIW je Anteil                                | AUD | 10,24                            | AUD 10,02            | AUD 10,23            |
| Institutional BRL (Hedged):<br>thesaurierend | \$  | 367.476                          | \$ 326.146           | \$ 353.963           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 20.162                           | 22.129               | 20.644               |
| NIW je Anteil                                | \$  | 18,23                            | \$ 14,74             | \$ 17,15             |
| Institutional CAD (Hedged):<br>thesaurierend | CAD | 80.857                           | CAD 65.288           | CAD 95.099           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 5.608                            | 4.736                | 7.208                |
| NIW je Anteil                                | CAD | 14,42                            | CAD 13,78            | CAD 13,19            |
| Erträge                                      | CAD | 81.446                           | CAD 86.483           | CAD 122.367          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 8.885                            | 9.565                | 13.288               |
| NIW je Anteil                                | CAD | 9,17                             | CAD 9,04             | CAD 9,21             |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend | CHF | 373.775                          | CHF 405.974          | CHF 324.097          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 31.099                           | 34.883               | 28.117               |
| NIW je Anteil                                | CHF | 12,02                            | CHF 11,64            | CHF 11,53            |
| Erträge                                      | CHF | 209.588                          | CHF 214.547          | CHF 157.673          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 28.985                           | 29.601               | 20.540               |
| NIW je Anteil                                | CHF | 7,23                             | CHF 7,25             | CHF 7,68             |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 5.979.340                        | € 5.715.921          | € 5.358.424          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 382.188                          | 381.533              | 370.909              |
| NIW je Anteil                                | €   | 15,65                            | € 14,98              | € 14,45              |
| Erträge                                      | €   | 810.262                          | € 728.143            | € 798.611            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 93.108                           | 84.594               | 90.229               |
| NIW je Anteil                                | €   | 8,70                             | € 8,61               | € 8,85               |
| ausschüttend II                              | €   | 382.190                          | € 293.101            | € 23.567             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 41.744                           | 32.754               | 2.620                |
| NIW je Anteil                                | €   | 9,16                             | € 8,95               | € 8,99               |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £   | 187.775                          | £ 328.281            | £ 249.561            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile        |     | 15.211                           | 28.041               | 22.404               |
| NIW je Anteil                                | £   | 12,34                            | £ 11,71              | £ 11,14              |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|----------------------|----------------------|----------------------|
|                                       |     | Income Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                               | £   | 990.784              | £ 718.827            | £ 583.372            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 107.252              | 79.548               | 63.749               |
| NIW je Anteil                         | £   | 9,24                 | £ 9,04               | £ 9,15               |
| Institutional HKD (Unhedged):         |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | HKD | 1.482.045            | HKD 616.237          | HKD 300.633          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 147.756              | 63.448               | 30.526               |
| NIW je Anteil                         | HKD | 10,03                | HKD 9,71             | HKD 9,85             |
| Institutional JPY (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | ¥   | 14.438.417           | ¥ 11.709.740         | ¥ 2.154.442          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 13.673               | 11.454               | 2.097                |
| NIW je Anteil                         | ¥   | 1.056,00             | ¥ 1.022,00           | ¥ 1.027,00           |
| Erträge                               | ¥   | 3.297                | ¥ 3.249              | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 4                    | 3                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | ¥   | 939,00               | ¥ 938,00             | k. A.                |
| Institutional NOK (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | NOK | 2.673.620            | NOK 2.383.760        | NOK 2.372.450        |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 21.083               | 19.826               | 20.619               |
| NIW je Anteil                         | NOK | 126,82               | NOK 120,23           | NOK 115,06           |
| Institutional RMB (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | CNH | 118.403              | CNH 203.472          | CNH 75               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.193                | 2.070                | 1                    |
| NIW je Anteil                         | CNH | 99,29                | CNH 98,32            | CNH 101,93           |
| Institutional SGD (Hedged):           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | SGD | 275.748              | SGD 247.319          | SGD 99.211           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 23.475               | 22.002               | 9.134                |
| NIW je Anteil                         | SGD | 11,75                | SGD 11,24            | SGD 10,86            |
| Erträge                               | SGD | 1.058.523            | SGD 749.337          | SGD 411.788          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 112.744              | 80.791               | 43.143               |
| NIW je Anteil                         | SGD | 9,39                 | SGD 9,27             | SGD 9,54             |
| Investor:                             |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 2.477.812            | \$ 2.441.763         | \$ 2.002.496         |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 161.297              | 167.216              | 144.086              |
| NIW je Anteil                         | \$  | 15,36                | \$ 14,60             | \$ 13,90             |
| Erträge                               | \$  | 1.810.928            | \$ 1.780.936         | \$ 1.450.049         |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 189.836              | 190.451              | 153.164              |
| NIW je Anteil                         | \$  | 9,54                 | \$ 9,35              | \$ 9,47              |
| Investor AUD (Hedged):                |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | AUD | 63.012               | AUD 63.762           | AUD 84.018           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 7.340                | 7.568                | 9.724                |
| NIW je Anteil                         | AUD | 8,58                 | AUD 8,42             | AUD 8,64             |
| Investor EUR (Hedged):                |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | €   | 232.549              | € 227.681            | € 226.229            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 18.888               | 19.278               | 19.795               |
| NIW je Anteil                         | €   | 12,31                | € 11,81              | € 11,43              |
| Erträge                               | €   | 84.782               | € 82.149             | € 86.099             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 11.282               | 11.029               | 11.198               |
| NIW je Anteil                         | €   | 7,51                 | € 7,45               | € 7,69               |
| ausschüttend A                        | €   | 21.566               | € 21.015             | € 24.484             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.656                | 2.698                | 3.069                |
| NIW je Anteil                         | €   | 8,12                 | € 7,79               | € 7,98               |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|----------------------|----------------------|----------------------|
|                                       |     | Income Fund (Forts.) |                      |                      |
| Investor GBP (Hedged):                |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | £   | 12.637               | £ 12.280             | £ 18.236             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.461                | 1.449                | 2.117                |
| NIW je Anteil                         | £   | 8,65                 | £ 8,48               | £ 8,62               |
| Investor HKD (Unhedged):              |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | HKD | 93                   | HKD 87               | HKD 84               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 9                    | 8                    | 8                    |
| NIW je Anteil                         | HKD | 10,75                | HKD 10,43            | HKD 10,61            |
| Investor JPY (Hedged):                |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | ¥   | 30.459               | ¥ 153.876            | ¥ 1.376              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 29                   | 152                  | 1                    |
| NIW je Anteil                         | ¥   | 1.044,00             | ¥ 1.013,00           | ¥ 1.021,00           |
| Investor RMB (Hedged):                |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | CNH | 94.024               | CNH 92.810           | CNH 105.901          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 726                  | 746                  | 871                  |
| NIW je Anteil                         | CNH | 129,55               | CNH 124,46           | CNH 121,55           |
| Investor SGD (Hedged):                |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | SGD | 19.967               | SGD 23.284           | SGD 17.361           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.770                | 2.153                | 1.656                |
| NIW je Anteil                         | SGD | 11,28                | SGD 10,81            | SGD 10,48            |
| Erträge                               | SGD | 140.618              | SGD 119.519          | SGD 69.437           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 16.176               | 13.890               | 7.811                |
| NIW je Anteil                         | SGD | 8,69                 | SGD 8,60             | SGD 8,89             |
| Administrative:                       |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 1.497.638            | \$ 1.341.063         | \$ 912.884           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 110.453              | 103.971              | 74.250               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 13,56                | \$ 12,90             | \$ 12,29             |
| Erträge                               | \$  | 5.431.940            | \$ 5.224.940         | \$ 3.565.795         |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 535.264              | 524.774              | 353.150              |
| NIW je Anteil                         | \$  | 10,15                | \$ 9,96              | \$ 10,10             |
| Administrative AUD (Hedged):          |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | AUD | 10.755               | AUD 15               | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.025                | 2                    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | AUD | 10,49                | AUD 9,98             | k. A.                |
| Erträge                               | AUD | 543.297              | AUD 497.594          | AUD 406.120          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 61.963               | 57.766               | 45.885               |
| NIW je Anteil                         | AUD | 8,77                 | AUD 8,61             | AUD 8,85             |
| Administrative EUR (Hedged):          |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                         | €   | 59.352               | € 98.047             | € 85.658             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 4.869                | 8.380                | 7.555                |
| NIW je Anteil                         | €   | 12,19                | € 11,70              | € 11,34              |
| Erträge                               | €   | 385.389              | € 364.116            | € 305.892            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 50.743               | 48.328               | 39.257               |
| NIW je Anteil                         | €   | 7,59                 | € 7,53               | € 7,79               |
| Administrative GBP (Hedged):          |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | £   | 159.679              | £ 160.323            | £ 142.362            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 19.184               | 19.633               | 17.119               |
| NIW je Anteil                         | £   | 8,32                 | £ 8,17               | £ 8,32               |
| Administrative HKD (Unhedged):        |     |                      |                      |                      |
| Erträge                               | HKD | 4.709.750            | HKD 3.896.729        | HKD 4.564.281        |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 519.854              | 442.930              | 508.704              |
| NIW je Anteil                         | HKD | 9,06                 | HKD 8,80             | HKD 8,97             |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025 |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|
|                                       |     | Income Fund (Forts.) |     |                      |     |                      |
| Administrative SEK (Hedged):          |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | SEK | 2.902                | SEK | 2.637                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 28                   |     | 26                   |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | SEK | 104,06               | SEK | 99,98                |     | k. A.                |
| Administrative SGD (Hedged):          |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | SGD | 4.247.517            | SGD | 3.465.568            | SGD | 1.829.067            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 444.894              |     | 366.388              |     | 186.853              |
| NIW je Anteil                         | SGD | 9,55                 | SGD | 9,46                 | SGD | 9,79                 |
| Class E:                              |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 8.373.661            | \$  | 7.665.777            | \$  | 5.787.064            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 491.444              |     | 472.004              |     | 372.334              |
| NIW je Anteil                         | \$  | 17,04                | \$  | 16,24                | \$  | 15,54                |
| Erträge                               | \$  | 11.486.830           | \$  | 10.789.424           | \$  | 8.737.093            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.200.555            |     | 1.146.679            |     | 911.535              |
| NIW je Anteil                         | \$  | 9,57                 | \$  | 9,41                 | \$  | 9,59                 |
| Class E AUD (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | AUD | 1.008.823            | AUD | 981.659              | AUD | 799.635              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 123.927              |     | 122.466              |     | 96.656               |
| NIW je Anteil                         | AUD | 8,14                 | AUD | 8,02                 | AUD | 8,27                 |
| Class E CHF (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | CHF | 68.927               | CHF | 63.917               | CHF | 68.634               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6.108                |     | 5.823                |     | 6.257                |
| NIW je Anteil                         | CHF | 11,29                | CHF | 10,98                | CHF | 10,97                |
| Erträge                               | CHF | 446.627              | CHF | 334.875              | CHF | 237.431              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 69.313               |     | 51.570               |     | 34.173               |
| NIW je Anteil                         | CHF | 6,44                 | CHF | 6,49                 | CHF | 6,95                 |
| Class E EUR (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | €   | 5.210.830            | €   | 5.003.524            | €   | 4.941.016            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 373.058              |     | 372.420              |     | 377.958              |
| NIW je Anteil                         | €   | 13,97                | €   | 13,44                | €   | 13,07                |
| Erträge                               | €   | 3.529.370            | €   | 3.515.468            | €   | 3.451.544            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 463.204              |     | 463.975              |     | 438.473              |
| NIW je Anteil                         | €   | 7,62                 | €   | 7,58                 | €   | 7,87                 |
| ausschüttend II                       | €   | 247.812              | €   | 225.785              | €   | 158.809              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 27.612               |     | 25.612               |     | 17.751               |
| NIW je Anteil                         | €   | 8,97                 | €   | 8,82                 | €   | 8,95                 |
| ausschüttend II Q                     | €   | 39.619               | €   | 34.473               | €   | 32.842               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 4.475                |     | 3.964                |     | 3.722                |
| NIW je Anteil                         | €   | 8,85                 | €   | 8,70                 | €   | 8,82                 |
| Class E GBP (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | £   | 259.499              | £   | 256.357              | £   | 232.770              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 32.669               |     | 32.817               |     | 29.126               |
| NIW je Anteil                         | £   | 7,94                 | £   | 7,81                 | £   | 7,99                 |
| Class E HKD (Unhedged):               |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | HKD | 5.901.169            | HKD | 4.888.390            | HKD | 4.105.214            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 652.143              |     | 555.032              |     | 454.999              |
| NIW je Anteil                         | HKD | 9,05                 | HKD | 8,81                 | HKD | 9,02                 |
| Class E HUF (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | HUF | 1.774.889            | HUF | 94.299               |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 167.533              |     | 9.425                |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | HUF | 10,59                | HUF | 10,00                |     | k. A.                |

|                                       |     | Zum<br>30. Jun. 2025 |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |     | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|-----|----------------------|
|                                       |     | Income Fund (Forts.) |     |                      |     |                      |
| Class E JPY (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | ¥   | 37.607.914           | ¥   | 43.680.919           | ¥   | 11.142.148           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 38.035               |     | 45.428               |     | 11.433               |
| NIW je Anteil                         | ¥   | 989,00               | ¥   | 962,00               | ¥   | 975,00               |
| Erträge                               | ¥   | 159.839.625          | ¥   | 167.720.684          | ¥   | 52.326.950           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 184.213              |     | 192.054              |     | 55.343               |
| NIW je Anteil                         | ¥   | 868,00               | ¥   | 873,00               | ¥   | 946,00               |
| Class E RMB (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | CNH | 1.291.710            | CNH | 1.276.444            | CNH | 988.205              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 12.615               |     | 12.514               |     | 9.238                |
| NIW je Anteil                         | CNH | 102,39               | CNH | 102,00               | CNH | 106,97               |
| Class E SGD (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | SGD | 7.657.751            | SGD | 7.125.445            | SGD | 4.758.628            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 916.285              |     | 858.495              |     | 551.466              |
| NIW je Anteil                         | SGD | 8,36                 | SGD | 8,30                 | SGD | 8,63                 |
| G Retail EUR (Hedged):                |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | €   | 266.916              | €   | 263.123              | €   | 81.915               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 34.276               |     | 35.129               |     | 10.629               |
| NIW je Anteil                         | €   | 7,79                 | €   | 7,49                 | €   | 7,71                 |
| H Institutional:                      |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 1.535.059            | \$  | 1.308.558            | \$  | 918.636              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 115.506              |     | 103.675              |     | 76.610               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 13,29                | \$  | 12,62                | \$  | 11,99                |
| Erträge                               | \$  | 674.429              | \$  | 593.228              | \$  | 452.440              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 71.774               |     | 64.474               |     | 48.671               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 9,40                 | \$  | 9,20                 | \$  | 9,30                 |
| Class R:                              |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 151.982              | \$  | 153.259              | \$  | 95.966               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 12.434               |     | 13.197               |     | 8.690                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 12,22                | \$  | 11,61                | \$  | 11,04                |
| Erträge                               | \$  | 63.591               | \$  | 63.882               | \$  | 62.563               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 6.722                |     | 6.893                |     | 6.676                |
| NIW je Anteil                         | \$  | 9,46                 | \$  | 9,27                 | \$  | 9,37                 |
| Class R EUR (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | €   | 13.926               |     | k. A.                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.354                |     | k. A.                |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | €   | 10,29                |     | k. A.                |     | k. A.                |
| Erträge                               | €   | 12.528               | €   | 11.900               | €   | 12.323               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1.570                |     | 1.505                |     | 1.511                |
| NIW je Anteil                         | €   | 7,98                 | €   | 7,91                 | €   | 8,15                 |
| Class R EUR (Unhedged):               |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | €   | 9                    |     | k. A.                |     | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 1                    |     | k. A.                |     | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | €   | 9,97                 |     | k. A.                |     | k. A.                |
| Class R GBP (Hedged):                 |     |                      |     |                      |     |                      |
| Erträge                               | £   | 25.040               | £   | 24.232               | £   | 25.773               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 2.616                |     | 2.584                |     | 2.706                |
| NIW je Anteil                         | £   | 9,57                 | £   | 9,38                 | £   | 9,52                 |
| Class T:                              |     |                      |     |                      |     |                      |
| thesaurierend                         | \$  | 448.883              | \$  | 426.502              | \$  | 314.165              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile |     | 32.416               |     | 32.248               |     | 24.722               |
| NIW je Anteil                         | \$  | 13,85                | \$  | 13,23                | \$  | 12,71                |

|                                          |     | Zum<br>30. Jun. 2025 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------------------|-----|----------------------|----------------------|----------------------|
|                                          |     | Income Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                  | \$  | 165.773              | \$ 143.087           | \$ 115.745           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 19.885               | 17.411               | 13.763               |
| NIW je Anteil                            | \$  | 8,34                 | \$ 8,22              | \$ 8,41              |
| Class T EUR (Hedged):<br>thesaurierend   | €   | 256.173              | € 250.816            | € 252.546            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 22.433               | 22.789               | 23.488               |
| NIW je Anteil                            | €   | 11,42                | € 11,01              | € 10,75              |
| Erträge                                  | €   | 174.902              | € 178.617            | € 172.434            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 26.201               | 26.845               | 24.832               |
| NIW je Anteil                            | €   | 6,68                 | € 6,65               | € 6,94               |
| Class Z:                                 |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                            | \$  | 72.483               | \$ 123.213           | \$ 191.273           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 3.551                | 6.379                | 10.499               |
| NIW je Anteil                            | \$  | 20,41                | \$ 19,31             | \$ 18,22             |
| Erträge                                  | \$  | 10                   | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 1                    | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                            | \$  | 10,04                | k. A.                | k. A.                |
| Class Z AUD (Hedged):<br>ausschüttend II | AUD | 1.208.249            | AUD 1.226.200        | AUD 1.331.421        |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 121.184              | 125.962              | 134.703              |
| NIW je Anteil                            | AUD | 9,97                 | AUD 9,73             | AUD 9,88             |
|                                          |     | Income Fund II       |                      |                      |
| Nettovermögen                            | \$  | 331.870              | \$ 273.663           | \$ 125.160           |
| Institutional:                           |     |                      |                      |                      |
| thesaurierend                            | \$  | 26                   | \$ 20                | \$ 24.344            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 2                    | 2                    | 2.396                |
| NIW je Anteil                            | \$  | 11,23                | \$ 10,62             | \$ 10,16             |
| Erträge                                  | \$  | 12                   | \$ 11                | \$ 11                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 1                    | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil                            | \$  | 10,43                | \$ 10,16             | \$ 10,30             |
| Class E:                                 |     |                      |                      |                      |
| Erträge                                  | \$  | 133.163              | \$ 109.150           | \$ 45.250            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 15.133               | 12.677               | 5.130                |
| NIW je Anteil                            | \$  | 8,80                 | \$ 8,61              | \$ 8,82              |
| Class E AUD (Hedged):<br>Erträge         | AUD | 22.172               | AUD 23.246           | AUD 13.403           |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 2.640                | 2.826                | 1.571                |
| NIW je Anteil                            | AUD | 8,40                 | AUD 8,23             | AUD 8,53             |
| Class E EUR (Hedged):<br>Erträge         | €   | 9.787                | € 6.866              | € 5.479              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 1.210                | 859                  | 658                  |
| NIW je Anteil                            | €   | 8,09                 | € 7,99               | € 8,33               |
| Class E GBP (Hedged):<br>Erträge         | £   | 9.663                | £ 8.568              | £ 12.067             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 1.123                | 1.018                | 1.396                |
| NIW je Anteil                            | £   | 8,60                 | £ 8,41               | £ 8,64               |
| Class E HKD (Unhedged):<br>Erträge       | HKD | 671.221              | HKD 509.914          | HKD 192.869          |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile    |     | 75.399               | 59.152               | 21.739               |
| NIW je Anteil                            | HKD | 8,90                 | HKD 8,62             | HKD 8,87             |

|                                                        |       | Zum<br>30. Jun. 2025       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|--------------------------------------------------------|-------|----------------------------|----------------------|----------------------|
|                                                        |       | Income Fund II (Forts.)    |                      |                      |
| Class E JPY (Hedged):<br>Erträge                       | ¥     | 10.674.927                 | ¥ 10.467.779         | ¥ 38.723             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 11.277                     | 11.055               | 38                   |
| NIW je Anteil                                          | ¥     | 947,00                     | ¥ 947,00             | ¥ 1.029,00           |
|                                                        |       | Inflation Multi-Asset Fund |                      |                      |
| Nettovermögen                                          | \$    | 188.494                    | \$ 178.901           | \$ 253.248           |
| Institutional:                                         |       |                            |                      |                      |
| thesaurierend                                          | \$    | 107.397                    | \$ 94.840            | \$ 87.830            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 8.122                      | 7.683                | 7.446                |
| NIW je Anteil                                          | \$    | 13,22                      | \$ 12,34             | \$ 11,80             |
| Institutional EUR (Partially Hedged):<br>thesaurierend | €     | 11.884                     | € 14.359             | € 28.298             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 1.125                      | 1.402                | 2.902                |
| NIW je Anteil                                          | €     | 10,56                      | € 10,24              | € 9,75               |
| Institutional GBP (Partially Hedged):<br>thesaurierend | £     | 1.512                      | £ 1.438              | £ 3.181              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 115                        | 115                  | 266                  |
| NIW je Anteil                                          | £     | 13,13                      | £ 12,53              | £ 11,96              |
| Administrative:                                        |       |                            |                      |                      |
| ausschüttend II                                        | \$    | 798                        | \$ 1.465             | \$ 1.963             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 86                         | 166                  | 223                  |
| NIW je Anteil                                          | \$    | 9,29                       | \$ 8,83              | \$ 8,78              |
| Administrative SGD (Hedged):<br>ausschüttend II        | SGD   | 2.319                      | SGD 3.067            | SGD 5.209            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 253                        | 345                  | 585                  |
| NIW je Anteil                                          | SGD   | 9,15                       | SGD 8,90             | SGD 8,90             |
| Class E:                                               |       |                            |                      |                      |
| thesaurierend                                          | \$    | 21.932                     | \$ 23.096            | \$ 44.395            |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 1.907                      | 2.141                | 4.268                |
| NIW je Anteil                                          | \$    | 11,50                      | \$ 10,79             | \$ 10,40             |
| ausschüttend II                                        | k. A. |                            | k. A.                | \$ 10                |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | k. A.                      | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                                          | k. A. |                            | k. A.                | \$ 9,35              |
| Class E AUD (Partially Hedged):<br>thesaurierend       |       | k. A.                      | k. A.                | AUD 346              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | k. A.                      | k. A.                | 36                   |
| NIW je Anteil                                          |       | k. A.                      | k. A.                | AUD 9,67             |
| Class E EUR (Partially Hedged):<br>thesaurierend       | €     | 31.155                     | € 34.950             | € 64.630             |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 3.068                      | 3.535                | 6.803                |
| NIW je Anteil                                          | €     | 10,15                      | € 9,89               | € 9,50               |
| Erträge                                                | €     | 3.367                      | € 4.240              | € 7.161              |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | 376                        | 482                  | 833                  |
| NIW je Anteil                                          | €     | 8,96                       | € 8,79               | € 8,59               |
| Class E GBP (Partially Hedged):<br>thesaurierend       |       | k. A.                      | k. A.                | £ 8                  |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | k. A.                      | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                                          |       | k. A.                      | k. A.                | £ 9,69               |
| Class E SGD (Partially Hedged):<br>thesaurierend       |       | k. A.                      | k. A.                | SGD 14               |
| ausgegebene und<br>umlaufende Anteile                  |       | k. A.                      | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                                          |       | k. A.                      | k. A.                | SGD 9,67             |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025                   | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|----------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                       | Inflation Multi-Asset<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| H Institutional:                      |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | k. A.                                  | k. A.                | \$ 10                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | k. A.                                  | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                                  | k. A.                | \$ 10,00             |
| M Retail:                             |                                        |                      |                      |
| ausschüttend II                       | k. A.                                  | k. A.                | \$ 216               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | k. A.                                  | k. A.                | 23                   |
| NIW je Anteil                         | k. A.                                  | k. A.                | \$ 9,47              |
|                                       | Low Average Duration Fund              |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$ 819.050                             | \$ 676.383           | \$ 809.845           |
| Institutional:                        |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 513.780                             | \$ 470.154           | \$ 520.962           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 29.045                                 | 27.399               | 31.818               |
| NIW je Anteil                         | \$ 17,69                               | \$ 17,16             | \$ 16,37             |
| Erträge                               | \$ 28.717                              | \$ 28.141            | \$ 33.698            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 2.796                                  | 2.772                | 3.350                |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,27                               | \$ 10,15             | \$ 10,06             |
| Institutional EUR (Hedged):           |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 8.918                                | € 10.911             | € 23.355             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 848                                    | 1.059                | 2.338                |
| NIW je Anteil                         | € 10,52                                | € 10,30              | € 9,99               |
| Erträge                               | € 230                                  | € 367                | € 3.340              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 33                                     | 52                   | 474                  |
| NIW je Anteil                         | € 7,02                                 | € 7,00               | € 7,05               |
| Institutional GBP (Hedged):           |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | £ 70.454                               | £ 54.287             | £ 17.595             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 6.426                                  | 5.106                | 1.730                |
| NIW je Anteil                         | £ 10,96                                | £ 10,63              | £ 10,17              |
| Erträge                               | £ 11.919                               | £ 3.219              | £ 2.381              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 1.315                                  | 357                  | 264                  |
| NIW je Anteil                         | £ 9,07                                 | £ 9,03               | £ 9,01               |
| Investor:                             |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 7.827                               | \$ 7.980             | \$ 10.761            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 476                                    | 499                  | 703                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 16,44                               | \$ 15,98             | \$ 15,30             |
| Erträge                               | \$ 700                                 | \$ 725               | \$ 1.454             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 69                                     | 72                   | 146                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,19                               | \$ 10,07             | \$ 9,98              |
| Administrative:                       |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 2.051                               | \$ 1.995             | \$ 8.728             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 129                                    | 129                  | 587                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 15,95                               | \$ 15,51             | \$ 14,87             |
| Class E:                              |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 32.551                              | \$ 31.906            | \$ 37.888            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 2.434                                  | 2.449                | 3.020                |
| NIW je Anteil                         | \$ 13,37                               | \$ 13,03             | \$ 12,55             |
| Erträge                               | \$ 3.109                               | \$ 2.979             | \$ 4.074             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 294                                    | 285                  | 393                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,59                               | \$ 10,47             | \$ 10,37             |
| Class E EUR (Hedged):                 |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 12.241                               | € 11.806             | € 15.764             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 1.469                                  | 1.441                | 1.966                |
| NIW je Anteil                         | € 8,33                                 | € 8,19               | € 8,02               |
| H Institutional:                      |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 82.120                              | \$ 31.317            | \$ 113.500           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 6.208                                  | 2.438                | 9.245                |
| NIW je Anteil                         | \$ 13,23                               | \$ 12,85             | \$ 12,28             |
| Erträge                               | \$ 710                                 | \$ 691               | \$ 1.267             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 72                                     | 71                   | 131                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 9,90                                | \$ 9,78              | \$ 9,69              |

|                                       | Zum<br>30. Jun. 2025                                | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                       | Low Average Duration Fund (Forts.)                  |                      |                      |
| Class R:                              |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 9.498                                            | \$ 4.571             | \$ 5.145             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 807                                                 | 399                  | 470                  |
| NIW je Anteil                         | \$ 11,77                                            | \$ 11,43             | \$ 10,94             |
|                                       | Low Duration Global Investment Grade<br>Credit Fund |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$ 1.259.270                                        | \$ 1.084.966         | \$ 972.843           |
| Institutional:                        |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 452.164                                          | \$ 331.273           | \$ 260.504           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 33.799                                              | 25.637               | 21.237               |
| NIW je Anteil                         | \$ 13,38                                            | \$ 12,92             | \$ 12,27             |
| Erträge                               | \$ 50.475                                           | \$ 51.434            | \$ 17.872            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 5.134                                               | 5.306                | 1.864                |
| NIW je Anteil                         | \$ 9,83                                             | \$ 9,69              | \$ 9,59              |
| Institutional EUR (Hedged):           |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 518.388                                           | € 564.775            | € 547.196            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 46.596                                              | 52.078               | 52.295               |
| NIW je Anteil                         | € 11,13                                             | € 10,84              | € 10,46              |
| Erträge                               | k. A.                                               | k. A.                | € 82                 |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | k. A.                                               | k. A.                | 9                    |
| NIW je Anteil                         | k. A.                                               | k. A.                | € 9,15               |
| Institutional GBP (Hedged):           |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | £ 46.938                                            | £ 46.839             | £ 16.669             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 3.761                                               | 3.886                | 1.453                |
| NIW je Anteil                         | £ 12,48                                             | £ 12,05              | £ 11,47              |
| Erträge                               | £ 545                                               | £ 309                | £ 3.766              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 60                                                  | 34                   | 404                  |
| NIW je Anteil                         | £ 9,07                                              | £ 9,10               | £ 9,33               |
| Institutional NOK (Hedged):           |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | NOK 22.200                                          | NOK 23.908           | NOK 29.300           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 193                                                 | 216                  | 276                  |
| NIW je Anteil                         | NOK 114,76                                          | NOK 110,78           | NOK 106,05           |
| Institutional SEK (Hedged):           |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | SEK 307.793                                         | SEK 323.948          | SEK 313.000          |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 2.798                                               | 3.018                | 3.016                |
| NIW je Anteil                         | SEK 110,00                                          | SEK 107,35           | SEK 103,77           |
| Institutional SGD (Hedged):           |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | SGD 24.555                                          | SGD 337              | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 2.387                                               | 34                   | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | SGD 10,29                                           | SGD 10,02            | k. A.                |
| Class E EUR (Hedged):                 |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | € 24.946                                            | € 25.799             | € 27.087             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 2.485                                               | 2.625                | 2.831                |
| NIW je Anteil                         | € 10,04                                             | € 9,83               | € 9,57               |
|                                       | Low Duration Income Fund                            |                      |                      |
| Nettovermögen                         | \$ 3.092.368                                        | \$ 2.925.246         | \$ 2.030.305         |
| Institutional:                        |                                                     |                      |                      |
| thesaurierend                         | \$ 680.821                                          | \$ 379.088           | \$ 234.711           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 51.538                                              | 30.100               | 19.914               |
| NIW je Anteil                         | \$ 13,21                                            | \$ 12,59             | \$ 11,79             |
| Erträge                               | \$ 33.339                                           | \$ 658.832           | \$ 302.944           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile | 3.275                                               | 66.000               | 30.756               |
| NIW je Anteil                         | \$ 10,18                                            | \$ 9,98              | \$ 9,85              |

|                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025                 | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------|-----|--------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                              |     | Low Duration Income<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Institutional AUD (Hedged):  |     |                                      |                      |                      |
| Erträge                      | AUD | 216.795                              | AUD 286.742          | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 21.465                               | 28.928               | k. A.                |
| NIW je Anteil                | AUD | 10,10                                | AUD 9,91             | k. A.                |
| Institutional CHF (Hedged):  |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | CHF | 7.045                                | CHF 1.634            | CHF 61.554           |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 641                                  | 153                  | 5.917                |
| NIW je Anteil                | CHF | 10,98                                | CHF 10,69            | CHF 10,40            |
| Institutional EUR (Hedged):  |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | €   | 817.301                              | € 802.431            | € 715.038            |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 71.106                               | 72.557               | 67.973               |
| NIW je Anteil                | €   | 11,49                                | € 11,06              | € 10,52              |
| Erträge                      | €   | 14.760                               | € 1.658              | € 9                  |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 1.590                                | 180                  | 1                    |
| NIW je Anteil                | €   | 9,28                                 | € 9,19               | € 9,22               |
| Institutional GBP (Hedged):  |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | £   | 239.982                              | £ 227.629            | £ 215.265            |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 19.255                               | 19.162               | 19.315               |
| NIW je Anteil                | £   | 12,46                                | £ 11,88              | £ 11,14              |
| Erträge                      | £   | 1.420                                | £ 81.299             | £ 117.567            |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 149                                  | 8.690                | 12.705               |
| NIW je Anteil                | £   | 9,55                                 | £ 9,36               | £ 9,25               |
| Institutional SGD (Hedged):  |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | SGD | 44.460                               | SGD 30.581           | SGD 19.310           |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 3.774                                | 2.699                | 1.789                |
| NIW je Anteil                | SGD | 11,78                                | SGD 11,33            | SGD 10,79            |
| Erträge                      | SGD | 28.140                               | SGD 21.775           | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 2.796                                | 2.187                | k. A.                |
| NIW je Anteil                | SGD | 10,06                                | SGD 9,96             | k. A.                |
| Administrative EUR (Hedged): |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | €   | 71.824                               | € 14.635             | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 6.637                                | 1.401                | k. A.                |
| NIW je Anteil                | €   | 10,82                                | € 10,44              | k. A.                |
| Class E:                     |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | \$  | 282.857                              | \$ 205.231           | \$ 56.816            |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 22.770                               | 17.252               | 5.058                |
| NIW je Anteil                | \$  | 12,42                                | \$ 11,90             | \$ 11,23             |
| Erträge                      | \$  | 16.766                               | \$ 8.884             | \$ 7.583             |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 1.740                                | 936                  | 802                  |
| NIW je Anteil                | \$  | 9,64                                 | \$ 9,49              | \$ 9,45              |
| Class E EUR (Hedged):        |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | €   | 250.507                              | € 127.998            | € 85.839             |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 23.203                               | 12.267               | 8.571                |
| NIW je Anteil                | €   | 10,80                                | € 10,43              | € 10,01              |
| Erträge                      | €   | 44.261                               | € 28.252             | € 9.989              |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 5.302                                | 3.403                | 1.188                |
| NIW je Anteil                | €   | 8,35                                 | € 8,30               | € 8,41               |
| H Institutional:             |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | \$  | 72.857                               | \$ 37.736            | \$ 17.331            |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 5.967                                | 3.239                | 1.587                |
| NIW je Anteil                | \$  | 12,21                                | \$ 11,65             | \$ 10,92             |
| Erträge                      | \$  | 59.955                               | \$ 21.273            | \$ 3.119             |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 6.046                                | 2.185                | 324                  |
| NIW je Anteil                | \$  | 9,92                                 | \$ 9,74              | \$ 9,62              |
|                              |     | Low Duration Opportunities Fund      |                      |                      |
| Nettovermögen                | \$  | 805.063                              | \$ 843.935           | \$ 787.624           |
| Institutional:               |     |                                      |                      |                      |
| thesaurierend                | \$  | 11.984                               | \$ 95.782            | \$ 93.820            |
| ausgegebene und umlaufende   |     |                                      |                      |                      |
| Anteile                      |     | 913                                  | 7.595                | 8.007                |
| NIW je Anteil                | \$  | 13,12                                | \$ 12,61             | \$ 11,72             |

|                             |    | Zum<br>30. Jun. 2025                        | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|-----------------------------|----|---------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                             |    | Low Duration Opportunities<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                     | \$ | 26.530                                      | \$ 25.981            | \$ 25.780            |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 2.535                                       | 2.535                | 2.619                |
| NIW je Anteil               | \$ | 10,47                                       | \$ 10,25             | \$ 9,84              |
| Institutional EUR (Hedged): |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | €  | 16.672                                      | € 17.170             | € 16.441             |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 1.521                                       | 1.615                | 1.637                |
| NIW je Anteil               | €  | 10,96                                       | € 10,63              | € 10,04              |
| Erträge                     | €  | 266                                         | € 202                | € 219                |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 29                                          | 22                   | 25                   |
| NIW je Anteil               | €  | 9,10                                        | € 9,00               | € 8,78               |
| Institutional GBP (Hedged): |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | £  | 234.133                                     | £ 234.989            | £ 236.099            |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 19.214                                      | 20.073               | 21.651               |
| NIW je Anteil               | £  | 12,19                                       | £ 11,71              | £ 10,90              |
| Erträge                     | £  | 303.792                                     | £ 322.902            | £ 268.433            |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 31.383                                      | 33.652               | 28.510               |
| NIW je Anteil               | £  | 9,68                                        | £ 9,60               | £ 9,42               |
| Investor EUR (Hedged):      |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | €  | 1.416                                       | € 1.616              | € 2.996              |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 137                                         | 161                  | 316                  |
| NIW je Anteil               | €  | 10,30                                       | € 10,01              | € 9,49               |
| Class E EUR (Hedged):       |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | €  | 6.695                                       | € 3.676              | € 2.828              |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 673                                         | 380                  | 307                  |
| NIW je Anteil               | €  | 9,95                                        | € 9,69               | € 9,21               |
| Class Z:                    |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               |    | k. A.                                       | k. A.                | \$ 10                |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | k. A.                                       | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil               |    | k. A.                                       | k. A.                | \$ 9,93              |
|                             |    | Low Duration Opportunities<br>ESG Fund      |                      |                      |
| Nettovermögen               | \$ | 5.704                                       | \$ 5.437             | \$ 5.221             |
| Institutional:              |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | \$ | 5.098                                       | \$ 4.909             | \$ 4.672             |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 447                                         | 447                  | 447                  |
| NIW je Anteil               | \$ | 11,40                                       | \$ 10,98             | \$ 10,45             |
| Erträge                     | \$ | 11                                          | \$ 11                | \$ 10                |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 1                                           | 1                    | 1                    |
| NIW je Anteil               | \$ | 10,23                                       | \$ 10,07             | \$ 10,02             |
| Institutional EUR (Hedged): |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | €  | 247                                         | € 240                | € 233                |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 23                                          | 23                   | 23                   |
| NIW je Anteil               | €  | 10,75                                       | € 10,45              | € 10,11              |
| Erträge                     |    | k. A.                                       | k. A.                | € 9                  |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | k. A.                                       | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil               |    | k. A.                                       | k. A.                | € 9,69               |
| Institutional GBP (Hedged): |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | £  | 222                                         | £ 214                | £ 204                |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 20                                          | 20                   | 20                   |
| NIW je Anteil               | £  | 11,25                                       | £ 10,83              | £ 10,33              |
| Erträge                     |    | k. A.                                       | k. A.                | £ 8                  |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | k. A.                                       | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil               |    | k. A.                                       | k. A.                | £ 9,86               |
|                             |    | PIMCO MLP & Energy Infrastructure<br>Fund   |                      |                      |
| Nettovermögen               | \$ | 175.017                                     | \$ 157.071           | \$ 98.493            |
| Institutional:              |    |                                             |                      |                      |
| thesaurierend               | \$ | 13.899                                      | \$ 14.607            | \$ 13.881            |
| ausgegebene und umlaufende  |    |                                             |                      |                      |
| Anteile                     |    | 821                                         | 912                  | 1.194                |
| NIW je Anteil               | \$ | 16,93                                       | \$ 16,01             | \$ 11,62             |



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025                               | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|----------------------------------------------|-----|----------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                              |     | PIMCO MLP & Energy Infrastructure<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                      | \$  | 13.348                                             | \$ 12.533            | \$ 8.737             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 1.442                                              | 1.384                | 1.274                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 9,25                                               | \$ 9,05              | \$ 6,86              |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 66.813                                             | € 79.144             | € 37.825             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 4.864                                              | 6.028                | 3.910                |
| NIW je Anteil                                | €   | 13,74                                              | € 13,13              | € 9,67               |
| Erträge                                      | €   | 2.175                                              | € 2.105              | € 1.792              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 290                                                | 285                  | 315                  |
| NIW je Anteil                                | €   | 7,49                                               | € 7,40               | € 5,69               |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £   | 3.474                                              | £ 2.475              | £ 1.418              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 241                                                | 181                  | 143                  |
| NIW je Anteil                                | £   | 14,40                                              | £ 13,66              | £ 9,94               |
| Class E:<br>thesaurierend                    | \$  | 364                                                | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 37                                                 | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 9,97                                               | k. A.                | k. A.                |
| Erträge                                      | \$  | 61.664                                             | \$ 42.698            | \$ 20.293            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 7.518                                              | 5.296                | 3.294                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 8,20                                               | \$ 8,06              | \$ 6,16              |
| Class Z:<br>thesaurierend                    |     | k. A.                                              | k. A.                | \$ 10.013            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | k. A.                                              | k. A.                | 674                  |
| NIW je Anteil                                |     | k. A.                                              | k. A.                | \$ 14,87             |
|                                              |     | Mortgage Opportunities Fund                        |                      |                      |
| Nettovermögen                                | \$  | 2.274.551                                          | \$ 1.791.316         | \$ 925.256           |
| Institutional:<br>thesaurierend              | \$  | 1.035.656                                          | \$ 755.405           | \$ 418.366           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 81.484                                             | 61.914               | 36.426               |
| NIW je Anteil                                | \$  | 12,71                                              | \$ 12,20             | \$ 11,49             |
| Erträge                                      | \$  | 80.356                                             | \$ 58.331            | \$ 36.446            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 8.711                                              | 6.440                | 4.056                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 9,22                                               | \$ 9,06              | \$ 8,99              |
| Institutional CAD (Hedged):<br>thesaurierend | CAD | 45.087                                             | CAD 43.621           | CAD 41.430           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 4.206                                              | 4.206                | 4.206                |
| NIW je Anteil                                | CAD | 10,72                                              | CAD 10,37            | CAD 9,85             |
| Institutional CHF (Hedged):<br>thesaurierend | CHF | 1.944                                              | CHF 1.974            | CHF 2.643            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 195                                                | 202                  | 275                  |
| NIW je Anteil                                | CHF | 9,96                                               | CHF 9,76             | CHF 9,59             |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 702.050                                            | € 657.138            | € 251.283            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 65.036                                             | 62.836               | 25.105               |
| NIW je Anteil                                | €   | 10,79                                              | € 10,46              | € 10,01              |
| Erträge                                      | €   | 6.812                                              | € 7.551              | € 9.804              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 871                                                | 974                  | 1.252                |
| NIW je Anteil                                | €   | 7,82                                               | € 7,75               | € 7,83               |
| Institutional GBP (Hedged):<br>thesaurierend | £   | 5.359                                              | £ 5.170              | £ 4.831              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 451                                                | 453                  | 449                  |
| NIW je Anteil                                | £   | 11,89                                              | £ 11,41              | £ 10,76              |
| Erträge                                      | £   | 22.028                                             | £ 19.137             | £ 10.837             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 2.557                                              | 2.263                | 1.289                |
| NIW je Anteil                                | £   | 8,61                                               | £ 8,46               | £ 8,40               |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$  | 24.439                                             | \$ 23.016            | \$ 19.812            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 2.022                                              | 1.980                | 1.804                |
| NIW je Anteil                                | \$  | 12,09                                              | \$ 11,62             | \$ 10,98             |

|                                                |    | Zum<br>30. Jun. 2025                    | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------------------------|----|-----------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                                |    | Mortgage Opportunities<br>Fund (Forts.) |                      |                      |
| Erträge                                        | \$ | 6.139                                   | \$ 5.820             | \$ 5.989             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 666                                     | 643                  | 666                  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 9,22                                    | \$ 9,06              | \$ 8,99              |
| Class E:<br>thesaurierend                      | \$ | 90.282                                  | \$ 86.519            | \$ 59.228            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 7.658                                   | 7.611                | 5.485                |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 11,79                                   | \$ 11,37             | \$ 10,80             |
| Erträge                                        | \$ | 16.128                                  | \$ 16.130            | \$ 11.408            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 1.751                                   | 1.783                | 1.271                |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 9,21                                    | \$ 9,04              | \$ 8,97              |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend         | €  | 13.716                                  | € 13.179             | € 10.172             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 1.371                                   | 1.354                | 1.082                |
| NIW je Anteil                                  | €  | 10,00                                   | € 9,74               | € 9,40               |
| H Institutional:<br>thesaurierend              | \$ | 71.218                                  | \$ 53.624            | \$ 3.119             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 6.109                                   | 4.788                | 295                  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 11,66                                   | \$ 11,20             | \$ 10,56             |
| Erträge                                        | \$ | 819                                     | \$ 518               | \$ 935               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 77                                      | 50                   | 91                   |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 10,59                                   | \$ 10,41             | \$ 10,32             |
| Class Z:<br>thesaurierend                      | \$ | 28.299                                  | \$ 27.071            | \$ 15.772            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 2.402                                   | 2.402                | 1.497                |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 11,78                                   | \$ 11,27             | \$ 10,54             |
|                                                |    | StocksPLUS <sup>TM</sup> Fund           |                      |                      |
| Nettovermögen                                  | \$ | 5.323.844                               | \$ 5.022.355         | \$ 1.962.988         |
| Institutional:<br>thesaurierend                | \$ | 4.278.441                               | \$ 3.903.688         | \$ 1.336.603         |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 54.768                                  | 52.923               | 22.608               |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 78,12                                   | \$ 73,76             | \$ 59,12             |
| Erträge                                        | \$ | 40.705                                  | \$ 38.395            | \$ 33.385            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 800                                     | 782                  | 811                  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 50,87                                   | \$ 49,10             | \$ 41,15             |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend   | €  | 130.008                                 | € 144.766            | € 135.929            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 3.085                                   | 3.597                | 4.150                |
| NIW je Anteil                                  | €  | 42,15                                   | € 40,24              | € 32,75              |
| Institutional EUR (Unhedged):<br>thesaurierend | €  | 70.191                                  | € 5.318              | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 6.383                                   | 452                  | k. A.                |
| NIW je Anteil                                  | €  | 11,00                                   | € 11,77              | k. A.                |
| Investor:<br>thesaurierend                     | \$ | 9.208                                   | \$ 52.720            | \$ 26.850            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 129                                     | 781                  | 494                  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 71,37                                   | \$ 67,52             | \$ 54,31             |
| BE Retail:<br>thesaurierend                    | \$ | 64.174                                  | \$ 42.924            | \$ 6.299             |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 4.584                                   | 3.234                | 588                  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 14,00                                   | \$ 13,27             | \$ 10,72             |
| Class E:<br>thesaurierend                      | \$ | 326.682                                 | \$ 305.598           | \$ 214.093           |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 4.946                                   | 4.878                | 4.225                |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 66,05                                   | \$ 62,64             | \$ 50,67             |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend         | €  | 52.416                                  | € 57.554             | € 101.366            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 2.516                                   | 2.880                | 6.177                |
| NIW je Anteil                                  | €  | 20,83                                   | € 19,98              | € 16,41              |
| H Institutional:<br>thesaurierend              | \$ | 308.092                                 | \$ 464.021           | \$ 83.630            |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 15.857                                  | 25.267               | 5.672                |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 19,43                                   | \$ 18,36             | \$ 14,74             |

|                                    |     | Zum<br>30. Jun. 2025                   | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------------|-----|----------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                    |     | StocksPLUS <sup>TM</sup> Fund (Forts.) |                      |                      |
| M Retail:                          |     |                                        |                      |                      |
| ausschüttend II                    | \$  | 11                                     | k. A.                | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1                                      | k. A.                | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 10,32                                  | k. A.                | k. A.                |
| Nettovermögen                      | \$  | 10.462                                 | \$ 10.118            | \$ 11.175            |
| Institutional:                     |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 10.462                                 | \$ 10.118            | \$ 11.175            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 438                                    | 452                  | 625                  |
| NIW je Anteil                      | \$  | 23,87                                  | \$ 22,40             | \$ 17,89             |
| Nettovermögen                      | \$  | 2.441.981                              | \$ 2.318.366         | \$ 449.949           |
| Institutional:                     |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 35.146                                 | \$ 36.013            | \$ 20.423            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 2.467                                  | 2.720                | 1.656                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 14,25                                  | \$ 13,24             | \$ 12,33             |
| ausschüttend II                    | \$  | 4.590                                  | \$ 4.376             | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 448                                    | 448                  | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 10,24                                  | \$ 9,76              | k. A.                |
| Institutional EUR (Hedged):        |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 691.322                                | € 729.868            | € 143.972            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 44.650                                 | 49.762               | 10.480               |
| NIW je Anteil                      | €   | 15,48                                  | € 14,67              | € 13,74              |
| Institutional GBP (Hedged):        |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | £   | 211.850                                | £ 258.188            | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 19.852                                 | 25.775               | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | £   | 10,67                                  | £ 10,02              | k. A.                |
| Erträge                            | £   | 1.179                                  | £ 1.326              | £ 219                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 110                                    | 129                  | 22                   |
| NIW je Anteil                      | £   | 10,75                                  | £ 10,31              | £ 10,01              |
| Institutional ILS (Hedged):        |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | ILS | 19.369                                 | ILS 20.953           | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.828                                  | 2.099                | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | ILS | 10,60                                  | ILS 9,98             | k. A.                |
| Institutional SGD (Hedged):        |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | SGD | 91.606                                 | SGD 86.507           | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 8.705                                  | 8.682                | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | SGD | 10,52                                  | SGD 9,96             | k. A.                |
| Investor EUR (Hedged):             |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 6.092                                  | € 5.403              | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 580                                    | 542                  | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | €   | 10,50                                  | € 9,96               | k. A.                |
| Class E:                           |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 135.753                                | \$ 123.917           | \$ 33.466            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 8.235                                  | 8.052                | 2.314                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 16,49                                  | \$ 15,39             | \$ 14,46             |
| ausschüttend II                    | \$  | 38.724                                 | \$ 32.371            | \$ 17.325            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 3.905                                  | 3.409                | 1.838                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 9,92                                   | \$ 9,50              | \$ 9,42              |
| Class E EUR (Hedged):              |     |                                        |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 669.731                                | € 711.925            | € 111.233            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 48.071                                 | 53.703               | 8.879                |
| NIW je Anteil                      | €   | 13,93                                  | € 13,26              | € 12,53              |
| ausschüttend II                    | €   | 81.380                                 | € 74.371             | € 66.793             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 9.757                                  | 9.141                | 8.196                |
| NIW je Anteil                      | €   | 8,34                                   | € 8,14               | € 8,15               |
| M Retail:                          |     |                                        |                      |                      |
| ausschüttend II                    | \$  | 17.832                                 | \$ 19.655            | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.754                                  | 2.018                | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 10,17                                  | \$ 9,74              | k. A.                |

|                                    |     | Zum<br>30. Jun. 2025           | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------------|-----|--------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                    |     | Strategic Income Fund (Forts.) |                      |                      |
| M Retail SGD (Hedged):             |     |                                |                      |                      |
| ausschüttend II                    | SGD | 5.499                          | SGD 6.154            | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 543                            | 627                  | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | SGD | 10,14                          | SGD 9,81             | k. A.                |
| Class T EUR (Hedged):              |     |                                |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 58.325                         | € 62.309             | € 13.470             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 4.738                          | 5.309                | 1.209                |
| NIW je Anteil                      | €   | 12,31                          | € 11,74              | € 11,14              |
| Erträge                            | €   | 10.177                         | € 8.974              | € 7.135              |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.071                          | 975                  | 789                  |
| NIW je Anteil                      | €   | 9,50                           | € 9,20               | € 9,05               |
| Class Z EUR (Hedged):              |     |                                |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 47.073                         | € 52.100             | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 4.397                          | 5.158                | k. A.                |
| NIW je Anteil                      | €   | 10,71                          | € 10,10              | k. A.                |
| Nettovermögen                      | \$  | 4.125.217                      | \$ 4.003.163         | \$ 4.420.051         |
| Institutional:                     |     |                                |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 1.475.044                      | \$ 1.451.787         | \$ 1.615.253         |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 44.531                         | 45.992               | 52.631               |
| NIW je Anteil                      | \$  | 33,12                          | \$ 31,57             | \$ 30,69             |
| Erträge                            | \$  | 158.348                        | \$ 156.516           | \$ 125.064           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 10.274                         | 10.457               | 8.283                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 15,41                          | \$ 14,97             | \$ 15,10             |
| Institutional CAD (Hedged):        |     |                                |                      |                      |
| Erträge                            | CAD | 10.895                         | CAD 13.701           | CAD 12.612           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.247                          | 1.603                | 1.448                |
| NIW je Anteil                      | CAD | 8,74                           | CAD 8,55             | CAD 8,71             |
| Institutional CHF (Hedged):        |     |                                |                      |                      |
| thesaurierend                      | CHF | 1.494                          | CHF 2.644            | CHF 6.050            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 148                            | 270                  | 608                  |
| NIW je Anteil                      | CHF | 10,07                          | CHF 9,80             | CHF 9,96             |
| Institutional EUR (Hedged):        |     |                                |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 261.759                        | € 324.321            | € 393.477            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 12.390                         | 15.969               | 19.584               |
| NIW je Anteil                      | €   | 21,13                          | € 20,31              | € 20,09              |
| Erträge                            | €   | 176.613                        | € 198.569            | € 215.481            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 15.080                         | 17.318               | 18.302               |
| NIW je Anteil                      | €   | 11,71                          | € 11,47              | € 11,77              |
| Institutional EUR (Unhedged):      |     |                                |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 4.560                          | € 5.518              | € 7.459              |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 162                            | 181                  | 269                  |
| NIW je Anteil                      | €   | 28,22                          | € 30,48              | € 27,78              |
| Institutional GBP (Hedged):        |     |                                |                      |                      |
| thesaurierend                      | £   | 10.457                         | £ 8.630              | £ 7.797              |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 754                            | 653                  | 605                  |
| NIW je Anteil                      | £   | 13,88                          | £ 13,21              | £ 12,89              |
| Erträge                            | £   | 11.432                         | £ 16.802             | £ 19.631             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.349                          | 2.044                | 2.347                |
| NIW je Anteil                      | £   | 8,47                           | £ 8,22               | £ 8,36               |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

|                                    |     | Zum<br>30. Jun. 2025            | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------------|-----|---------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                    |     | Total Return Bond Fund (Forts.) |                      |                      |
| Institutional SGD (Hedged):        |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | SGD | 7.179                           | SGD 6.952            | SGD 7.871            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 537                             | 541                  | 618                  |
| NIW je Anteil                      | SGD | 13,36                           | SGD 12,84            | SGD 12,73            |
| Investor:                          |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 277.977                         | \$ 328.398           | \$ 352.467           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 9.219                           | 11.409               | 12.551               |
| NIW je Anteil                      | \$  | 30,15                           | \$ 28,78             | \$ 28,08             |
| Erträge                            | \$  | 26.908                          | \$ 35.384            | \$ 50.617            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.721                           | 2.331                | 3.305                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 15,63                           | \$ 15,18             | \$ 15,31             |
| Investor CHF (Hedged):             |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | CHF | 1.700                           | CHF 1.732            | CHF 2.342            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 177                             | 185                  | 246                  |
| NIW je Anteil                      | CHF | 9,59                            | CHF 9,35             | CHF 9,53             |
| Investor EUR (Hedged):             |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 11.627                          | € 16.422             | € 17.085             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 591                             | 867                  | 909                  |
| NIW je Anteil                      | €   | 19,67                           | € 18,94              | € 18,80              |
| Administrative:                    |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 105.272                         | \$ 112.282           | \$ 128.181           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 3.549                           | 3.963                | 4.630                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 29,66                           | \$ 28,34             | \$ 27,69             |
| Erträge                            | \$  | 25.930                          | \$ 36.194            | \$ 51.477            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 2.597                           | 3.733                | 5.263                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 9,98                            | \$ 9,70              | \$ 9,78              |
| Administrative EUR (Hedged):       |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 2.255                           | € 2.452              | € 2.760              |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 193                             | 218                  | 246                  |
| NIW je Anteil                      | €   | 11,69                           | € 11,26              | € 11,20              |
| Administrative SGD (Hedged):       |     |                                 |                      |                      |
| Erträge                            |     | k. A.                           | k. A.                | SGD 14               |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | k. A.                           | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                      |     | k. A.                           | k. A.                | SGD 10,06            |
| Class E:                           |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 341.985                         | \$ 367.900           | \$ 407.981           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 12.279                          | 13.800               | 15.599               |
| NIW je Anteil                      | \$  | 27,85                           | \$ 26,66             | \$ 26,15             |
| Erträge                            | \$  | 132.172                         | \$ 130.807           | \$ 139.042           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 11.271                          | 11.486               | 12.101               |
| NIW je Anteil                      | \$  | 11,73                           | \$ 11,39             | \$ 11,49             |
| Class E CHF (Hedged):              |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | CHF | 11.639                          | CHF 11.525           | CHF 10.506           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.387                           | 1.406                | 1.250                |
| NIW je Anteil                      | CHF | 8,39                            | CHF 8,20             | CHF 8,40             |
| Class E EUR (Hedged):              |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 339.244                         | € 358.418            | € 433.274            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 19.083                          | 20.880               | 25.285               |
| NIW je Anteil                      | €   | 17,78                           | € 17,17              | € 17,14              |
| Erträge                            | €   | 26.477                          | € 29.043             | € 34.883             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 3.391                           | 3.798                | 4.443                |
| NIW je Anteil                      | €   | 7,81                            | € 7,65               | € 7,85               |
| Class E SGD (Hedged):              |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | SGD | 29.292                          | SGD 30.510           | SGD 32.839           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 752                             | 812                  | 874                  |
| NIW je Anteil                      | SGD | 38,94                           | SGD 37,58            | SGD 37,59            |
| H Institutional:                   |     |                                 |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 498.063                         | \$ 297.756           | \$ 197.186           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 15.586                          | 9.769                | 6.643                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 31,96                           | \$ 30,48             | \$ 29,68             |
| Erträge                            | \$  | 10.581                          | \$ 10.300            | \$ 10.522            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.120                           | 1.123                | 1.137                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 9,45                            | \$ 9,18              | \$ 9,26              |

|                                    |     | Zum<br>30. Jun. 2025                       | Zum<br>31. Dez. 2024 | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|------------------------------------|-----|--------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                                    |     | Total Return Bond Fund (Forts.)            |                      |                      |
| M Retail HKD (Unhedged):           |     |                                            |                      |                      |
| Erträge                            | HKD | 78.982                                     | HKD 77.701           | HKD 84.232           |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 8.477                                      | 8.676                | 9.270                |
| NIW je Anteil                      | HKD | 9,32                                       | HKD 8,96             | HKD 9,09             |
| Class R EUR (Hedged):              |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 2.357                                      | € 2.266              | € 2.254              |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 236                                        | 236                  | 236                  |
| NIW je Anteil                      | €   | 9,99                                       | € 9,62               | € 9,54               |
| Class T:                           |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 4.425                                      | \$ 4.771             | \$ 5.824             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 406                                        | 457                  | 567                  |
| NIW je Anteil                      | \$  | 10,89                                      | \$ 10,44             | \$ 10,27             |
| Class T EUR (Hedged):              |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 4.177                                      | € 4.256              | € 4.804              |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 462                                        | 487                  | 549                  |
| NIW je Anteil                      | €   | 9,04                                       | € 8,75               | € 8,76               |
|                                    |     | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |                      |                      |
| Nettovermögen                      | \$  | 103.060                                    | \$ 219.485           | \$ 240.346           |
| Institutional:                     |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 51.216                                     | \$ 96.840            | \$ 92.466            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 4.692                                      | 8.129                | 7.501                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 10,91                                      | \$ 11,91             | \$ 12,33             |
| Institutional EUR (Hedged):        |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 7.935                                      | € 25.832             | € 5.945              |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 858                                        | 2.535                | 555                  |
| NIW je Anteil                      | €   | 9,24                                       | € 10,19              | € 10,71              |
| Institutional GBP (Hedged):        |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      |     | k. A.                                      | k. A.                | £ 245                |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | k. A.                                      | k. A.                | 26                   |
| NIW je Anteil                      |     | k. A.                                      | k. A.                | £ 9,51               |
| Erträge                            | £   | 541                                        | £ 30.058             | £ 46.771             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 103                                        | 3.708                | 5.378                |
| NIW je Anteil                      | £   | 5,25                                       | £ 8,11               | £ 8,70               |
| Investor:                          |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      |     | k. A.                                      | k. A.                | \$ 4.741             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | k. A.                                      | k. A.                | 523                  |
| NIW je Anteil                      |     | k. A.                                      | k. A.                | \$ 9,06              |
| Investor EUR (Hedged):             |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      |     | k. A.                                      | k. A.                | € 9                  |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | k. A.                                      | k. A.                | 1                    |
| NIW je Anteil                      |     | k. A.                                      | k. A.                | € 8,87               |
| Class E:                           |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 7.641                                      | \$ 12.507            | \$ 12.105            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 781                                        | 1.165                | 1.078                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 9,78                                       | \$ 10,74             | \$ 11,23             |
| Class E EUR (Hedged):              |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | €   | 4.955                                      | € 6.435              | € 12.722             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 599                                        | 701                  | 1.305                |
| NIW je Anteil                      | €   | 8,28                                       | € 9,18               | € 9,75               |
| H Institutional:                   |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 1.591                                      | \$ 1.405             | \$ 877               |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 185                                        | 149                  | 90                   |
| NIW je Anteil                      | \$  | 8,61                                       | \$ 9,41              | \$ 9,76              |
| Class Z:                           |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | \$  | 26.740                                     | \$ 37.674            | \$ 49.591            |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 2.706                                      | 3.516                | 4.534                |
| NIW je Anteil                      | \$  | 9,88                                       | \$ 10,72             | \$ 10,94             |
|                                    |     | UK Corporate Bond Fund                     |                      |                      |
| Nettovermögen                      | £   | 210.914                                    | £ 213.133            | £ 361.061            |
| Institutional:                     |     |                                            |                      |                      |
| thesaurierend                      | £   | 29.143                                     | £ 34.693             | £ 43.923             |
| ausgegebene und umlaufende Anteile |     | 1.387                                      | 1.711                | 2.210                |
| NIW je Anteil                      | £   | 21,01                                      | £ 20,27              | £ 19,87              |

|                                       |    | Zum<br>30. Jun. 2025                |    | Zum<br>31. Dez. 2024 |    | Zum<br>31. Dez. 2023 |
|---------------------------------------|----|-------------------------------------|----|----------------------|----|----------------------|
|                                       |    | UK Corporate Bond<br>Fund (Forts.)  |    |                      |    |                      |
| Erträge                               | £  | 34.760                              | £  | 40.899               | £  | 245.303              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 4.130                               |    | 4.772                |    | 27.741               |
| NIW je Anteil                         | £  | 8,42                                | £  | 8,57                 | £  | 8,84                 |
| H Institutional:                      |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | £  | 98.224                              | £  | 90.571               |    | k. A.                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 9.802                               |    | 9.165                |    | k. A.                |
| NIW je Anteil                         | £  | 10,02                               | £  | 9,88                 |    | k. A.                |
| Class Z:                              |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | £  | 48.787                              | £  | 46.970               | £  | 71.835               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 4.924                               |    | 4.924                |    | 7.715                |
| NIW je Anteil                         | £  | 9,91                                | £  | 9,54                 | £  | 9,31                 |
|                                       |    | UK Long Term Corporate<br>Bond Fund |    |                      |    |                      |
| Nettovermögen                         | £  | 33.848                              | £  | 114.440              | £  | 324.768              |
| Institutional:                        |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | £  | 32.745                              | £  | 84.533               |    | 286.707              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 1.508                               |    | 4.040                |    | 13.320               |
| NIW je Anteil                         | £  | 21,71                               | £  | 20,92                | £  | 21,52                |
| Erträge                               | £  | 1.103                               | £  | 29.907               | £  | 38.061               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 100                                 |    | 2.733                |    | 3.228                |
| NIW je Anteil                         | £  | 11,07                               | £  | 10,95                | £  | 11,79                |
|                                       |    | US High Yield Bond Fund             |    |                      |    |                      |
| Nettovermögen                         | \$ | 1.646.486                           | \$ | 1.714.223            | \$ | 1.872.887            |
| Institutional:                        |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | \$ | 664.052                             | \$ | 651.744              | \$ | 681.351              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 14.569                              |    | 14.918               |    | 16.860               |
| NIW je Anteil                         | \$ | 45,58                               | \$ | 43,69                | \$ | 40,41                |
| Erträge                               | \$ | 57.894                              | \$ | 146.993              | \$ | 215.871              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 6.338                               |    | 16.251               |    | 24.177               |
| NIW je Anteil                         | \$ | 9,13                                | \$ | 9,05                 | \$ | 8,93                 |
| Institutional EUR (Hedged):           |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | €  | 238.648                             | €  | 246.494              | €  | 219.196              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 7.212                               |    | 7.701                |    | 7.285                |
| NIW je Anteil                         | €  | 33,09                               | €  | 32,01                | €  | 30,09                |
| Erträge                               | €  | 3.315                               | €  | 4.120                | €  | 21.347               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 334                                 |    | 415                  |    | 2.144                |
| NIW je Anteil                         | €  | 9,94                                | €  | 9,92                 | €  | 9,96                 |
| Institutional GBP (Hedged):           |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | £  | 15.753                              | £  | 13.635               | £  | 30.402               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 596                                 |    | 538                  |    | 1.294                |
| NIW je Anteil                         | £  | 26,43                               | £  | 25,33                | £  | 23,49                |
| Erträge                               | £  | 2.904                               | £  | 2.934                | £  | 2.283                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 336                                 |    | 342                  |    | 269                  |
| NIW je Anteil                         | £  | 8,65                                | £  | 8,57                 | £  | 8,48                 |
| Investor:                             |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | \$ | 224.671                             | \$ | 230.775              | \$ | 240.439              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 5.571                               |    | 5.959                |    | 6.689                |
| NIW je Anteil                         | \$ | 40,33                               | \$ | 38,73                | \$ | 35,95                |
| Erträge                               | \$ | 9.928                               | \$ | 11.084               | \$ | 17.026               |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 1.344                               |    | 1.514                |    | 2.356                |
| NIW je Anteil                         | \$ | 7,39                                | \$ | 7,32                 | \$ | 7,23                 |
| Investor EUR (Hedged):                |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | €  | 11.020                              | €  | 11.090               | €  | 2.811                |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 372                                 |    | 387                  |    | 104                  |
| NIW je Anteil                         | €  | 29,59                               | €  | 28,67                | €  | 27,04                |
| Class E:                              |    |                                     |    |                      |    |                      |
| thesaurierend                         | \$ | 141.446                             | \$ | 131.905              | \$ | 130.888              |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile |    | 3.688                               |    | 3.572                |    | 3.797                |
| NIW je Anteil                         | \$ | 38,35                               | \$ | 36,93                | \$ | 34,47                |

|                                                |    | Zum<br>30. Jun. 2025                       |    | Zum<br>31. Dez. 2024 |    | Zum<br>31. Dez. 2023 |  |
|------------------------------------------------|----|--------------------------------------------|----|----------------------|----|----------------------|--|
|                                                |    | US High Yield Bond<br>Fund (Forts.)        |    |                      |    |                      |  |
| Erträge                                        | \$ | 49.816                                     | \$ | 51.251               | \$ | 68.093               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 5.112                                      |    | 5.310                |    | 7.147                |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 9,74                                       | \$ | 9,65                 | \$ | 9,53                 |  |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend         | €  | 46.663                                     | €  | 47.953               | €  | 50.468               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 1.678                                      |    | 1.775                |    | 1.969                |  |
| NIW je Anteil                                  | €  | 27,81                                      | €  | 27,02                | €  | 25,63                |  |
| H Institutional:<br>thesaurierend              | \$ | 97.670                                     | \$ | 116.900              | \$ | 114.190              |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 2.225                                      |    | 2.776                |    | 2.926                |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 43,90                                      | \$ | 42,12                | \$ | 39,02                |  |
| Erträge                                        | \$ | 9.075                                      | \$ | 8.968                | \$ | 5.515                |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 1.005                                      |    | 1.003                |    | 625                  |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 9,03                                       | \$ | 8,95                 | \$ | 8,83                 |  |
| M Retail:<br>Erträge                           | \$ | 3.021                                      | \$ | 3.658                | \$ | 16.293               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 306                                        |    | 374                  |    | 1.687                |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 9,87                                       | \$ | 9,77                 | \$ | 9,66                 |  |
| Class R:<br>thesaurierend                      | \$ | 2.541                                      | \$ | 3.465                | \$ | 4.113                |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 142                                        |    | 201                  |    | 258                  |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 17,92                                      | \$ | 17,20                | \$ | 15,95                |  |
| Class Z:<br>thesaurierend                      | \$ | 9.065                                      | \$ | 16.079               | \$ | 12.870               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 544                                        |    | 1.010                |    | 879                  |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 16,66                                      | \$ | 15,92                | \$ | 14,65                |  |
|                                                |    | US Investment Grade Corporate<br>Bond Fund |    |                      |    |                      |  |
| Nettovermögen                                  | \$ | 474.057                                    | \$ | 493.892              | \$ | 480.861              |  |
| Institutional:<br>thesaurierend                | \$ | 190.519                                    | \$ | 206.607              | \$ | 232.236              |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 15.405                                     |    | 17.450               |    | 20.229               |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 12,37                                      | \$ | 11,84                | \$ | 11,48                |  |
| Erträge                                        | \$ | 42.177                                     | \$ | 56.595               | \$ | 66.032               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 4.691                                      |    | 6.429                |    | 7.392                |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 8,99                                       | \$ | 8,80                 | \$ | 8,93                 |  |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend   | €  | 120.710                                    | €  | 126.670              | €  | 80.273               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 11.739                                     |    | 12.751               |    | 8.188                |  |
| NIW je Anteil                                  | €  | 10,28                                      | €  | 9,93                 | €  | 9,80                 |  |
| Institutional GBP (Hedged):<br>ausschüttend II | £  | 19.921                                     | £  | 19.008               | £  | 27.296               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 2.546                                      |    | 2.479                |    | 3.477                |  |
| NIW je Anteil                                  | £  | 7,82                                       | £  | 7,67                 | £  | 7,85                 |  |
| Class E:<br>thesaurierend                      | \$ | 58.754                                     | \$ | 62.235               | \$ | 49.311               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 5.878                                      |    | 6.475                |    | 5.243                |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 10,00                                      | \$ | 9,61                 | \$ | 9,40                 |  |
| Erträge                                        | \$ | 7.900                                      | \$ | 9.033                | \$ | 7.652                |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 866                                        |    | 1.011                |    | 844                  |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 9,13                                       | \$ | 8,94                 | \$ | 9,07                 |  |
| H Institutional:<br>thesaurierend              | \$ | 5.713                                      | \$ | 4.449                | \$ | 2.160                |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 504                                        |    | 409                  |    | 204                  |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 11,34                                      | \$ | 10,87                | \$ | 10,56                |  |
|                                                |    | US Short-Term Fund                         |    |                      |    |                      |  |
| Nettovermögen                                  | \$ | 2.560.236                                  | \$ | 2.330.264            | \$ | 1.854.206            |  |
| Institutional:<br>thesaurierend                | \$ | 802.847                                    | \$ | 832.805              | \$ | 573.993              |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile          |    | 61.532                                     |    | 65.309               |    | 47.741               |  |
| NIW je Anteil                                  | \$ | 13,05                                      | \$ | 12,75                | \$ | 12,02                |  |

|                                              |     | Zum<br>30. Jun. 2025        |     | Zum<br>31. Dez. 2024 |    | Zum<br>31. Dez. 2023 |  |
|----------------------------------------------|-----|-----------------------------|-----|----------------------|----|----------------------|--|
|                                              |     | US Short-Term Fund (Forts.) |     |                      |    |                      |  |
| Erträge                                      | \$  | 110.819                     | \$  | 108.351              | \$ | 123.753              |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 10.906                      |     | 10.672               |    | 12.302               |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,16                       | \$  | 10,15                | \$ | 10,06                |  |
| Institutional AUD (Hedged):<br>Erträge       | AUD | 167.096                     | AUD | 182.601              |    | k. A.                |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 16.708                      |     | 18.256               |    | k. A.                |  |
| NIW je Anteil                                | AUD | 10,00                       | AUD | 10,00                |    | k. A.                |  |
| Institutional EUR (Hedged):<br>thesaurierend | €   | 127.695                     | €   | 64.127               | €  | 68.515               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 11.723                      |     | 5.970                |    | 6.659                |  |
| NIW je Anteil                                | €   | 10,89                       | €   | 10,74                | €  | 10,29                |  |
| Institutional GBP (Hedged):<br>Erträge       | £   | 2.697                       | £   | 12.889               | £  | 207                  |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 265                         |     | 1.270                |    | 21                   |  |
| NIW je Anteil                                | £   | 10,17                       | £   | 10,15                | £  | 10,07                |  |
| Investor:<br>thesaurierend                   | \$  | 8.072                       | \$  | 8.024                | \$ | 7.368                |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 643                         |     | 653                  |    | 633                  |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 12,56                       | \$  | 12,29                | \$ | 11,63                |  |
| Class E:<br>thesaurierend                    | \$  | 602.807                     | \$  | 492.046              | \$ | 412.185              |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 48.224                      |     | 40.200               |    | 35.571               |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 12,50                       | \$  | 12,24                | \$ | 11,59                |  |
| Class E EUR (Hedged):<br>thesaurierend       | €   | 27.490                      | €   | 20.113               | €  | 18.008               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 2.645                       |     | 1.958                |    | 1.824                |  |
| NIW je Anteil                                | €   | 10,39                       | €   | 10,27                | €  | 9,88                 |  |
| H Institutional:<br>thesaurierend            | \$  | 34.576                      | \$  | 28.161               | \$ | 18.000               |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 2.900                       |     | 2.415                |    | 1.634                |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 11,92                       | \$  | 11,66                | \$ | 11,01                |  |
| Class Z:<br>Erträge                          | \$  | 705.749                     | \$  | 644.446              | \$ | 623.066              |  |
| ausgegebene und umlaufende<br>Anteile        |     | 69.082                      |     | 63.135               |    | 61.599               |  |
| NIW je Anteil                                | \$  | 10,22                       | \$  | 10,21                | \$ | 10,11                |  |

## 17. VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft wendet eine Vergütungspolitik an, die den geltenden OGAW-Anforderungen entspricht, die im Verkaufsprospekt zusammengefasst ist.

Nähere Einzelheiten zur Vergütung der Gesellschaft sowie entsprechende finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2025 bereitgestellt.

## 18. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorangehenden Ausführungen beziehen sich nur auf den Stand vom 30. Juni 2025.

## 19. KREDITFAZILITÄT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc hat im Namen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, des Global High Yield Bond Fund und des US High Yield Bond Fund (zusammen die „Fonds“ und jeweils ein „Fonds“) am 16. August 2024 eine fünfte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Kreditvereinbarung“) zwischen u. a. den Fonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als Kreditgeber) zählt, und MUFG (als Agent und Lead Arranger) abgeschlossen.

Jeder Fonds darf die Fazilität gemäß der jeweiligen Anlagepolitik des Fonds für temporäre Zwecke nutzen.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Fonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf 211.000.000 USD.

Die Zwischenobergrenzen für die einzelnen Fonds sind: PIMCO Asia High Yield Bond Fund – 67.000.000 USD; Global High Yield Bond Fund – 90.000.000 USD und US High Yield Bond Fund – 54.000.000 USD. Der Gesamtbetrag, der den Fonds zusammen mit den anderen Kreditnehmern (zusammen die „Kreditnehmer“) zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung auf 227.000.000 USD (der „insgesamt zugesagte Betrag“). Die Kreditnehmer können vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung um bis zu 373.000.000 USD des insgesamt zugesagten Betrags beantragen (bis zu einem erhöhten zugesagten Betrag von maximal 600.000.000 USD). Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Fonds selbst, welcher Zinssatz für das gesamte Darlehen oder einen Teil davon gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz) oder (ii) der Adjusted Daily Simple SOFR (angepasster täglicher einfacher SOFR) bestimmt.

Der alternative Basiszinssatz ist für jeden Tag die an diesem Tag geltende (i) Federal Funds Rate (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) oder (ii) Overnight Bank Funding Rate (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung), je nachdem, welcher Wert höher ist. Für jeden unter Bezugnahme auf den alternativen Basiszinssatz berechneten Kredit mit Zinsen sind Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag dieses Kredits für den Zeitraum zu zahlen, der mit dem Datum beginnt, an dem der Kredit gewährt wird, bis zu, jedoch nicht einschließlich, dem Datum, an dem der Kredit vollständig zurückgezahlt wird, zu einem Satz pro Jahr, der dem alternativen Basiszinssatz zuzüglich der geltenden Marge entspricht (1,125 %).

Der Adjusted Daily Simple SOFR ist ein Zinssatz pro Jahr, gleich (a) dem Daily Simple SOFR (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) zuzüglich (b) 0,10 %. Für jeden unter Bezugnahme auf den Adjusted Daily Simple SOFR berechneten Kredit mit Zinsen sind Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag dieses Kredits für den Zeitraum zu zahlen, der mit dem Datum beginnt, an dem der Kredit gewährt oder weitergeführt wird, bis zu einschließlich dem Datum, an dem der Kredit vollständig zurückgezahlt wird, zu einem Satz pro Jahr, der dem Adjusted Daily Simple SOFR zuzüglich der geltenden Marge entspricht (1,125 %).

Ein Kredit ist vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung 60 Tage nach Inanspruchnahme oder am 15. August 2025 zurückzuzahlen, je nachdem, welcher Termin früher eintritt, es sei denn, er ist gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung früher zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 hatte keiner der Fonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

## 20. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Richtlinie über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFTs“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte,
- Wertpapier- oder Warenleihgeschäfte,
- Kauf-/Rückverkaufsgeschäfte oder Verkauf-/Rückkaufgeschäfte, oder
- Lombardgeschäfte.

### (a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. Juni 2025 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Verkauf-/Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 30. Juni 2025 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

| Fonds                                        | 30. Jun. 2025       |                         |
|----------------------------------------------|---------------------|-------------------------|
|                                              | Marktwert<br>(000S) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>       |                     |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                     |                         |
| BPS                                          | \$ (8.083)          | (0,55)                  |
| MYI                                          | (5.590)             | (0,38)                  |
| SCX                                          | (9.888)             | (0,68)                  |
| <b>Summe</b>                                 | <b>(23.561)</b>     | <b>(1,61)</b>           |
| <b>Asia Strategic Interest Bond Fund</b>     |                     |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                     |                         |
| BOS                                          | \$ (702)            | (0,28)                  |
| <b>PIMCO Balanced Income and Growth Fund</b> |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                            |                     |                         |
| BPS                                          | \$ 12.700           | 0,50                    |
| DEU                                          | 13.800              | 0,54                    |
| <b>Summe</b>                                 | <b>26.500</b>       | <b>1,04</b>             |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                     |                         |
| BOS                                          | (6.288)             | (0,25)                  |
| MEI                                          | (370)               | (0,01)                  |
| MYI                                          | (1.594)             | (0,06)                  |
| <b>Summe</b>                                 | <b>(8.252)</b>      | <b>(0,32)</b>           |
| Total Return Swaps                           |                     |                         |
| MBC                                          | 769                 | 0,03                    |
| MEI                                          | 1.512               | 0,07                    |
| MYI                                          | 4.562               | 0,17                    |
| TOR                                          | 112                 | 0,01                    |
| <b>Summe</b>                                 | <b>6.955</b>        | <b>0,28</b>             |
| <b>PIMCO Capital Securities Fund</b>         |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                            |                     |                         |
| DEU                                          | \$ 39.100           | 0,78                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                     |                         |
| BOS                                          | (41.265)            | (0,82)                  |
| BPS                                          | (47.406)            | (0,94)                  |
| BRC                                          | (62.271)            | (1,23)                  |
| BYR                                          | (59.101)            | (1,17)                  |
| IND                                          | (32.372)            | (0,64)                  |
| JML                                          | (15.204)            | (0,31)                  |
| MYI                                          | (4.361)             | (0,09)                  |
| SCX                                          | (1.345)             | (0,03)                  |
| <b>Summe</b>                                 | <b>(263.325)</b>    | <b>(5,23)</b>           |
| <b>PIMCO Climate Bond Fund</b>               |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                            |                     |                         |
| BOS                                          | \$ 3.000            | 0,86                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                     |                         |
| BOS                                          | (484)               | (0,14)                  |
| <b>Commodity Real Return Fund</b>            |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                            |                     |                         |
| FICC                                         | \$ 2.000            | 0,28                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                     |                         |
| BSN                                          | (88.217)            | (12,15)                 |
| CIB                                          | (124.914)           | (17,21)                 |
| DEU                                          | (19.184)            | (2,64)                  |
| JPS                                          | (16.349)            | (2,25)                  |
| <b>Summe</b>                                 | <b>(248.664)</b>    | <b>(34,25)</b>          |
| Total Return Swaps                           |                     |                         |
| BPS                                          | (4.674)             | (0,64)                  |
| CBK                                          | (8.983)             | (1,24)                  |
| GST                                          | (3.257)             | (0,44)                  |
| JPM                                          | (3.949)             | (0,55)                  |
| MAC                                          | (870)               | (0,12)                  |
| MEI                                          | (784)               | (0,11)                  |
| SOG                                          | (1.946)             | (0,27)                  |
| <b>Summe</b>                                 | <b>(24.463)</b>     | <b>(3,37)</b>           |

| Fonds                                          | 30. Jun. 2025       |                         |
|------------------------------------------------|---------------------|-------------------------|
|                                                | Marktwert<br>(000S) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>    |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                     |                         |
| BPS                                            | \$ 18.200           | 7,21                    |
| DEU                                            | 47.800              | 18,94                   |
| <b>Summe</b>                                   | <b>66.000</b>       | <b>26,15</b>            |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                     |                         |
| BOS                                            | (513)               | (0,20)                  |
| BPS                                            | (287)               | (0,11)                  |
| BRC                                            | (801)               | (0,32)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(1.601)</b>      | <b>(0,63)</b>           |
| <b>Diversified Income Fund</b>                 |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                     |                         |
| BUS                                            | \$ 131.916          | 1,35                    |
| CEW                                            | 102.602             | 1,06                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>234.518</b>      | <b>2,41</b>             |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                     |                         |
| BPS                                            | (988)               | (0,01)                  |
| BRC                                            | (32.397)            | (0,32)                  |
| JPS                                            | (9.660)             | (0,10)                  |
| MYI                                            | (6.811)             | (0,08)                  |
| NOM                                            | (15.965)            | (0,16)                  |
| SCX                                            | (9.211)             | (0,10)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(75.032)</b>     | <b>(0,77)</b>           |
| <b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b> |                     |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                     |                         |
| BRC                                            | \$ (901)            | (0,27)                  |
| <b>Diversified Income ESG Fund</b>             |                     |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                     |                         |
| MYI                                            | \$ (147)            | (0,28)                  |
| <b>Dynamic Bond Fund</b>                       |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                     |                         |
| BOM                                            | \$ 161.231          | 3,71                    |
| BUS                                            | 161.231             | 3,71                    |
| CEW                                            | 351.778             | 8,10                    |
| DEU                                            | 100                 | 0,00                    |
| FICC                                           | 113.400             | 2,61                    |
| MEI                                            | 175.889             | 4,04                    |
| TOR                                            | 36.643              | 0,84                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>1.000.272</b>    | <b>23,01</b>            |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                     |                         |
| BOS                                            | (7.889)             | (0,18)                  |
| BRC                                            | (4.184)             | (0,10)                  |
| MEI                                            | (3.143)             | (0,07)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(15.216)</b>     | <b>(0,35)</b>           |
| <b>Emerging Local Bond Fund</b>                |                     |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                     |                         |
| BPS                                            | \$ (152.647)        | (3,59)                  |
| BRC                                            | (8.009)             | (0,19)                  |
| DBL                                            | (30.119)            | (0,71)                  |
| JML                                            | (11.925)            | (0,28)                  |
| MBC                                            | (28.839)            | (0,67)                  |
| MEI                                            | (966)               | (0,02)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(232.505)</b>    | <b>(5,46)</b>           |
| Total Return Swaps                             |                     |                         |
| SCX                                            | 1.178               | 0,03                    |
| <b>Emerging Local Bond ESG Fund</b>            |                     |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                     |                         |
| BPS                                            | \$ 6.700            | 5,02                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                     |                         |
| BPS                                            | (6.348)             | (4,76)                  |
| MBC                                            | (4.318)             | (3,24)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(10.666)</b>     | <b>(8,00)</b>           |
| Total Return Swaps                             |                     |                         |
| SCX                                            | 27                  | 0,02                    |



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| Fonds                                            | 30. Jun. 2025        |                         |
|--------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                  | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Emerging Markets Bond Fund</b>                |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BRC                                              | \$ (62.262)          | (1,33)                  |
| GSC                                              | (5.675)              | (0,12)                  |
| MBC                                              | (1.820)              | (0,04)                  |
| MEI                                              | (29.080)             | (0,62)                  |
| MYI                                              | (26.925)             | (0,56)                  |
| NOM                                              | (63.958)             | (1,37)                  |
| SCX                                              | (112.402)            | (2,40)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(302.122)</b>     | <b>(6,44)</b>           |
| <b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>            |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                |                      |                         |
| DEU                                              | \$ 100               | 0,00                    |
| FICC                                             | 56.500               | 1,89                    |
| <b>Summe</b>                                     | <b>56.600</b>        | <b>1,89</b>             |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BPS                                              | (3.712)              | (0,13)                  |
| BRC                                              | (65.661)             | (2,19)                  |
| GSC                                              | (4.463)              | (0,15)                  |
| JML                                              | (2.266)              | (0,07)                  |
| MEI                                              | (19.266)             | (0,65)                  |
| MYI                                              | (17.846)             | (0,60)                  |
| NOM                                              | (59.193)             | (1,97)                  |
| SCX                                              | (47.662)             | (1,58)                  |
| TDM                                              | (38.857)             | (1,30)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(258.926)</b>     | <b>(8,64)</b>           |
| <b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>      |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BRC                                              | \$ (469)             | (0,29)                  |
| MEI                                              | (1.068)              | (0,65)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(1.537)</b>       | <b>(0,94)</b>           |
| <b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b> |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BRC                                              | \$ (6.671)           | (1,55)                  |
| MBC                                              | (6.021)              | (1,39)                  |
| MEI                                              | (956)                | (0,22)                  |
| MYI                                              | (425)                | (0,10)                  |
| SCX                                              | (22.273)             | (5,15)                  |
| SOG                                              | (2.478)              | (0,57)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(38.824)</b>      | <b>(8,98)</b>           |
| <b>PIMCO ESG Income Fund</b>                     |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                |                      |                         |
| BOS                                              | \$ 18.200            | 3,45                    |
| BPS                                              | 17.500               | 3,31                    |
| GSC                                              | 30.000               | 5,68                    |
| TDM                                              | 35.000               | 6,63                    |
| <b>Summe</b>                                     | <b>100.700</b>       | <b>19,07</b>            |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BOS                                              | (4.611)              | (0,87)                  |
| <b>Euro Bond Fund</b>                            |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                |                      |                         |
| BPS                                              | € 23.300             | 1,42                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BRC                                              | (1.981)              | (0,12)                  |
| MYI                                              | (362)                | (0,02)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(2.343)</b>       | <b>(0,14)</b>           |
| <b>Euro Credit Fund</b>                          |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                |                      |                         |
| BPS                                              | € 17.300             | 3,53                    |
| <b>Euro Income Bond Fund</b>                     |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                |                      |                         |
| BPS                                              | € 186.100            | 9,93                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BPS                                              | (4.148)              | (0,22)                  |

| Fonds                                               | 30. Jun. 2025        |                         |
|-----------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                     | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Euro Long Average Duration Fund</b>              |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BRC                                                 | € (165.249)          | (13,63)                 |
| MYI                                                 | (272)                | (0,02)                  |
| SCX                                                 | (131.793)            | (10,87)                 |
| SOG                                                 | (29.457)             | (2,43)                  |
| <b>Summe</b>                                        | <b>(326.771)</b>     | <b>(26,95)</b>          |
| <b>Euro Short-Term Fund</b>                         |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| BPS                                                 | € 34.000             | 9,48                    |
| <b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>          |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| BPS                                                 | € 7.400              | 1,58                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| MYI                                                 | (6.068)              | (1,30)                  |
| <b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b> |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| BPS                                                 | € 77.900             | 7,58                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| MYI                                                 | (905)                | (0,09)                  |
| <b>Global Advantage Fund</b>                        |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BRC                                                 | \$ (835)             | (0,19)                  |
| CIB                                                 | (755)                | (0,17)                  |
| DEU                                                 | (2.652)              | (0,60)                  |
| JPS                                                 | (11.013)             | (2,50)                  |
| STR                                                 | (21.898)             | (4,97)                  |
| <b>Summe</b>                                        | <b>(37.152)</b>      | <b>(8,43)</b>           |
| <b>Global Bond Fund</b>                             |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BOS                                                 | \$ (24.082)          | (0,14)                  |
| BRC                                                 | (33.856)             | (0,20)                  |
| JML                                                 | (10.419)             | (0,06)                  |
| MEI                                                 | (6.379)              | (0,04)                  |
| MYI                                                 | (11.821)             | (0,07)                  |
| RCE                                                 | (400)                | 0,00                    |
| SCX                                                 | (2.842)              | (0,02)                  |
| <b>Summe</b>                                        | <b>(89.799)</b>      | <b>(0,53)</b>           |
| <b>Global Bond ESG Fund</b>                         |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BOS                                                 | \$ (57.140)          | (1,40)                  |
| BPS                                                 | (973)                | (0,02)                  |
| BRC                                                 | (6.845)              | (0,18)                  |
| MYI                                                 | (2.023)              | (0,05)                  |
| SCX                                                 | (997)                | (0,02)                  |
| STR                                                 | (154.019)            | (3,77)                  |
| <b>Summe</b>                                        | <b>(221.997)</b>     | <b>(5,44)</b>           |
| Verkauf-/Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte            |                      |                         |
| BOS                                                 | (9.872)              | (0,24)                  |
| BRC                                                 | (10.862)             | (0,27)                  |
| TDL                                                 | (4.475)              | (0,11)                  |
| <b>Summe</b>                                        | <b>(25.209)</b>      | <b>(0,62)</b>           |
| <b>Global Bond Ex-US Fund</b>                       |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BOS                                                 | \$ (978)             | (0,10)                  |
| BRC                                                 | (1.666)              | (0,18)                  |
| DEU                                                 | (1.978)              | (0,21)                  |
| MEI                                                 | (1.202)              | (0,13)                  |
| <b>Summe</b>                                        | <b>(5.824)</b>       | <b>(0,62)</b>           |
| Verkauf-/Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte            |                      |                         |
| BRC                                                 | (1.877)              | (0,20)                  |
| Total Return Swaps                                  |                      |                         |
| BPS                                                 | (293)                | (0,03)                  |
| JPM                                                 | (252)                | (0,03)                  |
| MYC                                                 | (62)                 | (0,01)                  |
| <b>Summe</b>                                        | <b>(607)</b>         | <b>(0,07)</b>           |

| Fonds                                          | 30. Jun. 2025        |                         |
|------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Global High Yield Bond Fund</b>             |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | \$ (91.918)          | (3,18)                  |
| BPS                                            | (6.941)              | (0,24)                  |
| BRC                                            | (20.542)             | (0,70)                  |
| JML                                            | (3.392)              | (0,12)                  |
| JPS                                            | (815)                | (0,03)                  |
| MYI                                            | (2.285)              | (0,08)                  |
| SOG                                            | (500)                | (0,02)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(126.393)</b>     | <b>(4,37)</b>           |
| <b>Global Investment Grade Credit Fund</b>     |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| BUS                                            | \$ 153.903           | 1,84                    |
| CEW                                            | 307.805              | 3,70                    |
| FICC                                           | 19.600               | 0,24                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>481.308</b>       | <b>5,78</b>             |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | (54.880)             | (0,66)                  |
| BRC                                            | (2.315)              | (0,03)                  |
| JML                                            | (8.403)              | (0,10)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(65.598)</b>      | <b>(0,79)</b>           |
| <b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b> |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| BPS                                            | \$ 19.700            | 0,78                    |
| JPS                                            | 13.300               | 0,52                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>33.000</b>        | <b>1,30</b>             |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | (22.830)             | (0,90)                  |
| BRC                                            | (3.788)              | (0,15)                  |
| JPS                                            | (87.889)             | (3,45)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(114.507)</b>     | <b>(4,50)</b>           |
| <b>Global Low Duration Real Return Fund</b>    |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOM                                            | \$ (235.235)         | (14,14)                 |
| BOS                                            | (3.106)              | (0,19)                  |
| BRC                                            | (1.007)              | (0,06)                  |
| CIB                                            | (570.397)            | (34,29)                 |
| DEU                                            | (11.370)             | (0,68)                  |
| JPS                                            | (12.377)             | (0,75)                  |
| STR                                            | (27.670)             | (1,66)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(861.162)</b>     | <b>(51,77)</b>          |
| <b>Global Real Return Fund</b>                 |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOM                                            | \$ (210.371)         | (11,05)                 |
| BRC                                            | (14.208)             | (0,74)                  |
| BSN                                            | (556.739)            | (29,25)                 |
| CEW                                            | (65.997)             | (3,47)                  |
| CIB                                            | (153.301)            | (8,05)                  |
| DEU                                            | (37.323)             | (1,96)                  |
| JPS                                            | (9.595)              | (0,50)                  |
| MEI                                            | (91.512)             | (4,80)                  |
| SCX                                            | (25.278)             | (1,33)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(1.164.324)</b>   | <b>(61,15)</b>          |
| <b>Income Fund</b>                             |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| BAR                                            | \$ 130.574           | 0,13                    |
| BOM                                            | 2.440.454            | 2,47                    |
| BUS                                            | 2.030.048            | 2,05                    |
| CEW                                            | 5.437.889            | 5,50                    |
| MEI                                            | 549.652              | 0,55                    |
| TOR                                            | 461.708              | 0,46                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>11.050.325</b>    | <b>11,16</b>            |

| Fonds                                                   | 30. Jun. 2025        |                         |
|---------------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                         | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>                     |                      |                         |
| BAR                                                     | \$ (130.575)         | (0,13)                  |
| BOS                                                     | (47.600)             | (0,05)                  |
| BPS                                                     | (10.922)             | (0,01)                  |
| BRC                                                     | (2.700)              | 0,00                    |
| JPS                                                     | (9.836)              | (0,01)                  |
| MYI                                                     | (17.043)             | (0,02)                  |
| <b>Summe</b>                                            | <b>(218.676)</b>     | <b>(0,22)</b>           |
| <b>Total Return Swaps</b>                               |                      |                         |
| BPS                                                     | (558)                | 0,00                    |
| JPM                                                     | (821)                | 0,00                    |
| MYC                                                     | (4.920)              | 0,00                    |
| <b>Summe</b>                                            | <b>(6.299)</b>       | <b>0,00</b>             |
| <b>Income Fund II</b>                                   |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                            |                      |                         |
| BOS                                                     | \$ (2.241)           | (0,68)                  |
| MYI                                                     | (1.063)              | (0,32)                  |
| <b>Summe</b>                                            | <b>(3.304)</b>       | <b>(1,00)</b>           |
| <b>Inflation Multi-Asset Fund</b>                       |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                            |                      |                         |
| BOS                                                     | \$ (1.037)           | (0,55)                  |
| DEU                                                     | (1.238)              | (0,66)                  |
| <b>Summe</b>                                            | <b>(2.275)</b>       | <b>(1,21)</b>           |
| <b>Verkauf-/Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte</b>         |                      |                         |
| BRC                                                     | (25.869)             | (13,72)                 |
| <b>Total Return Swaps</b>                               |                      |                         |
| BOA                                                     | (14)                 | (0,01)                  |
| JPM                                                     | (442)                | (0,24)                  |
| MAC                                                     | (495)                | (0,26)                  |
| MYI                                                     | 8                    | 0,01                    |
| UAG                                                     | 51                   | 0,03                    |
| <b>Summe</b>                                            | <b>(892)</b>         | <b>(0,47)</b>           |
| <b>Low Average Duration Fund</b>                        |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| DEU                                                     | \$ 100               | 0,01                    |
| FICC                                                    | 56.100               | 6,85                    |
| <b>Summe</b>                                            | <b>56.200</b>        | <b>6,86</b>             |
| <b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b> |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| BRC                                                     | \$ 57.300            | 4,55                    |
| DEU                                                     | 67.200               | 5,34                    |
| FICC                                                    | 89.000               | 7,06                    |
| <b>Summe</b>                                            | <b>213.500</b>       | <b>16,95</b>            |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>                     |                      |                         |
| BOS                                                     | (388)                | (0,03)                  |
| <b>Low Duration Income Fund</b>                         |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| BOS                                                     | \$ 47.400            | 1,53                    |
| BPS                                                     | 100                  | 0,00                    |
| CEW                                                     | 403.079              | 13,04                   |
| FICC                                                    | 24.000               | 0,78                    |
| MEI                                                     | 36.643               | 1,18                    |
| <b>Summe</b>                                            | <b>511.222</b>       | <b>16,53</b>            |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>                     |                      |                         |
| BOS                                                     | (4.552)              | (0,15)                  |
| BRC                                                     | (926)                | (0,03)                  |
| <b>Summe</b>                                            | <b>(5.478)</b>       | <b>(0,18)</b>           |
| <b>Low Duration Opportunities Fund</b>                  |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| BOS                                                     | \$ 58.000            | 7,20                    |
| FICC                                                    | 46.600               | 5,79                    |
| <b>Summe</b>                                            | <b>104.600</b>       | <b>12,99</b>            |
| <b>Umgekehrte Pensionsgeschäfte</b>                     |                      |                         |
| BOS                                                     | (808)                | (0,10)                  |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| Fonds                                             | 30. Jun. 2025        |                         |
|---------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                   | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Low Duration Opportunities ESG Fund</b>        |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                      |                      |                         |
| BOS                                               | \$ (770)             | (13,50)                 |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte      |                      |                         |
| TDL                                               | (577)                | (10,12)                 |
| <b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b> |                      |                         |
| Total Return Swaps                                |                      |                         |
| BOA                                               | \$ 708               | 0,41                    |
| CBK                                               | 39                   | 0,02                    |
| GST                                               | (81)                 | (0,05)                  |
| JPM                                               | 534                  | 0,30                    |
| MYI                                               | 1.188                | 0,68                    |
| <b>Summe</b>                                      | 2.388                | 1,36                    |
| <b>Mortgage Opportunities Fund</b>                |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                 |                      |                         |
| BOS                                               | \$ 25.000            | 1,10                    |
| FICC                                              | 4.200                | 0,18                    |
| <b>Summe</b>                                      | 29.200               | 1,28                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                      |                      |                         |
| CIB                                               | (189.891)            | (8,35)                  |
| FAR                                               | (98.467)             | (4,33)                  |
| SBI                                               | (103.996)            | (4,57)                  |
| <b>Summe</b>                                      | (392.354)            | (17,25)                 |
| <b>StocksPLUS™ Fund</b>                           |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                 |                      |                         |
| BPS                                               | \$ 1.061.400         | 19,93                   |
| GSC                                               | 270.000              | 5,07                    |
| MFK                                               | 200.000              | 3,76                    |
| <b>Summe</b>                                      | 1.531.400            | 28,76                   |
| Total Return Swaps                                |                      |                         |
| CBK                                               | 4.895                | 0,09                    |
| GST                                               | 24.534               | 0,46                    |
| RBC                                               | 105.344              | 1,99                    |
| TOR                                               | 28.983               | 0,54                    |
| <b>Summe</b>                                      | 163.756              | 3,08                    |
| <b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>                  |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                 |                      |                         |
| BPS                                               | \$ 2.600             | 24,85                   |
| Total Return Swaps                                |                      |                         |
| BRC                                               | 59                   | 0,57                    |
| CIB                                               | 243                  | 2,32                    |
| RBC                                               | 22                   | 0,21                    |
| <b>Summe</b>                                      | 324                  | 3,10                    |
| <b>Strategic Income Fund</b>                      |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                      |                      |                         |
| BRC                                               | \$ (335)             | (0,01)                  |
| MEI                                               | (4.074)              | (0,17)                  |
| <b>Summe</b>                                      | (4.409)              | (0,18)                  |
| <b>Total Return Bond Fund</b>                     |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                      |                      |                         |
| BOS                                               | \$ (33.708)          | (0,82)                  |
| BRC                                               | (30.371)             | (0,74)                  |
| BSN                                               | (37.065)             | (0,90)                  |
| CIB                                               | (3.875)              | (0,09)                  |
| DEU                                               | (2.279)              | (0,06)                  |
| JPS                                               | (4.342)              | (0,10)                  |
| STR                                               | (21.480)             | (0,52)                  |
| <b>Summe</b>                                      | (133.120)            | (3,23)                  |
| <b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b> |                      |                         |
| Total Return Swaps                                |                      |                         |
| MEI                                               | \$ 118               | 0,11                    |
| <b>UK Corporate Bond Fund</b>                     |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                      |                      |                         |
| BRC                                               | £ (1.364)            | (0,65)                  |

| Fonds                                          | 30. Jun. 2025        |                         |
|------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>US High Yield Bond Fund</b>                 |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| DEU                                            | \$ 69.200            | 4,20                    |
| FICC                                           | 13.900               | 0,84                    |
| <b>Summe</b>                                   | 83.100               | 5,04                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | (93.169)             | (5,67)                  |
| BPS                                            | (5.843)              | (0,36)                  |
| BRC                                            | (5.014)              | (0,30)                  |
| MEI                                            | (2.625)              | (0,15)                  |
| <b>Summe</b>                                   | (106.651)            | (6,48)                  |
| <b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b> |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| FICC                                           | \$ 16.600            | 3,49                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | (1.757)              | (0,37)                  |
| MEI                                            | (163)                | (0,03)                  |
| <b>Summe</b>                                   | (1.920)              | (0,40)                  |
| <b>US Short-Term Fund</b>                      |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| FICC                                           | \$ 18.300            | 0,71                    |

Zum 31. Dezember 2024 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Verkauf-/Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2024 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

| Fonds                                        | 31. Dez. 2024        |                         |
|----------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                              | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>PIMCO Asia High Yield Bond Fund</b>       |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                      |                         |
| BPS                                          | \$ (7.933)           | (0,43)                  |
| MYI                                          | (5.635)              | (0,31)                  |
| SCX                                          | (5.225)              | (0,28)                  |
| <b>Summe</b>                                 | (18.793)             | (1,02)                  |
| <b>PIMCO Balanced Income and Growth Fund</b> |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                            |                      |                         |
| BPS                                          | \$ 15.200            | 1,10                    |
| Total Return Swaps                           |                      |                         |
| MBC                                          | (25)                 | 0,00                    |
| MEI                                          | (404)                | (0,03)                  |
| MYI                                          | (302)                | (0,02)                  |
| TOR                                          | (11)                 | 0,00                    |
| <b>Summe</b>                                 | (742)                | (0,05)                  |
| <b>PIMCO Capital Securities Fund</b>         |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                 |                      |                         |
| BPS                                          | \$ (47.215)          | (0,99)                  |
| BRC                                          | (26.438)             | (0,56)                  |
| BYR                                          | (59.813)             | (1,26)                  |
| IND                                          | (32.804)             | (0,69)                  |
| JML                                          | (3.608)              | (0,08)                  |
| JPS                                          | (34.878)             | (0,73)                  |
| <b>Summe</b>                                 | (204.756)            | (4,31)                  |
| <b>PIMCO Climate Bond Fund</b>               |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                            |                      |                         |
| BOS                                          | \$ 8.000             | 2,51                    |

| Fonds                                          | 31. Dez. 2024        |                         |
|------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Commodity Real Return Fund</b>              |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| DEU                                            | \$ 3.800             | 0,51                    |
| FICC                                           | 10.800               | 1,47                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>14.600</b>        | <b>1,98</b>             |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| STR                                            | (462.510)            | (62,58)                 |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte   |                      |                         |
| BPG                                            | (5.237)              | (0,71)                  |
| BRC                                            | (19.779)             | (2,67)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(25.016)</b>      | <b>(3,38)</b>           |
| Total Return Swaps                             |                      |                         |
| BPS                                            | 991                  | 0,14                    |
| CBK                                            | 1.372                | 0,19                    |
| GST                                            | 550                  | 0,07                    |
| JPM                                            | 442                  | 0,06                    |
| MAC                                            | (113)                | (0,02)                  |
| MEI                                            | 76                   | 0,01                    |
| SOG                                            | 301                  | 0,04                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>3.619</b>         | <b>0,49</b>             |
| <b>PIMCO Credit Opportunities Bond Fund</b>    |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | \$ (507)             | (0,40)                  |
| BPS                                            | (447)                | (0,36)                  |
| BRC                                            | (206)                | (0,16)                  |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(1.160)</b>       | <b>(0,92)</b>           |
| Total Return Swaps                             |                      |                         |
| JPM                                            | (32)                 | (0,03)                  |
| <b>Diversified Income Fund</b>                 |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| BUS                                            | \$ 111.250           | 1,27                    |
| CEW                                            | 792.658              | 9,02                    |
| DEU                                            | 64.600               | 0,74                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>968.508</b>       | <b>11,03</b>            |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BRC                                            | (24.678)             | (0,28)                  |
| JML                                            | (1.398)              | (0,02)                  |
| JPS                                            | (9.477)              | (0,11)                  |
| MEI                                            | (3.875)              | (0,04)                  |
| MYI                                            | (9.540)              | (0,11)                  |
| NOM                                            | (15.235)             | (0,17)                  |
| SCX                                            | (107)                | 0,00                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>(64.310)</b>      | <b>(0,73)</b>           |
| <b>Diversified Income Duration Hedged Fund</b> |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| FICC                                           | \$ 2.600             | 0,88                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BRC                                            | (528)                | (0,18)                  |
| <b>Diversified Income ESG Fund</b>             |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| MYI                                            | \$ (144)             | (0,29)                  |
| <b>Dynamic Bond Fund</b>                       |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| BOM                                            | \$ 111.250           | 3,03                    |
| BUS                                            | 20.859               | 0,57                    |
| CEW                                            | 417.189              | 11,37                   |
| DEU                                            | 5.900                | 0,16                    |
| FICC                                           | 10.200               | 0,28                    |
| MEI                                            | 208.594              | 5,68                    |
| SAL                                            | 32.800               | 0,89                    |
| TOR                                            | 6.953                | 0,19                    |
| <b>Summe</b>                                   | <b>813.745</b>       | <b>22,17</b>            |
| Total Return Swaps                             |                      |                         |
| GST                                            | 900                  | 0,02                    |

| Fonds                                            | 31. Dez. 2024        |                         |
|--------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                  | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Emerging Local Bond Fund</b>                  |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BRC                                              | \$ (52.820)          | (1,86)                  |
| DBL                                              | (28.502)             | (1,00)                  |
| MBC                                              | (134.437)            | (4,74)                  |
| MEI                                              | (51.605)             | (1,81)                  |
| SCX                                              | (7.880)              | (0,28)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(275.244)</b>     | <b>(9,69)</b>           |
| Total Return Swaps                               |                      |                         |
| SCX                                              | (6)                  | 0,00                    |
| <b>Emerging Local Bond ESG Fund</b>              |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                |                      |                         |
| BPS                                              | \$ 3.400             | 2,91                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BPS                                              | (6.368)              | (5,45)                  |
| MBC                                              | (4.502)              | (3,85)                  |
| MEI                                              | (3.593)              | (3,07)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(14.463)</b>      | <b>(12,37)</b>          |
| Total Return Swaps                               |                      |                         |
| SCX                                              | 0                    | 0,00                    |
| <b>Emerging Markets Bond Fund</b>                |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BOS                                              | \$ (6.695)           | (0,16)                  |
| BPS                                              | (46.658)             | (1,12)                  |
| BRC                                              | (91.834)             | (2,19)                  |
| GSC                                              | (6.244)              | (0,15)                  |
| IND                                              | (20.287)             | (0,48)                  |
| MEI                                              | (49.036)             | (1,17)                  |
| MYI                                              | (62.198)             | (1,50)                  |
| NOM                                              | (75.520)             | (1,80)                  |
| SCX                                              | (70.105)             | (1,68)                  |
| TDM                                              | (3.184)              | (0,08)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(431.761)</b>     | <b>(10,33)</b>          |
| <b>Emerging Markets Bond ESG Fund</b>            |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                |                      |                         |
| DEU                                              | \$ 23.900            | 0,89                    |
| TOR                                              | 69.531               | 2,60                    |
| <b>Summe</b>                                     | <b>93.431</b>        | <b>3,49</b>             |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BPS                                              | (13.593)             | (0,51)                  |
| BRC                                              | (59.112)             | (2,21)                  |
| GSC                                              | (4.126)              | (0,15)                  |
| JML                                              | (7.163)              | (0,27)                  |
| MEI                                              | (25.514)             | (0,96)                  |
| MYI                                              | (22.558)             | (0,84)                  |
| NOM                                              | (89.362)             | (3,34)                  |
| SCX                                              | (51.330)             | (1,91)                  |
| TDM                                              | (84.538)             | (3,16)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(357.296)</b>     | <b>(13,35)</b>          |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte     |                      |                         |
| BPG                                              | (4.036)              | (0,15)                  |
| BRC                                              | (6.058)              | (0,23)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(10.094)</b>      | <b>(0,38)</b>           |
| <b>Emerging Markets Corporate Bond Fund</b>      |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BPS                                              | \$ (2.168)           | (1,49)                  |
| BRC                                              | (1.461)              | (1,00)                  |
| MEI                                              | (834)                | (0,57)                  |
| SCX                                              | (763)                | (0,52)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(5.226)</b>       | <b>(3,58)</b>           |
| <b>PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund</b> |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                     |                      |                         |
| BRC                                              | \$ (4.540)           | (1,39)                  |
| MBC                                              | (5.911)              | (1,81)                  |
| SOG                                              | (2.631)              | (0,80)                  |
| <b>Summe</b>                                     | <b>(13.082)</b>      | <b>(4,00)</b>           |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| Fonds                                               | 31. Dez. 2024        |                         |
|-----------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                     | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>PIMCO ESG Income Fund</b>                        |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BOS                                                 | \$ (1.318)           | (0,37)                  |
| <b>Euro Bond Fund</b>                               |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BRC                                                 | € (618)              | (0,04)                  |
| <b>Euro Income Bond Fund</b>                        |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| BPS                                                 | € 4.200              | 0,25                    |
| COM                                                 | 154.600              | 9,22                    |
| <b>Summe</b>                                        | 158.800              | 9,47                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BPS                                                 | (4.313)              | (0,26)                  |
| SOG                                                 | (1.724)              | (0,10)                  |
| <b>Summe</b>                                        | (6.037)              | (0,36)                  |
| <b>Euro Long Average Duration Fund</b>              |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BPS                                                 | € (6.954)            | (0,59)                  |
| BRC                                                 | (143.793)            | (12,09)                 |
| COM                                                 | (86.678)             | (7,29)                  |
| MBG                                                 | (2.513)              | (0,21)                  |
| MEI                                                 | (52.324)             | (4,40)                  |
| MYI                                                 | (6.438)              | (0,54)                  |
| <b>Summe</b>                                        | (298.700)            | (25,12)                 |
| <b>Euro Short-Term Fund</b>                         |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| COM                                                 | € 24.500             | 9,22                    |
| <b>PIMCO European High Yield Bond Fund</b>          |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| BPS                                                 | € 25.900             | 6,75                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| MYI                                                 | (2.004)              | (0,52)                  |
| <b>PIMCO European Short-Term Opportunities Fund</b> |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| CEW                                                 | € 22.100             | 2,31                    |
| <b>Global Advantage Fund</b>                        |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BRC                                                 | \$ (827)             | (0,20)                  |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte        |                      |                         |
| BPG                                                 | (10.685)             | (2,64)                  |
| BRC                                                 | (5.284)              | (1,31)                  |
| TDL                                                 | (2.802)              | (0,69)                  |
| <b>Summe</b>                                        | (18.771)             | (4,64)                  |
| <b>Global Bond Fund</b>                             |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BRC                                                 | \$ (38.474)          | (0,24)                  |
| MEI                                                 | (1.093)              | (0,01)                  |
| SGY                                                 | (129.259)            | (0,82)                  |
| STR                                                 | (178.079)            | (1,13)                  |
| <b>Summe</b>                                        | (346.905)            | (2,20)                  |
| <b>Global Bond ESG Fund</b>                         |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                   |                      |                         |
| FICC                                                | \$ 8.600             | 0,22                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                        |                      |                         |
| BOS                                                 | (185.941)            | (4,69)                  |
| BRC                                                 | (4.941)              | (0,13)                  |
| MYI                                                 | (2.006)              | (0,05)                  |
| <b>Summe</b>                                        | (192.888)            | (4,87)                  |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte        |                      |                         |
| BPG                                                 | (8.615)              | (0,22)                  |
| TDL                                                 | (51.733)             | (1,30)                  |
| <b>Summe</b>                                        | (60.348)             | (1,52)                  |

| Fonds                                          | 31. Dez. 2024        |                         |
|------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Global Bond Ex-US Fund</b>                  |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BRC                                            | \$ (1.025)           | (0,09)                  |
| Total Return Swaps                             |                      |                         |
| BPS                                            | 406                  | 0,03                    |
| JPM                                            | 424                  | 0,04                    |
| <b>Summe</b>                                   | 830                  | 0,07                    |
| <b>Global High Yield Bond Fund</b>             |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BPS                                            | \$ (2.921)           | (0,10)                  |
| BRC                                            | (8.088)              | (0,28)                  |
| JML                                            | (5.052)              | (0,17)                  |
| JPS                                            | (1.996)              | (0,07)                  |
| MYI                                            | (3.025)              | (0,11)                  |
| <b>Summe</b>                                   | (21.082)             | (0,73)                  |
| <b>Global Investment Grade Credit Fund</b>     |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BRC                                            | \$ (3.077)           | (0,03)                  |
| JML                                            | (1.489)              | (0,02)                  |
| <b>Summe</b>                                   | (4.566)              | (0,05)                  |
| <b>Global Investment Grade Credit ESG Fund</b> |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | \$ (6.564)           | (0,31)                  |
| BRC                                            | (1.451)              | (0,07)                  |
| JPS                                            | (1.210)              | (0,06)                  |
| <b>Summe</b>                                   | (9.225)              | (0,44)                  |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte   |                      |                         |
| BPG                                            | (72.023)             | (3,40)                  |
| <b>Global Low Duration Real Return Fund</b>    |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| CIB                                            | \$ (548.515)         | (45,07)                 |
| <b>Global Real Return Fund</b>                 |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| MYI                                            | \$ (35.460)          | (1,70)                  |
| NOM                                            | (312.077)            | (14,93)                 |
| SCX                                            | (25.215)             | (1,21)                  |
| STR                                            | (1.330.904)          | (63,67)                 |
| <b>Summe</b>                                   | (1.703.656)          | (81,51)                 |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte   |                      |                         |
| BRC                                            | (37.412)             | (1,79)                  |
| <b>Income Fund</b>                             |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                              |                      |                         |
| BAR                                            | \$ 36.176            | 0,04                    |
| BOM                                            | 458.907              | 0,51                    |
| BUS                                            | 271.173              | 0,31                    |
| CEW                                            | 688.360              | 0,77                    |
| <b>Summe</b>                                   | 1.454.616            | 1,63                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BAR                                            | (36.176)             | (0,04)                  |
| MYI                                            | (6.893)              | (0,01)                  |
| SOG                                            | (7.526)              | (0,01)                  |
| <b>Summe</b>                                   | (50.595)             | (0,06)                  |
| Total Return Swaps                             |                      |                         |
| BPS                                            | 16                   | 0,00                    |
| JPM                                            | 340                  | 0,00                    |
| MYC                                            | 2.640                | 0,00                    |
| <b>Summe</b>                                   | 2.996                | 0,00                    |
| <b>Income Fund II</b>                          |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | \$ (3.080)           | (1,13)                  |
| <b>Inflation Multi-Asset Fund</b>              |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                   |                      |                         |
| BOS                                            | \$ (9.147)           | (5,11)                  |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte   |                      |                         |
| BRC                                            | (34.095)             | (19,06)                 |

| Fonds                                                   | 31. Dez. 2024        |                         |
|---------------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                         | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>Total Return Swaps</b>                               |                      |                         |
| BOA                                                     | \$ 0                 | 0,00                    |
| BRC                                                     | 0                    | 0,00                    |
| CBK                                                     | (29)                 | (0,02)                  |
| GST                                                     | 0                    | 0,00                    |
| JPM                                                     | 31                   | 0,02                    |
| MAC                                                     | (36)                 | (0,02)                  |
| MYI                                                     | 1                    | 0,00                    |
| RBC                                                     | 0                    | 0,00                    |
| <b>Summe</b>                                            | (33)                 | (0,02)                  |
| <b>Low Average Duration Fund</b>                        |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| FICC                                                    | \$ 5.400             | 0,80                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                            |                      |                         |
| BOS                                                     | (17.265)             | (2,55)                  |
| STR                                                     | (173.656)            | (25,68)                 |
| <b>Summe</b>                                            | (190.921)            | (28,23)                 |
| <b>Low Duration Global Investment Grade Credit Fund</b> |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                            |                      |                         |
| BOS                                                     | \$ (4.533)           | (0,42)                  |
| BPS                                                     | (6.144)              | (0,56)                  |
| SOG                                                     | (8.116)              | (0,75)                  |
| <b>Summe</b>                                            | (18.793)             | (1,73)                  |
| <b>Low Duration Income Fund</b>                         |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| CEW                                                     | \$ 34.766            | 1,19                    |
| FICC                                                    | 17.000               | 0,58                    |
| <b>Summe</b>                                            | 51.766               | 1,77                    |
| <b>Low Duration Opportunities Fund</b>                  |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| BOS                                                     | \$ 127.500           | 15,11                   |
| BPS                                                     | 100                  | 0,01                    |
| FICC                                                    | 9.500                | 1,13                    |
| <b>Summe</b>                                            | 137.100              | 16,25                   |
| <b>Low Duration Opportunities ESG Fund</b>              |                      |                         |
| Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungsgeschäfte            |                      |                         |
| TDL                                                     | \$ (102)             | (1,88)                  |
| <b>PIMCO MLP &amp; Energy Infrastructure Fund</b>       |                      |                         |
| Total Return Swaps                                      |                      |                         |
| BOA                                                     | \$ (164)             | (0,11)                  |
| CBK                                                     | (7)                  | 0,00                    |
| GST                                                     | (33)                 | (0,02)                  |
| JPM                                                     | (81)                 | (0,05)                  |
| MYI                                                     | (71)                 | (0,05)                  |
| <b>Summe</b>                                            | (356)                | (0,23)                  |
| <b>Mortgage Opportunities Fund</b>                      |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| FICC                                                    | \$ 5.600             | 0,31                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                            |                      |                         |
| BOS                                                     | (1.129)              | (0,06)                  |
| FAR                                                     | (39.544)             | (2,21)                  |
| <b>Summe</b>                                            | (40.673)             | (2,27)                  |
| <b>StocksPLUS™ Fund</b>                                 |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                       |                      |                         |
| MFK                                                     | \$ 250.000           | 4,98                    |
| SAL                                                     | 203.100              | 4,04                    |
| <b>Summe</b>                                            | 453.100              | 9,02                    |
| <b>Total Return Swaps</b>                               |                      |                         |
| BOA                                                     | (2.475)              | (0,05)                  |
| BPS                                                     | (963)                | (0,02)                  |
| CBK                                                     | (36)                 | 0,00                    |
| RBC                                                     | (9.932)              | (0,20)                  |
| TOR                                                     | (43)                 | 0,00                    |
| <b>Summe</b>                                            | (13.449)             | (0,27)                  |

| Fonds                                                | 31. Dez. 2024        |                         |
|------------------------------------------------------|----------------------|-------------------------|
|                                                      | Marktwert<br>(000\$) | % des<br>Nettovermögens |
| <b>PIMCO StocksPLUS™ AR Fund</b>                     |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                    |                      |                         |
| BPS                                                  | \$ 2.400             | 23,72                   |
| <b>Total Return Swaps</b>                            |                      |                         |
| CBK                                                  | (4)                  | (0,04)                  |
| CIB                                                  | (31)                 | (0,30)                  |
| RBC                                                  | (4)                  | (0,04)                  |
| <b>Summe</b>                                         | (39)                 | (0,38)                  |
| <b>Strategic Income Fund</b>                         |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                         |                      |                         |
| BOS                                                  | \$ (131.467)         | (5,67)                  |
| DEU                                                  | (5.581)              | (0,24)                  |
| <b>Summe</b>                                         | (137.048)            | (5,91)                  |
| <b>Verkauf-/Rückkauf-<br/>Finanzierungsgeschäfte</b> |                      |                         |
| BPG                                                  | (126.858)            | (5,47)                  |
| BRC                                                  | (7.308)              | (0,32)                  |
| <b>Summe</b>                                         | (134.166)            | (5,79)                  |
| <b>Total Return Bond Fund</b>                        |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                         |                      |                         |
| BRC                                                  | \$ (12.493)          | (0,31)                  |
| SGY                                                  | (49.086)             | (1,22)                  |
| STR                                                  | (301.678)            | (7,54)                  |
| <b>Summe</b>                                         | (363.257)            | (9,07)                  |
| <b>Verkauf-/Rückkauf-<br/>Finanzierungsgeschäfte</b> |                      |                         |
| BRC                                                  | (6.691)              | (0,17)                  |
| <b>PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund</b>    |                      |                         |
| Total Return Swaps                                   |                      |                         |
| MEI                                                  | \$ 343               | 0,16                    |
| RBC                                                  | 34                   | 0,01                    |
| <b>Summe</b>                                         | 377                  | 0,17                    |
| <b>UK Corporate Bond Fund</b>                        |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                    |                      |                         |
| BPS                                                  | £ 2.100              | 0,99                    |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                         |                      |                         |
| BRC                                                  | (237)                | (0,11)                  |
| <b>UK Long Term Corporate Bond Fund</b>              |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                    |                      |                         |
| BPS                                                  | £ 5.200              | 4,54                    |
| <b>US High Yield Bond Fund</b>                       |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                         |                      |                         |
| BRC                                                  | \$ (625)             | (0,04)                  |
| JPS                                                  | (389)                | (0,02)                  |
| MYI                                                  | (1.072)              | (0,06)                  |
| <b>Summe</b>                                         | (2.086)              | (0,12)                  |
| <b>US Investment Grade Corporate Bond Fund</b>       |                      |                         |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte                         |                      |                         |
| BOS                                                  | \$ (4.735)           | (0,96)                  |
| BPS                                                  | (14.587)             | (2,95)                  |
| <b>Summe</b>                                         | (19.322)             | (3,91)                  |
| <b>Verkauf-/Rückkauf-<br/>Finanzierungsgeschäfte</b> |                      |                         |
| TDL                                                  | (1.025)              | (0,21)                  |
| <b>US Short-Term Fund</b>                            |                      |                         |
| Pensionsgeschäfte                                    |                      |                         |
| DEU                                                  | \$ 99.700            | 4,27                    |
| FICC                                                 | 16.000               | 0,69                    |
| RBC                                                  | 17.383               | 0,75                    |
| <b>Summe</b>                                         | 133.083              | 5,71                    |

**(b) Sicherheiten****(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:**

Die zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 erhaltenen Sicherheiten werden im globalen Depotbanknetz der State Street Bank and Trust Co. gehalten.



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

### (ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2025 wie folgt (wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt).

| Zum 30. Juni 2025                            |                                               |                   | Zum 30. Juni 2025                                |                                               |                   |
|----------------------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------|--------------------------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------|
| Fonds                                        | Sicherheitenemittent                          | Marktwert (000\$) | Fonds                                            | Sicherheitenemittent                          | Marktwert (000\$) |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | \$ 89             | Global Bond Fund                                 | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | \$ 425            |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund        | Ginnie Mae                                    | 14.001            | Global Bond ESG Fund                             | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 448               |
| PIMCO Capital Securities Fund                | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 14.102            | Global High Yield Bond Fund                      | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 937               |
| PIMCO Climate Bond Fund                      | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 40.982            | Global Investment Grade Credit Fund              | Canada Government                             | 473.875           |
| Commodity Real Return Fund                   | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.073             | Global Investment Grade Credit ESG Fund          | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 20.420            |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund         | Ginnie Mae                                    | 2.286             | Global Real Return Fund                          | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 33.786            |
| Diversified Income Fund                      | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 20.064            | Income Fund                                      | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 6.361             |
| Dynamic Bond Fund                            | Canada Government                             | 49.259            |                                                  | Barclays Bank PLC                             | 130.630           |
|                                              | Canada Government                             | 242.119           |                                                  | Canada Government                             | 10.818.248        |
|                                              | Hydro-Québec                                  | 855.416           |                                                  | Hydro-Québec                                  | 440.015           |
|                                              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 60.443            |                                                  | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 602               |
| Emerging Local Bond ESG Fund                 | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 116.692           | Low Average Duration Fund                        | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 57.781            |
| Emerging Markets Bond Fund                   | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 6.844             | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 219.232           |
| Emerging Markets Bond ESG Fund               | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.683             | Low Duration Income Fund                         | Canada Government                             | 450.242           |
| PIMCO ESG Income Fund                        | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 58.192            |                                                  | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 73.210            |
|                                              | Ginnie Mae                                    | 34.982            | Low Duration Opportunities Fund                  | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 107.175           |
|                                              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 68.335            | Mortgage Opportunities Fund                      | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 32.223            |
| Euro Bond Fund                               | Europäische Union                             | € 23.779          | StocksPLUS™ Fund                                 | Ginnie Mae                                    | 535.644           |
| Euro Credit Fund                             | Regierung von Belgien                         | 17.656            |                                                  | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.029.412         |
| Euro Income Bond Fund                        | Europäische Union                             | 189.544           |                                                  | Ginnie Mae                                    | 772               |
| Euro Short-Term Fund                         | BNG Bank NV                                   | 5.152             | PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.932             |
|                                              | Europäische Finanzstabilisierungsfazilität    | 5.178             |                                                  | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.246             |
|                                              | Europäische Investitionsbank                  | 5.081             | Total Return Bond Fund                           | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 86.786            |
|                                              | Europäische Union                             | 10.410            | US High Yield Bond Fund                          | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 17.067            |
|                                              | Germany Government                            | 3.464             | US Investment Grade Corporate Bond Fund          | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 18.815            |
|                                              | SFIL S.A.                                     | 5.169             | US Short-Term Fund                               |                                               |                   |
| PIMCO European High Yield Bond Fund          | Regierung von Belgien                         | 7.552             |                                                  |                                               |                   |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Europäische Union                             | 79.532            |                                                  |                                               |                   |

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2024 wie folgt (wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt).

| Zum 31. Dez. 2024                       |                                               |                   | Zum 31. Dez. 2024                            |                                                      |                   |
|-----------------------------------------|-----------------------------------------------|-------------------|----------------------------------------------|------------------------------------------------------|-------------------|
| Fonds                                   | Sicherheitenemittent                          | Marktwert (000\$) | Fonds                                        | Sicherheitenemittent                                 | Marktwert (000\$) |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund   | Ginnie Mae                                    | \$ 8.426          | PIMCO European High Yield Bond Fund          | Europäische Union                                    | 23.697            |
| PIMCO Climate Bond Fund                 | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 7.750             |                                              | Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung | 2.608             |
| Commodity Real Return Fund              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 8.158             | PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Europäische Union                                    | € 22.200          |
| Diversified Income Fund                 | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 14.919            | Global Bond ESG Fund                         | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | \$ 9.082          |
|                                         | Canada Government                             | 932.152           | Income Fund                                  | Barclays Bank PLC                                    | 36.094            |
|                                         | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 65.914            |                                              | Canada Government                                    | 1.442.089         |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.652             | Low Average Duration Fund                    | Hydro-Québec                                         | 14.294            |
| Dynamic Bond Fund                       | Canada Government                             | 670.392           | Low Duration Income Fund                     | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | 5.508             |
|                                         | Hydro-Québec                                  | 114.410           |                                              | Canada Government                                    | 35.611            |
|                                         | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 50.246            | Low Duration Opportunities Fund              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | 17.340            |
| Emerging Local Bond Fund                | United Kingdom Government                     | 249               | Mortgage Opportunities Fund                  | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | 139.796           |
| Emerging Local Bond ESG Fund            | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.465             | StocksPLUS™ Fund                             | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | 5.712             |
| Emerging Markets Bond ESG Fund          | Canada Government                             | 71.589            |                                              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | 464.145           |
|                                         | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 24.385            | PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                    | Ginnie Mae                                           | 554               |
| Euro Income Bond Fund                   | Europäische Investitionsbank                  | € 4.287           |                                              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | 1.938             |
|                                         | Germany Government                            | 156.834           | UK Corporate Bond Fund                       | Regierung des Vereinigten Königreichs                | £ 2.160           |
| Euro Short-Term Fund                    | Germany Government                            | 25.261            |                                              |                                                      |                   |
|                                         |                                               |                   | UK Long Term Corporate Bond Fund             | United Kingdom Government                            | 5.348             |
|                                         |                                               |                   | US Short-Term Fund                           | Canada Government                                    | \$ 17.417         |
|                                         |                                               |                   |                                              | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika        | 118.091           |

## (iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2025 wie folgt:

| Fonds                                     | Wertpapierart                | Beschreibung der Sicherheiten                | Art der Sicherheiten | Marktwert (000\$) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|-------------------------------------------|------------------------------|----------------------------------------------|----------------------|-------------------|----------|------------------------------------|--------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund           | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | \$ 281            | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund     | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 89                | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 14.001            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                           | Swap-Kontrakte               | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 14.102            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| PIMCO Capital Securities Fund             | Pensionsgeschäfte            | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 5.550             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                           | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 40.294            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 755               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Kanada                         | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 609               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 1.599             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 688               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| PIMCO Climate Bond Fund                   | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 3.073             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Commodity Real Return Fund                | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 2.056             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                           | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 230               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Kanada                         | FED, Bilateral          |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund      | Pensionsgeschäfte            | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 20.064            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 49.259            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Diversified Income Fund                   | Pensionsgeschäfte            | Province of Ontario                          | Treasury             | 83.090            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 22.651            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Quebec                           | Treasury             | 53.193            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Quebec                           | Treasury             | 83.185            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                           | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 285               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| Dynamic Bond Fund                         | Pensionsgeschäfte            | Canada Government Bond                       | Treasury             | 29.996            | AA+      | 3 Monate - 1 Jahr                  | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Canada Government Bond                       | Treasury             | 153.235           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Canada Government Bond                       | Treasury             | 70.669            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Canada Housing Trust                         | Treasury             | 43.155            | AAA      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Hydro-Québec                                 | Treasury             | 60.443            | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Alberta                          | Treasury             | 90.641            | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of British Columbia                 | Treasury             | 36.414            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 265.483           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 36.471            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 56.884            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Quebec                           | Treasury             | 45.327            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | Province of Quebec                           | Treasury             | 27.068            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                           |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 102               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 116.590           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                           | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Province of Quebec                           | Treasury             | 73                | AA-      | 3 Monate - 1 Jahr                  | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
| Emerging Local Bond Fund                  | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 290               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 1.754             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                           | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 2.520             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| Emerging Local Bond ESG Fund              | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 6.844             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                           | Swap-Kontrakte               | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 6.844             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| Emerging Markets Bond Fund                | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 250               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 1.339             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 1.344             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Emerging Markets Bond ESG Fund            | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 103               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 58.089            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                           | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 319               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                           |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 340               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 1.499             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| Fonds                                               | Wertpapierart                   | Sicherheiten<br>Beschreibung                    | Art der<br>Sicherheiten | Markt-<br>Wert<br>(000\$) | Qualität | Fälligkeits-<br>profil der<br>Sicherheiten | Währung der<br>Sicherheiten | Gründungsland<br>des Kontrahenten | Abrechnungs<br>und Clearing |
|-----------------------------------------------------|---------------------------------|-------------------------------------------------|-------------------------|---------------------------|----------|--------------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------------|-----------------------------|
| PIMCO ESG<br>Income Fund                            | Pensionsgeschäfte               | Ginnie Mae                                      | Mortgage<br>Pass Thru   | \$ 4.189                  | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Frankreich                        | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | Ginnie Mae                                      | Mortgage<br>Pass Thru   | 30.793                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Notes                             | Treasury                | 13.989                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Frankreich                        | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Notes                             | Treasury                | 54.346                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
| Euro Bond Fund                                      | Pensionsgeschäfte               | Europäische Union                               | Treasury                | € 23.779                  | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
| Euro Credit Fund                                    | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                                 | Zahlungsmittel          | 37                        | k. A.    | k. A.                                      | USD                         | Großbritannien                    | FED, Bilateral              |
|                                                     | Pensionsgeschäfte               | Belgium Government Bond                         | Treasury                | 17.656                    | AA-      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
| Euro Income<br>Bond Fund                            | Pensionsgeschäfte               | Europäische Union                               | Treasury                | 189.544                   | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
| Euro Short-Term Fund                                | Pensionsgeschäfte               | BNG Bank NV                                     | Treasury                | 5.152                     | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
|                                                     |                                 | Europäische<br>Finanzstabilisierungsfazilität   | Treasury                | 5.178                     | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
|                                                     |                                 | Europäische<br>Investitionsbank                 | Treasury                | 5.081                     | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
|                                                     |                                 | Europäische Union                               | Treasury                | 5.204                     | AAA      | Unter 1 Monat                              | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
|                                                     |                                 | Europäische Union                               | Treasury                | 5.206                     | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
|                                                     |                                 | Land Niedersachsen                              | Treasury                | 3.464                     | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | DEUTSCHLAND, Bilateral      |
|                                                     |                                 | SFIL S.A.                                       | Treasury                | 5.169                     | AA-      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
|                                                     |                                 |                                                 |                         |                           |          |                                            |                             |                                   |                             |
| PIMCO European<br>High Yield<br>Bond Fund           | Pensionsgeschäfte               | Belgium Government Bond                         | Treasury                | 7.552                     | AA-      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
| PIMCO European Short-<br>Term<br>Opportunities Fund | Pensionsgeschäfte               | Europäische Union                               | Treasury                | 79.532                    | AAA      | Mehr als 1 Jahr                            | EUR                         | Frankreich                        | EUROCLEAR, Bilateral        |
| Global Bond Fund                                    | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds                             | Treasury                | 425                       | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | USA                               | FED, Bilateral              |
| Global Bond<br>ESG Fund                             | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds                             | Treasury                | \$ 448                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
| Global High Yield<br>Bond Fund                      | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                                 | Zahlungsmittel          | 60                        | k. A.    | k. A.                                      | USD                         | Großbritannien                    | FED, Bilateral              |
| Global Investment<br>Grade<br>Credit Fund           | Pensions-<br>geschäfte          | U.S. Treasury Bonds                             | Treasury                | 937                       | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | Province of Alberta                             | Treasury                | 84.891                    | AA       | Mehr als 1 Jahr                            | CAD                         | USA                               | KANADA, Bilateral           |
|                                                     |                                 | Province of British<br>Columbia                 | Treasury                | 49.665                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | CAD                         | Vereinigte Staaten                | KANADA, Bilateral           |
|                                                     |                                 | Province of<br>Newfoundland<br>and Labrador     | Treasury                | 51.141                    | A        | Mehr als 1 Jahr                            | CAD                         | Vereinigte Staaten                | KANADA, Bilateral           |
|                                                     |                                 | Province of Ontario                             | Treasury                | 157.840                   | AA-      | Mehr als 1 Jahr                            | CAD                         | Kanada                            | KANADA, Bilateral           |
|                                                     |                                 | Province of Ontario                             | Treasury                | 97.860                    | AA-      | Mehr als 1 Jahr                            | CAD                         | Vereinigte Staaten                | KANADA, Bilateral           |
|                                                     |                                 | Province of Quebec                              | Treasury                | 32.478                    | AA-      | Mehr als 1 Jahr                            | CAD                         | Vereinigte Staaten                | KANADA, Bilateral           |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Notes                             | Treasury                | 19.994                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte                 | Barsicherheiten         | 593                       | k. A.    | k. A.                                      | CAD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Bonds                             | Treasury                | 426                       | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Notes                             | Treasury                | 20.124                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Frankreich                        | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Notes                             | Treasury                | 13.584                    | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte                 | Barsicherheiten         | 610                       | k. A.    | k. A.                                      | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Bonds                             | Treasury                | 78                        | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
| Global Low Duration<br>Real Return Fund             | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                                 | Zahlungsmittel          | 1.630                     | k. A.    | k. A.                                      | USD                         | Kanada                            | FED, Bilateral              |
| Global Real<br>Return Fund                          | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                                 | Zahlungsmittel          | 2.250                     | k. A.    | k. A.                                      | USD                         | Kanada                            | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Bonds                             | Treasury                | 1.599                     | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Inflation<br>Protected Securities | Treasury                | 259                       | AA+      | 3 Monate - 1 Jahr                          | USD                         | Vereinigte Staaten                | FED, Bilateral              |
|                                                     |                                 | U.S. Treasury Notes                             | Treasury                | 4.503                     | AA+      | Mehr als 1 Jahr                            | USD                         | Kanada                            | FED, Bilateral              |

| Fonds                                            | Wertpapierart                | Beschreibung der Sicherheiten                | Art der Sicherheiten | Marktwert (000\$) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|--------------------------------------------------|------------------------------|----------------------------------------------|----------------------|-------------------|----------|------------------------------------|--------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| Income Fund                                      | Pensionsgeschäfte            | Barclays Bank PLC                            | Treasury             | \$ 130.630        | A+       | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Großbritannien                 | DTCC, Bilateral         |
|                                                  |                              | Canada Government Bond                       | Treasury             | 714.044           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Canada Government Bond                       | Treasury             | 187.486           | AA+      | 3 Monate - 1 Jahr                  | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Canada Government Bond                       | Treasury             | 373.711           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Canadian Government Real Return Bond         | Treasury             | 229.151           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Hydro-Québec                                 | Treasury             | 440.015           | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Alberta                          | Treasury             | 388.593           | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Alberta                          | Treasury             | 157.189           | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of British Columbia                 | Treasury             | 248.929           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of British Columbia                 | Treasury             | 164.240           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Manitoba                         | Treasury             | 160.527           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 1.478.423         | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 225.001           | AA-      | 3 Monate - 1 Jahr                  | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 3.034.738         | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Quebec                           | Treasury             | 1.448.568         | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Quebec                           | Treasury             | 2.007.648         | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
| Inflation Multi-Asset Fund                       | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 280               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 602               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 50                | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 340               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Low Average Duration Fund                        | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 103               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 57.678            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 69.222            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 58.506            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 91.504            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 73.108            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Low Duration Income Fund                         | Pensionsgeschäfte            | Canada Government Bond                       | Treasury             | 37.450            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Alberta                          | Treasury             | 61.821            | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of British Columbia                 | Treasury             | 35.475            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Ontario                          | Treasury             | 37.718            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | Province of Quebec                           | Treasury             | 277.778           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 102               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 73.108            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 73.108            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 73.108            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 73.108            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Low Duration Opportunities Fund                  | Pensionsgeschäfte            | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 388               | k. A.    | k. A.                              | CAD                      | Kanada                         | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 107.175           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 107.175           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 107.175           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 1.100             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 2.089             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 2.089             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 2.089             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Mortgage Opportunities Fund                      | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 29.848            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 29.848            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 29.848            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 29.848            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| StocksPLUS™ Fund                                 | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 2.375             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Pensionsgeschäfte            | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru   | 258.504           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Swap-Kontrakte               | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 205.119           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 1.932             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                        | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 50                | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 50                | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 50                | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                                  |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel       | 50                | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |

## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| Fonds                                   | Wertpapierart                | Beschreibung der Sicherheiten                | Art der Sicherheiten | Marktwert (000\$) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|-----------------------------------------|------------------------------|----------------------------------------------|----------------------|-------------------|----------|------------------------------------|--------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| Total Return Bond Fund                  | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | \$ 603            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury             | 643               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Kanada                         | FED, Bilateral          |
| US High Yield Bond Fund                 | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 71.312            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 14.291            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury             | 1.183             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 17.067            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| US Short-Term Fund                      | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury             | 18.815            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2024 wie folgt:

| Fonds                                   | Wertpapierart                | Beschreibung der Sicherheiten                | Art der Sicherheiten        | Marktwert (000\$) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|-----------------------------------------|------------------------------|----------------------------------------------|-----------------------------|-------------------|----------|------------------------------------|--------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund   | Pensionsgeschäfte            | Ginnie Mae                                   | Mortgage Pass Thru          | \$ 8.426          | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury                    | 7.750             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| PIMCO Capital Securities Fund           | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel              | 211               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| PIMCO Climate Bond Fund                 | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury                    | 8.158             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Commodity Real Return Fund              | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury                    | 3.903             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury                    | 11.016            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel              | 1.340             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel              | 410               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel              | 2.200             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Diversified Income Fund                 | Pensionsgeschäfte            | Province of Alberta                          | Treasury                    | 269               | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of British Columbia                 | Treasury                    | 100.108           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Ontario                          | Treasury                    | 117.845           | AA-      | 3 Monate - 1 Jahr                  | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Ontario                          | Treasury                    | 14.319            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Ontario                          | Treasury                    | 602.452           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Quebec                           | Treasury                    | 92.727            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury                    | 103               | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury                    | 65.811            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel              | 232               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | Canada Government Bond                       | Treasury                    | 4.432             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury                    | 2.652             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Dynamic Bond Fund                       | Pensionsgeschäfte            | Canada Government Bond                       | Treasury                    | 213.473           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Großbritannien                 | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Hydro-Québec                                 | Treasury                    | 114.410           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of British Columbia                 | Treasury                    | 27.805            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Ontario                          | Treasury                    | 21.480            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Ontario                          | Treasury                    | 243.485           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Quebec                           | Treasury                    | 7.113             | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Quebec                           | Treasury                    | 157.036           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury                    | 16.464            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         |                              | U.S. Treasury Notes                          | Treasury                    | 33.782            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                         | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel              | 2.540             | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| Emerging Local Bond Fund                | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | United Kingdom Inflation-Linked Gilt         | Treasury                    | 249               | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | GBP                      | Großbritannien                 | EUROCLEAR, Bilateral    |
| Emerging Local Bond ESG Fund            | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                          | Treasury                    | 3.465             | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| Emerging Markets Bond ESG Fund          | Pensionsgeschäfte            | Province of Alberta                          | Treasury                    | 60.885            | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | Province of Newfoundland                     | Treasury                    | 10.704            | A        | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                         |                              | U.S. Treasury Bonds                          | Treasury                    | 24.385            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Euro Bond Fund                          | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                              | Zahlungsmittel <sup>€</sup> | 42                | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |

| Fonds                                        | Wertpapierart                | Beschreibung der Sicherheiten                        | Art der Sicherheiten | Marktwert (000S) | Qualität | Fälligkeitsprofil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|----------------------------------------------|------------------------------|------------------------------------------------------|----------------------|------------------|----------|------------------------------------|--------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| Euro Income Bond Fund                        | Pensionsgeschäfte            | Europäische Investitionsbank                         | Treasury             | € 4.287          | AAA      | Mehr als 1 Jahr                    | EUR                      | Frankreich                     | EUROCLEAR, Bilateral    |
|                                              |                              | Freie Hansestadt Bremen                              | Treasury             | 86.987           | AAA      | Mehr als 1 Jahr                    | EUR                      | Deutschland                    | DEUTSCHLAND, Bilateral  |
|                                              |                              | Land Hessen                                          | Treasury             | 69.847           | AAA      | Mehr als 1 Jahr                    | EUR                      | Deutschland                    | DEUTSCHLAND, Bilateral  |
| Euro Short-Term Fund                         | Pensionsgeschäfte            | Landesbank Baden-Wuerttemberg                        | Treasury             | 25.261           | A+       | Mehr als 1 Jahr                    | EUR                      | Deutschland                    | DEUTSCHLAND, Bilateral  |
| PIMCO European High Yield Bond Fund          | Pensionsgeschäfte            | Europäische Union                                    | Treasury             | 23.697           | AAA      | Mehr als 1 Jahr                    | EUR                      | Frankreich                     | EUROCLEAR, Bilateral    |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund | Pensionsgeschäfte            | Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung | Treasury             | 2.608            | AAA      | Mehr als 1 Jahr                    | EUR                      | Frankreich                     | EUROCLEAR, Bilateral    |
|                                              |                              | Europäische Union                                    | Treasury             | 22.200           | AAA      | Mehr als 1 Jahr                    | EUR                      | Vereinigte Staaten             | EUROCLEAR, Bilateral    |
| Global Bond ESG Fund                         | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | \$ 8.772         | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | EUROCLEAR, Bilateral    |
|                                              | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 10               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| Global Bond Ex-US Fund                       | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                                  | Treasury             | 310              | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | EUROCLEAR, Bilateral    |
|                                              | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 1.200            | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| Global High Yield Bond Fund                  | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 730              | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Global Low Duration Real Return Fund         | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 10               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| Income Fund                                  | Pensionsgeschäfte            | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 691              | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                              |                              | Barclays Bank PLC                                    | Treasury             | 36.094           | A        | 3 Monate - 1 Jahr                  | USD                      | Großbritannien                 | DTC, Bilateral          |
|                                              |                              | Hydro-Québec                                         | Treasury             | 14.294           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | Province of Alberta                                  | Treasury             | 25.961           | AA       | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | Province of British Columbia                         | Treasury             | 34.690           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | Province of British Columbia                         | Treasury             | 99.966           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | Province of Ontario                                  | Treasury             | 701.511          | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | Province of Ontario                                  | Treasury             | 187.165          | AA-      | 3 Monate - 1 Jahr                  | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | Province of Ontario                                  | Treasury             | 221.480          | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | Province of Quebec                                   | Treasury             | 171.158          | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                              | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Province of Quebec                                   | Treasury             | 158              | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Kanada                         | KANADA, Bilateral       |
|                                              | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 33.610           | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Inflation Multi-Asset Fund                   | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 30               | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| Low Average Duration Fund                    | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | 5.508            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Low Duration Income Fund                     | Pensionsgeschäfte            | Province of Quebec                                   | Treasury             | 35.611           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | 17.340           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Low Duration Opportunities Fund              | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | 102              | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                              |                              | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | 139.694          | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| Mortgage Opportunities Fund                  | Pensionsgeschäfte            | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 600              | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
|                                              |                              | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | 5.712            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
| StocksPLUS™ Fund                             | Pensionsgeschäfte            | U.S. Treasury Bonds                                  | Treasury             | 254.970          | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                              |                              | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | 209.175          | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                              | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 570              | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                    | Pensionsgeschäfte            | Ginnie Mae                                           | Mortgage Pass Thru   | 554              | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
|                                              |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities         | Treasury             | 1.938            | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Frankreich                     | FED, Bilateral          |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund   | Swap-Kontrakte               | Barsicherheiten                                      | Zahlungsmittel       | 330              | k. A.    | k. A.                              | USD                      | Großbritannien                 | FED, Bilateral          |
| UK Corporate Bond Fund                       | Pensionsgeschäfte            | United Kingdom Inflation-Linked Gilt                 | Treasury             | £ 2.160          | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | GBP                      | Frankreich                     | EUROCLEAR, Bilateral    |
| UK Long Term Corporate Bond Fund             | Pensionsgeschäfte            | United Kingdom Inflation-Linked Gilt                 | Treasury             | 5.348            | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | GBP                      | Frankreich                     | EUROCLEAR, Bilateral    |
| US Short-Term Fund                           | Pensionsgeschäfte            | Province of Quebec                                   | Treasury             | 17.417           | AA-      | Mehr als 1 Jahr                    | CAD                      | Vereinigte Staaten             | KANADA, Bilateral       |
|                                              |                              | U.S. Treasury Inflation Protected Securities         | Treasury             | \$ 101.771       | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |
|                                              |                              | U.S. Treasury Notes                                  | Treasury             | 16.320           | AA+      | Mehr als 1 Jahr                    | USD                      | Vereinigte Staaten             | FED, Bilateral          |



## Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst aufgelaufene Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Kauf-/Rückverkaufsgeschäften, Verkauf-/Rückkaufgeschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 für alle Sicherheiten, die für gemäß diesen Vereinbarungen abgeschlossene Geschäfte erhalten wurden, ist oben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft separat zu analysieren.

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab, und der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

### (c) Rendite/Kosten

Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2025 und zum 30. Juni 2024. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

| Fonds                                            | 30. Jun. 2025          |                  |                                 |                  |                                                   |                  |                                                   |                  |
|--------------------------------------------------|------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|------------------|
|                                                  | Pensions-<br>geschäfte |                  | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte |                  | Kauf-/Rückverkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte |                  | Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte |                  |
|                                                  | Renditen<br>(000S)     | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)              | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)                                | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)                                | Kosten<br>(000S) |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 167                 | \$ 0             | \$ 0                            | \$ (388)         | \$ 0                                              | \$ 0             | \$ 0                                              | \$ 0             |
| Asia Strategic Interest Bond Fund                | 50                     | 0                | 0                               | (3)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 951                    | 0                | 0                               | (49)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO Capital Securities Fund                    | 252                    | 0                | 0                               | (6.302)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO Climate Bond Fund                          | 45                     | 0                | 0                               | (12)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Commodity Real Return Fund                       | 232                    | 0                | 0                               | (5.431)          | 0                                                 | (13)             | 0                                                 | (160)            |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 1.159                  | 0                | 0                               | (23)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Diversified Income Fund                          | 7.242                  | 0                | 34                              | (1.413)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Diversified Income Duration Hedged Fund          | 51                     | 0                | 0                               | (15)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Diversified Income ESG Fund                      | 0                      | 0                | 0                               | (3)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Dynamic Bond Fund                                | 14.840                 | 0                | 0                               | (86)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Emerging Local Bond Fund                         | 647                    | 0                | 301                             | (9.085)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Emerging Local Bond ESG Fund                     | 131                    | 0                | 0                               | (325)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Emerging Markets Bond Fund                       | 1                      | 0                | 0                               | (6.961)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 808                    | 0                | 0                               | (6.095)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (5)              |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 0                      | 0                | 0                               | (73)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 101                    | 0                | 0                               | (809)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 26                     | 0                | 0                               | (8)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO ESG Income Fund                            | 1.486                  | 0                | 0                               | (46)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (2)              |
| Euro Bond Fund                                   | € 155                  | € 0              | € 0                             | € (23)           | € 0                                               | € 0              | € 0                                               | € 0              |
| Euro Credit Fund                                 | 75                     | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Euro Income Bond Fund                            | 2.045                  | 0                | 0                               | (74)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Euro Long Average Duration Fund                  | 61                     | 0                | 0                               | (3.911)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Euro Short-Term Fund                             | 177                    | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO European High Yield Bond Fund              | 171                    | 0                | 0                               | (30)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 342                    | 0                | 0                               | (8)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Global Advantage Fund                            | \$ 0                   | \$ 0             | \$ 0                            | \$ (488)         | \$ 0                                              | \$ (1)           | \$ 0                                              | \$ (299)         |
| Global Bond Fund                                 | 261                    | 0                | 3                               | (3.270)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (698)            |
| Global Bond ESG Fund                             | 386                    | 0                | 0                               | (3.166)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (3.772)          |
| Global Bond Ex-US Fund                           | 0                      | 0                | 0                               | (268)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (453)            |
| Global High Yield Bond Fund                      | 335                    | 0                | 0                               | (1.966)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (11)             |
| Global Investment Grade Credit Fund              | 3.158                  | 0                | 0                               | (505)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (216)            |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 548                    | 0                | 0                               | (848)            | 0                                                 | (29)             | 0                                                 | (573)            |
| Global Low Duration Real Return Fund             | 1                      | 0                | 0                               | (14.020)         | 0                                                 | (54)             | 0                                                 | (517)            |
| Global Real Return Fund                          | 7                      | 0                | 0                               | (23.610)         | 0                                                 | (7)              | 0                                                 | (367)            |
| Income Fund                                      | 78.006                 | 0                | 0                               | (466)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Income Fund II                                   | 1                      | 0                | 0                               | (60)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (57)             |
| Inflation Multi-Asset Fund                       | 0                      | 0                | 0                               | (299)            | 0                                                 | (17)             | 0                                                 | (399)            |
| Low Average Duration Fund                        | 579                    | 0                | 0                               | (1.079)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (79)             |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 2.276                  | 0                | 0                               | (161)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Low Duration Income Fund                         | 1.990                  | 0                | 0                               | (81)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Low Duration Opportunities Fund                  | 2.005                  | 0                | 0                               | (6)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Low Duration Opportunities ESG Fund              | 0                      | 0                | 0                               | (7)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (12)             |
| Mortgage Opportunities Fund                      | 914                    | 0                | 0                               | (4.698)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (5)              |

### (iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 nicht wiederverwendet.

Die zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust gehalten.

### (v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Die von den Fonds zum 30. Juni 2025 und zum 31. Dezember 2024 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennte oder Sammelkonten handelt.

| 30. Jun. 2025                              |                        |                  |                                 |                  |                                                   |                  |                                                   |                  |
|--------------------------------------------|------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Fonds                                      | Pensions-<br>geschäfte |                  | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte |                  | Kauf-/Rückverkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte |                  | Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte |                  |
|                                            | Renditen<br>(000S)     | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)              | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)                                | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)                                | Kosten<br>(000S) |
| StocksPLUS™ Fund                           | \$ 13.825              | \$ 0             | \$ 0                            | \$ 0             | \$ 0                                              | \$ 0             | \$ 0                                              | \$ 0             |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                  | 50                     | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Strategic Income Fund                      | 151                    | 0                | 0                               | (1.420)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (485)            |
| Total Return Bond Fund                     | 0                      | 0                | 0                               | (2.847)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (409)            |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 105                    | 0                | 0                               | (80)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| UK Corporate Bond Fund                     | £ 39                   | £ 0              | £ 0                             | £ (6)            | £ 0                                               | £ 0              | £ 0                                               | £ 0              |
| UK Long Term Corporate Bond Fund           | 14                     | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| US High Yield Bond Fund                    | \$ 1.218               | \$ 0             | \$ 2                            | \$ (846)         | \$ 0                                              | \$ 0             | \$ 0                                              | \$ 0             |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund    | 351                    | 0                | 0                               | (290)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (2)              |
| US Short-Term Fund                         | 979                    | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | (6)              | 0                                                 | (22)             |

  

| 30. Jun. 2024                                    |                        |                  |                                 |                  |                                                   |                  |                                                   |                  |
|--------------------------------------------------|------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|------------------|---------------------------------------------------|------------------|
| Fonds                                            | Pensions-<br>geschäfte |                  | Umgekehrte<br>Pensionsgeschäfte |                  | Kauf-/Rückverkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte |                  | Verkauf-/Rückkauf-<br>Finanzierungs-<br>geschäfte |                  |
|                                                  | Renditen<br>(000S)     | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)              | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)                                | Kosten<br>(000S) | Renditen<br>(000S)                                | Kosten<br>(000S) |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund                  | \$ 112                 | \$ 0             | \$ 0                            | \$ (393)         | \$ 0                                              | \$ 0             | \$ 0                                              | \$ 0             |
| Asia Strategic Interest Bond Fund                | 12                     | 0                | 0                               | (12)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO Balanced Income and Growth Fund            | 574                    | 0                | 0                               | (98)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (20)             |
| PIMCO Capital Securities Fund                    | 836                    | 0                | 0                               | (6.456)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO Climate Bond Fund                          | 168                    | 0                | 0                               | (6)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (4)              |
| Commodity Real Return Fund                       | 517                    | 0                | 0                               | (7.148)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (897)            |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund             | 8                      | 0                | 0                               | (26)             | 0                                                 | (4)              | 0                                                 | (24)             |
| Diversified Income Fund                          | 25.629                 | 0                | 0                               | (859)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Diversified Income Duration Hedged Fund          | 1.013                  | 0                | 0                               | (13)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Diversified Income ESG Fund                      | 14                     | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Dynamic Bond Fund                                | 22.767                 | 0                | 0                               | (17)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (129)            |
| Dynamic Multi-Asset Fund                         | € 4.799                | € 0              | € 0                             | € (39)           | € 0                                               | € 0              | € 0                                               | € 0              |
| Emerging Local Bond Fund                         | \$ 177                 | \$ 0             | \$ 0                            | \$ (7.156)       | \$ 0                                              | \$ 0             | \$ 0                                              | \$ 0             |
| Emerging Local Bond ESG Fund                     | 187                    | 0                | 0                               | (106)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Emerging Markets Bond Fund                       | 68                     | 0                | 0                               | (7.156)          | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (520)            |
| Emerging Markets Bond ESG Fund                   | 603                    | 0                | 0                               | (6.238)          | 0                                                 | (38)             | 0                                                 | (725)            |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund             | 9                      | 0                | 0                               | (97)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund        | 36                     | 0                | 0                               | (37)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (105)            |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund  | 2                      | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO ESG Income Fund                            | 75                     | 0                | 0                               | (475)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (201)            |
| Euro Bond Fund                                   | € 1.446                | € 0              | € 0                             | € (90)           | € 0                                               | € 0              | € 0                                               | € 0              |
| Euro Credit Fund                                 | 151                    | 0                | 0                               | (5)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Euro Income Bond Fund                            | 1.775                  | 0                | 0                               | (144)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Euro Long Average Duration Fund                  | 325                    | 0                | 0                               | (245)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Euro Short-Term Fund                             | 241                    | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO European High Yield Bond Fund              | 425                    | 0                | 0                               | (29)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| PIMCO European Short-Term Opportunities Fund     | 92                     | 0                | 0                               | (10)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Global Advantage Fund                            | \$ 13                  | \$ 0             | \$ 0                            | \$ (89)          | \$ 0                                              | \$ (1)           | \$ 0                                              | \$ (259)         |
| Global Bond Fund                                 | 9.219                  | 0                | 0                               | (92)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (43)             |
| Global Bond ESG Fund                             | 1.912                  | 0                | 0                               | (184)            | 419                                               | (35)             | 0                                                 | (486)            |
| Global Bond Ex-US Fund                           | 19                     | 0                | 0                               | (88)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (26)             |
| Global High Yield Bond Fund                      | 98                     | 0                | 0                               | (389)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (35)             |
| Global Investment Grade Credit Fund              | 2.003                  | 0                | 0                               | (119)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (8)              |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund          | 461                    | 0                | 0                               | (1.786)          | 315                                               | (63)             | 0                                                 | (1.646)          |
| Global Low Duration Real Return Fund             | 19                     | 0                | 0                               | (16.446)         | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (422)            |
| Global Real Return Fund                          | 27                     | 0                | 0                               | (28.385)         | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (686)            |
| Income Fund                                      | 87.589                 | 0                | 0                               | (119)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (21)             |
| Income Fund II                                   | 288                    | 0                | 0                               | (50)             | 0                                                 | (2)              | 0                                                 | (27)             |
| Inflation Multi-Asset Fund                       | 8                      | 0                | 0                               | (544)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (98)             |
| Low Average Duration Fund                        | 377                    | 0                | 0                               | (1.394)          | 0                                                 | (44)             | 0                                                 | (1.819)          |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 30                     | 0                | 0                               | (314)            | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (245)            |
| Low Duration Income Fund                         | 5.160                  | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Low Duration Opportunities Fund                  | 827                    | 0                | 0                               | (41)             | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |
| Low Duration Opportunities ESG Fund              | 4                      | 0                | 0                               | (2)              | 0                                                 | 0                | 0                                                 | (1)              |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund           | 11                     | 0                | 0                               | 0                | 0                                                 | 0                | 0                                                 | 0                |

| Fonds                                      |
|--------------------------------------------|
| Mortgage Opportunities Fund                |
| StocksPLUS™ Fund                           |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund                  |
| Strategic Income Fund                      |
| Total Return Bond Fund                     |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |
| UK Corporate Bond Fund                     |
| UK Long Term Corporate Bond Fund           |
| US High Yield Bond Fund                    |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund    |
| US Short-Term Fund                         |

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteilungsvereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

Für Total Return Swaps lassen sich die Transaktionskosten nicht separat identifizieren. Für diese Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und bilden Teil des Bruttoanlageergebnisses jedes Fonds. Renditen werden als realisierte Gewinne und Veränderungen der nicht realisierten Gewinne auf den Swap-Kontrakt während des Geschäftsjahrs identifiziert und sind in der Betriebsergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten sowie in der Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

21. WESENTLICHE EREIGNISSE

Im Februar 2022 startete Russland eine Invasion der Ukraine. Infolgedessen waren Russland und andere Länder, Personen und Unternehmen, die Russlands Aggression gegenüber der Ukraine wesentlich unterstützt haben, Gegenstand von Wirtschaftssanktionen sowie Import- und Exportkontrollen, die von Ländern auf der ganzen Welt, einschließlich der USA, auferlegt wurden. Solche Maßnahmen, einschließlich der Durchsetzung von Sanktionen der Vereinigten Staaten oder anderer ähnlicher Maßnahmen gegen verschiedene russische Unternehmen und Personen sowie die Reaktion der russischen Regierung, hatten negative Auswirkungen auf die russischen, weißrussischen und sonstigen Wertpapiere, Instrumente und Volkswirtschaften und können dies auch weiterhin tun, was sich wiederum negativ auf die Fonds auswirken kann. Umfang, Dauer und Auswirkungen der russischen Militärmaßnahmen in der Ukraine, damit verbundene Sanktionen und Vergeltungsmaßnahmen sind schwer zu bestimmen, könnten aber erheblich sein und erhebliche negative Auswirkungen auf die Region haben, einschließlich erheblicher negativer Auswirkungen auf die regionale, europäische und globale Wirtschaft und die Märkte für bestimmte Wertpapiere und Rohstoffe, wie Öl und Erdgas sowie andere Sektoren. Darüber hinaus können die Fonds Anlagen in Wertpapieren und Instrumenten haben, die wirtschaftlich an die Region gebunden sind und von den Sanktionen und Gegensanktionen Russlands negativ beeinflusst wurden, einschließlich Wertverlusten und Liquiditätsabgängen. Die Sanktionen können dazu führen, dass die Fonds Portfoliobestände zu einem ungünstigen Zeitpunkt oder Preis verkaufen oder weiterhin Anlagen halten, die die Fonds möglicherweise nicht mehr halten möchten.

Seit Oktober 2023 besteht ein anhaltender bewaffneter in Israel und Gaza. Seit April 2024 führen Iran und Israel militärische Offensiven gegeneinander, was zu einer sich schnell entwickelnden Lage geführt hat. Die Fonds können in Wertpapiere und Instrumente investiert haben, die wirtschaftlich an diese Konfliktzonen gebunden sind. Solche Anlagen können gegebenenfalls durch Sanktionen und Gegensanktionen beeinträchtigt worden sein, einschließlich Wertverluste und Rückgang der Liquidität. Die Verringerung der Liquidität von Anlagen kann dazu führen, dass die Fonds Portfoliobestände zu einem ungünstigen Zeitpunkt oder zu einem ungünstigen Preis verkaufen. PIMCO wird diese Positionen weiterhin aktiv im besten Interesse der Fonds und ihrer Anteilinhaber verwalten.

Im April 2025 hat die US-Regierung angedeutet, ihren Ansatz für die internationale Handelspolitik ändern zu wollen, einschließlich in einigen Fällen mit der Neuverhandlung, Änderung oder Beendigung bestimmter bilateraler oder multilateraler Handelsvereinbarungen mit ausländischen Ländern, und sie hat vorgeschlagen, entsprechende Maßnahmen zu ergreifen und/oder entsprechende Maßnahmen ergriffen, einschließlich der Auferlegung oder der angekündigten potenziellen Auferlegung einer breiten Palette von Zöllen. Die Verhängung von Zöllen, Handelsbeschränkungen, Devisenbeschränkungen oder ähnlichen Maßnahmen (oder entsprechende Vergeltungsmaßnahmen) könnte beispielsweise zu Preisvolatilität, einer schlechteren Marktstimmung und Veränderungen der Inflationserwartungen führen. Diese und andere geopolitische Ereignisse können zu einer erhöhten Instabilität der US-amerikanischen und globalen Volkswirtschaften und Märkte beitragen, was sich negativ auf die Performance der Fonds und ihrer Anlagen auswirken kann.

Am 14. April 2025 wurde die Ausschüttungshäufigkeit aller Administrative-Klassen des PIMCO Balanced Income and Growth Fund und alle Institutional-, Investor-Income- und Investor-Income-II-Klassen des PIMCO Capital Securities Fund von vierteljährlich auf monatlich geändert.

30. Jun. 2024

|    | Pensions-geschäfte |               | Umgekehrte Pensions-geschäfte |               | Kauf-/Rückverkauf-Finanzierungs-geschäfte |               | Verkauf-/Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte |               |
|----|--------------------|---------------|-------------------------------|---------------|-------------------------------------------|---------------|-------------------------------------------|---------------|
|    | Renditen (000S)    | Kosten (000S) | Renditen (000S)               | Kosten (000S) | Renditen (000S)                           | Kosten (000S) | Renditen (000S)                           | Kosten (000S) |
| \$ | 2.137              | \$ 0          | \$ 0                          | \$ (260)      | \$ 0                                      | \$ 0          | \$ 0                                      | \$ (38)       |
|    | 18.889             | 0             | 0                             | 0             | 0                                         | 0             | 0                                         | 0             |
|    | 54                 | 0             | 0                             | 0             | 0                                         | 0             | 0                                         | 0             |
|    | 12                 | 0             | 0                             | (445)         | 0                                         | 0             | 0                                         | (247)         |
|    | 41                 | 0             | 0                             | (1.318)       | 0                                         | 0             | 0                                         | (1.299)       |
|    | 607                | 0             | 0                             | 0             | 0                                         | 0             | 0                                         | 0             |
| £  | 51                 | £ 0           | £ 0                           | £ (384)       | £ 0                                       | £ 0           | £ 0                                       | £ 0           |
|    | 73                 | 0             | 0                             | (83)          | 0                                         | 0             | 0                                         | 0             |
| \$ | 115                | \$ 0          | \$ 14                         | \$ (170)      | \$ 0                                      | \$ 0          | \$ 0                                      | \$ (5)        |
|    | 10                 | 0             | 0                             | (174)         | 0                                         | 0             | 0                                         | (96)          |
|    | 2.250              | 0             | 0                             | 0             | 0                                         | 0             | 0                                         | (29)          |

Am 29. Mai 2025 wurde der bestehende Verzicht auf die Verwaltungsgebühr des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund in Höhe von 15 Basispunkten aufgehoben und die Gesamtgebühr für alle Klassen des Fonds wurde um 16 Basispunkte gesenkt.

Am selben Tag wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die Class H Institutional des Euro Credit Fund um ein Jahr bis zum 30. Juni 2026 verlängert.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

22. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Nach dem Ende des Berichtszeitraums hat die US-Regierung angedeutet, ihren Ansatz für die internationale Handelspolitik ändern zu wollen, einschließlich in einigen Fällen Neuverhandlung, Änderung oder Beendigung bestimmter bilateraler oder multilateraler Handelsvereinbarungen mit ausländischen Ländern, und sie hat vorgeschlagen, entsprechende Maßnahmen zu ergreifen und/oder entsprechende Maßnahmen ergriffen, einschließlich der Einführung oder der angekündigten potenziellen Einführung einer breiten Palette von Zöllen. Die Einführung von Zöllen, Handelsbeschränkungen, Devisenbeschränkungen oder ähnlichen Maßnahmen (oder entsprechende Vergeltungsmaßnahmen) könnte beispielsweise zu Preisvolatilität, einer reduzierten Marktstimmung und Veränderungen der Inflationserwartungen führen. Diese und andere geopolitische Ereignisse können zu einer erhöhten Instabilität der US-amerikanischen und globalen Volkswirtschaften und Märkte beitragen, was sich negativ auf die Performance der Fonds und ihrer Anlagen auswirken kann. Die Bekanntgabe der neuen Zölle liefert keine zusätzlichen Informationen über die Situation zum 30. Juni 2025 und ist somit ein nicht anzupassendes Ereignis. Daher wurden ihre Auswirkungen nach dem Ende des Berichtszeitraums bei der Erfassung und/oder Bewertung der Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten der Gesellschaft zum 30. Juni 2025 nicht berücksichtigt.

Am 29. Juli 2025 wurde der Verkaufsprospekt der Gesellschaft wie folgt aktualisiert:

- Auflegung der F Institutional Class: Am Hauptteil des Verkaufsprospekts wurden Änderungen vorgenommen, um einen neuen Anteilsklassentyp, nämlich die F Institutional Class, zu berücksichtigen.
- Aktualisierungen der steuerlichen Angaben.
- Absehung des „Risikos in Verbindung mit dem Auslaufen der Verwendung des LIBOR“ aus den allgemeinen Risikofaktoren.
- Wesentliche Informationen zu Anteilstransaktionen: Verweise auf die UM Retail Class wurden in die Tabelle der Anteilsklassen im Hauptteil des Verkaufsprospekts aufgenommen.
- Änderung der Angaben zu Vertriebsgebühr, Servicegebühr und Bestandspflegegebühr: Der Hauptteil des Verkaufsprospekts wurde um aktualisierte Angaben ergänzt, um zu berücksichtigen, dass die Gebühren an „die Verwaltungsstelle oder die Vertriebsstelle“ gezahlt werden, um sie an die bedingt aufgeschobene Verkaufsgebühr in einer Reihe von Fondsergänzungen anzupassen.
- Änderungen der Biografien der Verwaltungsratsmitglieder: Aktualisierungen der Biografien in Bezug auf V. Mangala Ananthanarayanan, Frances Ruane und Myles Lee.
- Änderungen an Anhang 1 (Geregelte Märkte), Streichung von Anhang 3 und Änderungen an Anhang 4 (Delegation von Verwahrpflichten der Verwahrstelle).
- Auflegung von ETF-Anteilsklassen: Änderungen am Hauptteil des Verkaufsprospekts und an den Ergänzungen für den StocksPLUS Fund und den Commodity Real Return Fund wurden vorgenommen, um die Auflegung von ETF-Anteilsklassen zu ermöglichen.

Darüber hinaus wurden einige Fondsergänzungen wie folgt aktualisiert:

- Nach der Schließung und dem anschließenden Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank am 2. Mai 2024 wurde die Ergänzung für den Euro Ultra-Long Duration Fund (und alle Verweise darauf) aus dem Prospekt entfernt.
- Nach der Verschmelzung von zwei Teilfonds der Gesellschaft, dem Dynamic Multi-Asset Fund, mit dem Strategic Income Fund am

22. November 2024 wurde die Ergänzung für den Dynamic Multi-Asset Fund um eine Anmerkung ergänzt, dass der Fonds nun geschlossen ist.
- Global High Yield Bond ESG Fund: Geringfügige Aktualisierung der Ergänzung und des Anhangs in Bezug auf das Engagement des Anlageberaters bei bestimmten Emittenten im Hinblick auf die Übereinstimmung mit den anderen ESG-gekennzeichneten Fonds der Gesellschaft.
  - Auflegung neuer Anteilsklassen: Die Aufnahme der BE Retail Class in die Ergänzungen für den Diversified Income Fund und den Global Investment Grade Credit Fund und die Aufnahme der BM Retail und M Retail Classes in die Ergänzungen für den Global High Yield Bond Fund und den US High Yield Bond Fund, um die Vertriebsstrategie dieser Fonds zu erweitern.
  - Überarbeitung der Offenlegungen des russischen Engagements in bestimmten Fonds.
  - Aktualisierungen der ergänzungsspezifischen Risikofaktoren in Bezug auf den Low Duration Opportunities ESG Fund, den Dynamic Bond Fund, den Low Duration Opportunities Fund, den PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und den US Short-Term Fund.
  - Zusätzliche Angaben wurden den folgenden Fondsergänzungen in Bezug auf die neue F Institutional Class hinzugefügt: PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, Low Duration Opportunities Fund, Commodity Real Return Fund, Low Average Duration Fund, Euro Credit Fund, US Investment Grade Corporate Bond Fund, Global Advantage Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund, PIMCO ESG Income Fund, PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund, PIMCO Climate Bond Fund, Diversified Income Duration Hedged Fund, Euro Short-Term Fund, Income Fund II, UK Corporate Bond Fund, Asia Strategic Interest Bond Fund, PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund, Inflation Multi-Asset Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, Emerging Markets Corporate Bond Fund, UK Long Term Corporate Bond Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Emerging Local Bond ESG Fund, Diversified Income ESG Fund, Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund, Global High Yield Bond ESG Fund, PIMCO StocksPLUS™ AR Fund, Low Duration Opportunities ESG Fund.

Am 30. Juli 2025 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die H Institutional Class für den UK Corporate Bond Fund um ein Jahr bis zum 31. August 2026 verlängert.

Am 15. August 2025 wurde die von der PIMCO Funds: Global Investors Series plc im Namen des Global High Yield Bond Fund, des US High Yield Bond Fund und des PIMCO Asia High Yield Bond Fund mit bestimmten Kreditgebern einschließlich der MUFG Bank Ltd. („MUFG“) abgeschlossene Kreditvereinbarung geändert. Zum 26. August 2025 hatte keiner der Teilfonds im Rahmen der Kreditvereinbarung keine Kredite in Anspruch genommen. Weitere Einzelheiten werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2025 bereitgestellt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Geschäftsjahres keine anderen wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

## 23. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 26. August 2025 vom Verwaltungsrat genehmigt.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                   | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                             |                 |                   | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 32.802.518      | \$ 327.086        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 39.880.725      | \$ 397.671        |
|                                                                                | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| Philippines Government International Bond<br>6,250 % fällig am 28.02.2029      | PHP 1.407.750   | 24.223            | Pakistan Government International Bond<br>6,000 % fällig am 08.04.2026           | \$ 22.100       | 21.179            |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % fällig am 27.09.2028           | \$ 20.000       | 19.996            | Melco Resorts Finance Ltd.<br>5,750 % fällig am 21.07.2028                       | 20.300          | 19.519            |
| Health & Happiness International Holdings Ltd.<br>9,125 % fällig am 24.07.2028 | 17.800          | 17.502            | Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>5,500 % fällig am 06.04.2025             | 17.900          | 17.877            |
| Mongolia Government International Bond<br>6,625 % fällig am 25.02.2030         | 16.600          | 16.600            | Sri Lanka Government International Bond<br>3,350 % fällig am 15.03.2033          | 20.000          | 15.623            |
| IIFL Finance Ltd.<br>8,750 % fällig am 24.07.2028                              | 14.400          | 14.379            | GLP Pte. Ltd.<br>3,875 % fällig am 04.06.2025                                    | 15.575          | 15.198            |
| U.S. Treasury Notes<br>4,500 % fällig am 31.12.2031                            | 14.000          | 13.830            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.01.2032 (b) | 17.420          | 15.121            |
| Elect Global Investments Ltd.<br>7,200 % fällig am 11.09.2030                  | 11.800          | 11.800            | MGM China Holdings Ltd.<br>4,750 % fällig am 01.02.2027                          | 15.000          | 14.713            |
| Vedanta Resources Finance PLC<br>9,475 % fällig am 24.07.2030                  | 11.600          | 11.600            | Bukit Makmur Mandiri Utama PT<br>7,750 % fällig am 10.02.2026                    | 12.256          | 12.248            |
| Greentown China Holdings Ltd.<br>8,450 % fällig am 24.02.2028                  | 11.000          | 11.018            | Elect Global Investments Ltd.<br>7,200 % fällig am 11.09.2030                    | 11.800          | 11.852            |
| Sri Lanka Government International Bond<br>3,350 % fällig am 15.03.2033        | 12.690          | 9.950             | Mongolia Government International Bond<br>6,625 % fällig am 25.02.2030           | 12.000          | 11.754            |
| HSBC Holdings PLC<br>6,875 % fällig am 11.09.2029                              | 9.100           | 9.168             | Wynn Macau Ltd.<br>5,500 % fällig am 01.10.2027                                  | 11.300          | 11.102            |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,750 % fällig am 14.01.2032           | 9.000           | 9.000             | Vedanta Resources Finance PLC<br>11,250 % fällig am 03.12.2031                   | 10.400          | 11.070            |
| PDD Holdings, Inc.<br>0,000 % fällig am 01.12.2025                             | 9.000           | 8.945             | ReNew Wind Energy AP2<br>4,500 % fällig am 14.07.2028                            | 10.600          | 9.865             |
| Chugoku Electric Power Co., Inc.<br>5,742 % fällig am 14.01.2035               | 8.900           | 8.900             | NWD Finance BVI Ltd.<br>6,150 % fällig am 16.03.2025                             | 19.600          | 9.824             |
| LG Energy Solution Ltd.<br>5,875 % fällig am 02.04.2035                        | 8.800           | 8.714             | Nanyang Commercial Bank Ltd.<br>6,000 % fällig am 06.08.2034                     | 9.200           | 9.380             |
| MTR Corp. Ltd.<br>5,250 % fällig am 01.04.2055                                 | 8.800           | 8.664             | PCPD Capital Ltd.<br>5,125 % fällig am 18.06.2026                                | 9.900           | 9.310             |
| Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd.<br>6,200 % fällig am 16.01.2035               | 8.100           | 8.100             | CFAMC Co. Ltd.<br>4,750 % fällig am 27.04.2027                                   | 9.300           | 9.230             |
| Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT<br>5,375 % fällig am 23.03.2026                 | 7.300           | 7.218             | Chugoku Electric Power Co., Inc.<br>5,742 % fällig am 14.01.2035                 | 8.900           | 9.201             |
| Pertamina Hulu Energi PT<br>5,250 % fällig am 21.05.2030                       | 7.200           | 7.200             | Champion Path Holdings Ltd.<br>4,500 % fällig am 27.01.2026                      | 8.800           | 8.653             |

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Asia Strategic Interest Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                              | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|---------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                        |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                     |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                 | 2.668.066 \$    | 26.604            | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 2.714.707 \$    | 27.070            |
|                                                                                           | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                           | PARI<br>(000\$) |                   |
| Network i2i Ltd.<br>5,650 % fällig am 15.01.2025                                          | \$ 2.400        | 2.399             | Pakistan Government International Bond<br>6,000 % fällig am 08.04.2026    | \$ 2.850        | 2.755             |
| Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara<br>4,000 % fällig am 30.06.2050 | 3.300           | 2.311             | Korea National Oil Corp.<br>5,250 % fällig am 14.11.2026                  | 2.200           | 2.222             |
| Jollibee Worldwide Pte. Ltd.<br>5,332 % fällig am 02.04.2030                              | 2.100           | 2.103             | Freeport Indonesia PT<br>6,200 % fällig am 14.04.2052                     | 2.000           | 1.956             |
| Health & Happiness International Holdings Ltd.<br>9,125 % fällig am 24.07.2028            | 2.100           | 2.071             | Vedanta Resources Finance PLC<br>11,250 % fällig am 03.12.2031            | 1.600           | 1.698             |
| Pertamina Hulu Energi PT<br>5,250 % fällig am 21.05.2030                                  | 2.000           | 2.000             | Jollibee Worldwide Pte. Ltd.<br>5,332 % fällig am 02.04.2030              | 1.400           | 1.418             |
| Korea National Oil Corp.<br>2,625 % fällig am 18.04.2032                                  | 2.300           | 1.997             | GLP Pte. Ltd.<br>3,875 % fällig am 04.06.2025                             | 1.300           | 1.279             |
| IIFL Finance Ltd.<br>8,750 % fällig am 24.07.2028                                         | 1.700           | 1.700             | China Government International Bond<br>4,250 % fällig am 20.11.2029       | 1.200           | 1.202             |
| MTR Corp. CI Ltd.<br>5,625 % fällig am 24.09.2035                                         | 1.400           | 1.400             | Xiaomi Best Time International Ltd.<br>0,000 % fällig am 17.12.2027       | 900             | 1.188             |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,750 % fällig am 14.01.2032                      | 1.400           | 1.396             | Bangkok Bank PCL<br>6,056 % fällig am 25.03.2040                          | 1.200           | 1.177             |
| Vedanta Resources Finance PLC<br>9,475 % fällig am 24.07.2030                             | 1.350           | 1.341             | Sands China Ltd.<br>5,125 % fällig am 08.08.2025                          | 1.160           | 1.159             |
| Embraer Netherlands Finance BV<br>5,980 % fällig am 11.02.2035                            | 1.300           | 1.297             | Chugoku Electric Power Co., Inc.<br>5,742 % fällig am 14.01.2035          | 1.100           | 1.137             |
| GS Caltex Corp.<br>1,625 % fällig am 27.07.2025                                           | 1.300           | 1.296             | Greenko Dutch BV<br>3,850 % fällig am 29.03.2026                          | 1.164           | 1.132             |
| Goldman Sachs Finance Corp. International Ltd.<br>0,000 % fällig am 04.04.2028            | 1.200           | 1.215             | Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd.<br>6,200 % fällig am 16.01.2035          | 1.100           | 1.125             |
| KFH Sukuk Co.<br>5,376 % fällig am 14.01.2030                                             | 1.200           | 1.204             | Lenovo Group Ltd.<br>5,831 % fällig am 27.01.2028                         | 1.100           | 1.119             |
| Hyundai Capital America<br>5,800 % fällig am 26.06.2025                                   | 1.200           | 1.200             | Standard Chartered PLC<br>6,170 % fällig am 09.01.2027                    | 1.100           | 1.108             |
| Elect Global Investments Ltd.<br>7,200 % fällig am 11.09.2030                             | 1.200           | 1.200             | Bangkok Bank PCL<br>3,733 % fällig am 25.09.2034                          | 1.100           | 1.014             |
| Hanwha Life Insurance Co. Ltd.<br>6,300 % fällig am 24.06.2055                            | 1.200           | 1.200             | Bukit Makmur Mandiri Utama PT<br>7,750 % fällig am 10.02.2026             | 900             | 899               |
| Bangkok Bank PCL<br>6,056 % fällig am 25.03.2040                                          | 1.200           | 1.200             | Pacific National Finance Pty. Ltd.<br>7,750 % fällig am 11.12.2054        | AUD 1.400       | 881               |
| Yinson Boronia Production BV<br>8,498 % fällig am 31.01.2045                              | 1.200           | 1.200             | West China Cement Ltd.<br>4,950 % fällig am 08.07.2026                    | \$ 1.200        | 872               |

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Balance Income and Growth Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 75.422.591      | \$ 752.066        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 69.403.742      | \$ 692.030        |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   | RTX Corp.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 113.463         | 14.521            |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,500 % fällig am 01.02.2055                 | \$ 60.680       | 60.488            | HCA Healthcare, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 29.896          | 11.452            |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.03.2055                 | 31.105          | 31.479            | Medtronic PLC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 109.619         | 9.718             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,875 % fällig am 15.07.2034 (b) | 31.878          | 31.371            | ABB Ltd.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 166.756         | 8.505             |
|                                                                                  | AKTIEN          |                   | Tencent Holdings Ltd.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 117.700         | 7.672             |
| Microsoft Corp.                                                                  | 72.361          | 29.595            | AbbVie, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 40.593          | 7.421             |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | PARI<br>(000\$) |                   |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.10.2054                 | \$ 28.035       | 28.430            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.10.2053                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | \$ 6.974        | 7.005             |
|                                                                                  | AKTIEN          |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | AKTIEN          |                   |
| Amazon.com, Inc.                                                                 | 112.197         | 23.489            | Crown Castle, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 63.788          | 6.693             |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   | Travelers Cos., Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 23.601          | 6.166             |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.11.2054                 | \$ 23.821       | 23.172            | Cisco Systems, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 93.521          | 5.824             |
|                                                                                  | AKTIEN          |                   | Westinghouse Air Brake Technologies Corp.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 28.187          | 5.777             |
| NVIDIA Corp.                                                                     | 165.288         | 22.290            | SK Hynix, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 45.307          | 5.759             |
| Adobe, Inc.                                                                      | 54.501          | 21.216            | QUALCOMM, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 33.074          | 5.461             |
| Verizon Communications, Inc.                                                     | 366.601         | 14.823            | SAP SE                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 19.987          | 5.386             |
| Roche Holding AG                                                                 | 43.701          | 14.558            | NRG Energy, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 33.217          | 5.218             |
| Intuit, Inc.                                                                     | 22.421          | 13.395            | Abbott Laboratories                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 39.699          | 5.013             |
| Apple, Inc.                                                                      | 57.106          | 13.281            | JPMorgan Chase & Co.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 18.235          | 4.881             |
| QUALCOMM, Inc.                                                                   | 78.940          | 12.421            | Gilead Sciences, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 43.394          | 4.643             |
| Johnson & Johnson                                                                | 78.678          | 11.986            | Koninklijke Ahold Delhaize NV                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 111.180         | 4.583             |
| PayPal Holdings, Inc.                                                            | 157.748         | 11.978            | (a) Der PIMCO Balance Income and Growth Fund legt in Anteilen eines<br>verbundenen Fonds an.                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                 |                   |
| Meta Platforms, Inc. 'A'                                                         | 19.959          | 11.644            | (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                 |                   |
| Vinci S.A.                                                                       | 84.217          | 11.610            | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 %<br>der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der<br>Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe<br>und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen<br>getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                 |                   |
| Newmont Corp.                                                                    | 222.395         | 11.240            | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden<br>können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur<br>Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig<br>wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der<br>Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |                 |                   |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Capital Securities Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                   |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                   |                |                  |
| Nationwide Building Society<br>7,875 % fällig am 20.12.2031          | £ 54.600       | \$ 73.871        | Credit Agricole S.A.<br>6,500 % fällig am 23.09.2029                    | € 49.000       | \$ 58.441        |
| NatWest Group PLC<br>7,500 % fällig am 28.02.2032                    | 43.000         | 54.595           | NatWest Group PLC<br>6,000 % fällig am 29.12.2025                       | \$ 57.100      | 57.131           |
| Credit Agricole S.A.<br>5,875 % fällig am 23.03.2035                 | € 51.400       | 53.628           | BNP Paribas S.A.<br>8,000 % fällig am 22.08.2031                        | 52.500         | 55.333           |
| Nippon Life Insurance Co.<br>6,500 % fällig am 30.04.2055            | \$ 47.200      | 47.200           | Lloyds Banking Group PLC<br>4,947 % fällig am 27.06.2025                | € 52.300       | 54.833           |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,750 % fällig am 14.01.2032 | 36.200         | 36.200           | Bank of Ireland Group PLC<br>6,375 % fällig am 10.03.2030               | 41.800         | 46.432           |
| Barclays PLC<br>8,375 % fällig am 15.09.2031                         | £ 25.700       | 34.131           | Intesa Sanpaolo SpA<br>7,700 % fällig am 17.09.2025                     | \$ 43.900      | 44.361           |
| Lloyds Banking Group PLC<br>7,500 % fällig am 27.06.2030             | 25.300         | 31.927           | NatWest Group PLC<br>8,000 % fällig am 10.08.2025                       | 42.100         | 42.574           |
| CaixaBank S.A.<br>8,250 % fällig am 13.03.2029                       | € 26.000       | 30.780           | AIB Group PLC<br>6,250 % fällig am 23.06.2025                           | € 40.350       | 42.443           |
| UBS Group AG<br>7,125 % fällig am 10.08.2034                         | \$ 28.900      | 28.896           | Lloyds Banking Group PLC<br>7,500 % fällig am 27.09.2025                | \$ 36.591      | 36.997           |
| NN Group NV<br>5,750 % fällig am 11.09.2034                          | € 23.500       | 24.740           | BNP Paribas S.A.<br>7,375 % fällig am 11.06.2030                        | € 29.000       | 34.270           |
| Royal Bank of Canada<br>6,750 % fällig am 24.08.2085                 | \$ 24.500      | 24.500           | ING Groep NV<br>8,000 % fällig am 16.05.2030                            | \$ 25.400      | 26.682           |
| Royal Bank of Canada<br>4,715 % fällig am 27.03.2028                 | 24.500         | 24.500           | Barclays PLC<br>7,125 % fällig am 15.06.2025                            | £ 19.300       | 24.423           |
| Credit Agricole S.A.<br>7,250 % fällig am 23.09.2028                 | € 19.900       | 24.002           | AIB Group PLC<br>7,125 % fällig am 30.10.2029                           | € 20.800       | 24.103           |
| Bank of Nova Scotia<br>7,350 % fällig am 27.04.2085                  | \$ 24.000      | 24.000           | NatWest Group PLC<br>7,300 % fällig am 19.11.2034                       | \$ 24.100      | 24.075           |
| Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd.<br>6,200 % fällig am 16.01.2035     | 23.900         | 23.900           | Nordea Bank Abp<br>3,750 % fällig am 01.03.2029                         | 27.200         | 24.065           |
| Lloyds Banking Group PLC<br>8,500 % fällig am 27.03.2028             | £ 17.000       | 22.725           | CaixaBank S.A.<br>7,500 % fällig am 16.01.2030                          | € 18.200       | 21.791           |
| Coöperatieve Rabobank UA<br>4,625 % fällig am 29.12.2025             | € 21.200       | 22.164           | NN Group NV<br>5,250 % fällig am 01.03.2043                             | 19.000         | 21.564           |
| Nationwide Building Society<br>7,500 % fällig am 20.12.2030          | £ 17.045       | 21.921           | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,750 % fällig am 14.01.2032    | \$ 21.000      | 20.651           |
| ELO SACA<br>3,250 % fällig am 23.07.2027                             | € 23.800       | 21.324           | CaixaBank S.A.<br>3,625 % fällig am 14.09.2028                          | € 18.800       | 18.399           |
| Barclays PLC<br>9,250 % fällig am 15.09.2028                         | £ 15.600       | 21.302           | ING Groep NV<br>4,250 % fällig am 16.05.2031                            | \$ 21.600      | 17.949           |
| BNP Paribas S.A.<br>6,875 % fällig am 06.12.2029                     | € 17.400       | 19.656           | Banco Santander S.A.<br>8,000 % fällig am 01.02.2034                    | 17.200         | 17.726           |
| BNP Paribas S.A.<br>7,375 % fällig am 11.06.2030                     | 17.000         | 19.646           | KBC Group NV<br>4,750 % fällig am 17.04.2035                            | € 15.500       | 17.028           |
| AIB Group PLC<br>6,000 % fällig am 14.07.2031                        | 17.600         | 18.447           | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>7,883 % fällig am 15.11.2034    | \$ 14.200      | 15.953           |
| Societe Generale S.A.<br>10,000 % fällig am 14.11.2028               | \$ 16.600      | 18.082           | Erste Group Bank AG<br>7,000 % fällig am 15.04.2031                     | € 13.400       | 15.490           |
| KBC Group NV<br>6,250 % fällig am 17.09.2031                         | € 15.200       | 17.204           | Banque Federative du Credit Mutuel S.A.<br>4,375 % fällig am 11.01.2034 | 13.300         | 15.271           |
| ABN AMRO Bank NV<br>5,750 % fällig am 22.09.2033                     | 16.300         | 16.991           | HSBC Holdings PLC<br>5,290 % fällig am 16.09.2032                       | £ 12.100       | 15.083           |
| American Express Co.<br>3,433 % fällig am 20.05.2032                 | 14.000         | 15.668           | Credit Agricole Assurances S.A.<br>6,250 % fällig am 17.06.2035         | € 13.300       | 15.044           |
| Barclays PLC<br>8,500 % fällig am 15.06.2030                         | £ 12.200       | 15.658           | KBC Group NV<br>4,250 % fällig am 24.10.2025                            | 14.000         | 14.654           |
| Erste Group Bank AG<br>8,500 % fällig am 15.10.2028                  | € 12.600       | 15.438           | Societe Generale S.A.<br>8,000 % fällig am 29.09.2025                   | \$ 14.250      | 14.405           |
| HSBC Holdings PLC<br>6,500 % fällig am 15.09.2037                    | \$ 13.800      | 14.644           | AKTIEN                                                                  | 83.500         | 14.092           |
| Credit Agricole Assurances S.A.<br>6,250 % fällig am 17.06.2035      | € 13.300       | 14.533           |                                                                         | PARI<br>(000S) |                  |
| Deutsche Bank AG<br>7,125 % fällig am 30.10.2030                     | 12.600         | 13.603           | Deutsche Bank AG<br>7,375 % fällig am 30.10.2031                        | € 12.600       | 13.859           |
| Commerzbank AG<br>6,500 % fällig am 09.10.2029                       | 12.400         | 13.574           | Bank of Ireland Group PLC<br>6,000 % fällig am 01.09.2025               | 12.991         | 13.763           |
|                                                                      |                |                  | BPCE S.A.<br>6,508 % fällig am 18.01.2035                               | \$ 13.200      | 13.475           |
|                                                                      |                |                  | BNP Paribas S.A.<br>7,375 % fällig am 10.09.2034                        | 13.300         | 13.433           |
|                                                                      |                |                  | ELO SACA<br>3,250 % fällig am 23.07.2027                                | € 11.900       | 13.129           |
|                                                                      |                |                  | BPCE S.A.<br>6,915 % fällig am 14.01.2046                               | \$ 12.000      | 12.186           |
|                                                                      |                |                  | HSBC Holdings PLC<br>6,950 % fällig am 11.03.2034                       | 11.900         | 11.960           |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Climate Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                         |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                 | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|--------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                   |     |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                        |                |                  |
| Europäische Investitionsbank                         |     |                |                  | Europäische Investitionsbank                                 |                |                  |
| 2,875 % fällig am 18.06.2035                         | €   | 2.900          | \$ 3.319         | 3,750 % fällig am 14.02.2033                                 | \$ 5.000       | \$ 4.810         |
| Uniform Mortgage-Backed Security                     |     |                |                  | Europäische Investitionsbank                                 |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.07.2054                         | \$  | 2.894          | 2.786            | 1,500 % fällig am 15.06.2032                                 | € 3.000        | 3.150            |
| Coty, Inc.                                           |     |                |                  | Nordea Bank Abp                                              |                |                  |
| 4,750 % fällig am 15.01.2029                         |     | 2.400          | 2.325            | 6,000 % fällig am 02.06.2026                                 | £ 1.800        | 2.202            |
| Australia Government International Bond              |     |                |                  | Europäische Union                                            |                |                  |
| 4,250 % fällig am 21.06.2034                         | AUD | 3.500          | 2.182            | 2,750 % fällig am 04.02.2033                                 | € 1.800        | 2.071            |
| Cooperative Rabobank UA                              |     |                |                  | Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von |                |                  |
| 4,875 % fällig am 01.11.2030                         | £   | 1.600          | 2.015            | Eisenbahnmateral                                             |                |                  |
| RWE AG                                               |     |                |                  | 0,010 % fällig am 23.06.2028                                 | 2.000          | 2.067            |
| 4,625 % fällig am 18.06.2055                         | €   | 1.700          | 1.942            | United Kingdom Gilt                                          |                |                  |
| Canada Government International Bond                 |     |                |                  | 4,375 % fällig am 31.07.2054                                 | £ 1.800        | 2.037            |
| 2,250 % fällig am 01.12.2029                         | CAD | 2.700          | 1.920            | Standard Chartered PLC                                       |                |                  |
| Informa PLC                                          |     |                |                  | 0,800 % fällig am 17.11.2029                                 | € 1.800        | 1.885            |
| 3,375 % fällig am 09.06.2031                         | €   | 1.550          | 1.770            | Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung         |                |                  |
| Public Service Co. of Oklahoma                       |     |                |                  | 2,950 % fällig am 16.01.2035                                 | 1.600          | 1.813            |
| 2,200 % fällig am 15.08.2031                         | \$  | 2.083          | 1.761            | International Development Association                        |                |                  |
| Hanwha Energy USA Holdings Corp.                     |     |                |                  | 0,750 % fällig am 21.09.2028                                 | £ 1.450        | 1.725            |
| 4,375 % fällig am 02.07.2028                         |     | 1.700          | 1.698            | Knorr-Bremse AG                                              |                |                  |
| Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung |     |                |                  | 3,250 % fällig am 30.09.2032                                 | € 1.500        | 1.580            |
| 2,950 % fällig am 16.01.2035                         | €   | 1.600          | 1.644            | SELP Finance SARL                                            |                |                  |
| Ontario Teachers' Finance Trust                      |     |                |                  | 0,875 % fällig am 27.05.2029                                 | 1.500          | 1.446            |
| 2,850 % fällig am 04.12.2031                         |     | 1.450          | 1.636            | Europäische Investitionsbank                                 |                |                  |
| ABN AMRO Bank NV                                     |     |                |                  | 2,250 % fällig am 15.03.2030                                 | 1.230          | 1.395            |
| 2,750 % fällig am 04.06.2029                         |     | 1.400          | 1.581            | Shinhan Bank Co. Ltd.                                        |                |                  |
| Ellevio AB                                           |     |                |                  | 3,320 % fällig am 29.01.2027                                 | 1.300          | 1.350            |
| 3,750 % fällig am 14.05.2035                         |     | 1.400          | 1.579            | Digital Intrepid Holding BV                                  |                |                  |
| Danske Bank A/S                                      |     |                |                  | 0,625 % fällig am 15.07.2031                                 | 1.500          | 1.311            |
| 3,500 % fällig am 26.05.2033                         |     | 1.400          | 1.574            | Schneider Electric SE                                        |                |                  |
| Erste Group Bank AG                                  |     |                |                  | 3,000 % fällig am 03.09.2030                                 | 1.100          | 1.265            |
| 3,250 % fällig am 14.01.2033                         |     | 1.500          | 1.545            | P3 Group SARL                                                |                |                  |
| Alliander NV                                         |     |                |                  | 4,000 % fällig am 19.04.2032                                 | 1.000          | 1.132            |
| 3,500 % fällig am 06.05.2037                         |     | 1.200          | 1.361            | Carrefour S.A.                                               |                |                  |
| Statnet SF                                           |     |                |                  | 3,625 % fällig am 17.10.2032                                 | 1.000          | 1.049            |
| 3,500 % fällig am 10.06.2037                         |     | 1.100          | 1.247            | Caisse Francaise de Financement Local S.A.                   |                |                  |
| ETSA Utilities Finance Pty. Ltd.                     |     |                |                  | 3,250 % fällig am 17.04.2035                                 | 900            | 1.027            |
| 5,681 % fällig am 27.03.2035                         | AUD | 1.770          | 1.120            | France Government International Bond                         |                |                  |
| Korea Water Resources Corp.                          |     |                |                  | 0,500 % fällig am 25.06.2044                                 | 1.550          | 1.008            |
| 4,375 % fällig am 21.05.2027                         | \$  | 1.100          | 1.095            | Agence Francaise de Developpement                            |                |                  |
| U.S. Treasury Bonds                                  |     |                |                  | 3,500 % fällig am 25.02.2033                                 | 800            | 922              |
| 4,625 % fällig am 15.02.2055                         |     | 1.100          | 1.067            | France Government International Bond                         |                |                  |
| Hungary Government International Bond                |     |                |                  | 3,000 % fällig am 25.06.2049                                 | 900            | 897              |
| 4,875 % fällig am 22.03.2040                         | €   | 1.000          | 1.036            | IHG Finance LLC                                              |                |                  |
| Seyvern Trent Utilities Finance PLC                  |     |                |                  | 4,375 % fällig am 28.11.2029                                 | 800            | 871              |
| 3,875 % fällig am 04.08.2035                         |     | 1.000          | 1.036            | Owens Corning                                                |                |                  |
| Caisse Francaise de Financement Local S.A.           |     |                |                  | 5,500 % fällig am 15.06.2027                                 | \$ 800         | 811              |
| 3,250 % fällig am 17.04.2035                         |     | 900            | 1.004            | Argenta Spaarbank NV                                         |                |                  |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                      |     |                |                  | 2,500 % fällig am 25.10.2027                                 | € 600          | 695              |
| 2,500 % fällig am 09.10.2030                         |     | 900            | 1.003            | Europäische Investitionsbank                                 |                |                  |
| Swisscom Finance BV                                  |     |                |                  | 2,750 % fällig am 16.01.2034                                 | 600            | 672              |
| 3,500 % fällig am 29.11.2031                         |     | 800            | 941              | Host Hotels & Resorts LP                                     |                |                  |
| Slovenia Government International Bond               |     |                |                  | 3,375 % fällig am 15.12.2029                                 | \$ 600         | 559              |
| 3,125 % fällig am 02.07.2035                         |     | 800            | 927              | East Japan Railway Co.                                       |                |                  |
| Cassa Depositi e Prestiti SpA                        |     |                |                  | 3,533 % fällig am 04.09.2036                                 | € 500          | 553              |
| 3,250 % fällig am 17.06.2033                         |     | 800            | 906              | International Flavors & Fragrances, Inc.                     |                |                  |
| DNB Bank ASA                                         |     |                |                  | 1,832 % fällig am 15.10.2027                                 | \$ 600         | 549              |
| 3,125 % fällig am 20.05.2031                         |     | 800            | 890              | Otis Worldwide Corp.                                         |                |                  |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                    |     |                |                  | 2,565 % fällig am 15.02.2030                                 | 600            | 543              |
| 4,100 % fällig am 30.04.2046                         |     | 800            | 820              | Societe Des Grands Projets EPIC                              |                |                  |
| Southern California Edison Co.                       |     |                |                  | 3,500 % fällig am 25.05.2043                                 | € 500          | 537              |
| 3,450 % fällig am 01.02.2052                         | \$  | 1.200          | 806              | Aptiv Swiss Holdings Ltd.                                    |                |                  |
| Pacific Life Global Funding                          |     |                |                  | 3,250 % fällig am 01.03.2032                                 | \$ 600         | 526              |
| 3,125 % fällig am 18.06.2031                         | €   | 700            | 798              | Nucor Corp.                                                  |                |                  |
| Kuntarahoitus Oyj                                    |     |                |                  | 3,125 % fällig am 01.04.2032                                 | 600            | 523              |
| 2,625 % fällig am 14.06.2032                         |     | 700            | 793              | Bank of America Corp.                                        |                |                  |
| Sagax AB                                             |     |                |                  | 6,204 % fällig am 10.11.2028                                 | 500            | 515              |
| 4,000 % fällig am 13.03.2032                         |     | 600            | 646              | Prologis LP                                                  |                |                  |
| CBRE Services, Inc.                                  |     |                |                  | 1,750 % fällig am 01.02.2031                                 | 600            | 513              |
| 5,950 % fällig am 15.08.2034                         | \$  | 600            | 626              | Unilever Capital Corp.                                       |                |                  |
| Norsk Hydro ASA                                      |     |                |                  | 1,375 % fällig am 14.09.2030                                 | 600            | 497              |
| 3,625 % fällig am 23.01.2032                         | €   | 600            | 617              |                                                              |                |                  |
| Synopsys, Inc.                                       |     |                |                  |                                                              |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.04.2032                         | \$  | 600            | 599              |                                                              |                |                  |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Commodity Real Return Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                      | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                             |                |                  |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2026 (a) | \$ 63.846      | \$ 63.068        | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2026 (a)  | \$ 127.822     | \$ 126.263       |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2027 (a) | 42.832         | 43.301           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2027 (a)  | 85.674         | 86.605           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2029 (a) | 38.872         | 38.762           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2026 (a)  | 37.040         | 36.641           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2027 (a) | 28.087         | 27.417           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,625 % fällig am 15.01.2026 (a)  | 26.985         | 26.727           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.07.2026 (a) | 26.467         | 26.242           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.07.2026 (a)  | 15.346         | 15.222           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.04.2029 (a) | 20.511         | 20.957           | United Kingdom Gilt<br>1,250 % fällig am 22.11.2027                               | £ 6.214        | 8.697            |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.06.2055                                       | 21.049         | 18.766           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,875 % fällig am 15.07.2034 (a)  | \$ 8.087       | 8.054            |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.06.2052                                       | 19.210         | 17.355           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2025 (a)  | 7.298          | 7.228            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,375 % fällig am 15.01.2027 (a) | 13.132         | 12.939           | France Government International Bond<br>0,100 % fällig am 25.07.2038              | € 7.210        | 6.483            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,500 % fällig am 15.01.2028 (a) | 12.860         | 12.550           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,375 % fällig am 15.10.2028 (a)  | \$ 6.284       | 6.436            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,875 % fällig am 15.01.2029 (a) | 12.562         | 12.266           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,375 % fällig am 15.07.2033 (a)  | 5.550          | 5.318            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,250 % fällig am 15.07.2029 (a) | 12.828         | 12.022           | Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.06.2052                                        | 5.950          | 5.315            |
| Freddie Mac<br>5,305 % fällig am 25.02.2055                                      | 3.900          | 3.902            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,500 % fällig am 15.01.2028 (a)  | 5.372          | 5.184            |
| Freddie Mac<br>5,305 % fällig am 25.02.2055                                      | 3.800          | 3.801            | Option One Mortgage Loan Trust<br>4,993 % fällig am 25.01.2036                    | 1.700          | 1.566            |
| Freddie Mac<br>5,245 % fällig am 25.11.2054                                      | 3.700          | 3.700            | Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust<br>5,173 % fällig am 25.10.2035    | 1.495          | 1.257            |
| Fannie Mae<br>5,465 % fällig am 25.03.2055                                       | 3.700          | 3.699            | Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.<br>5,143 % fällig am 25.10.2035               | 800            | 713              |
| Fannie Mae<br>5,505 % fällig am 25.12.2053                                       | 3.700          | 3.695            | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034              | MXN 11.752     | 542              |
| Fannie Mae<br>5,335 % fällig am 25.06.2055                                       | 3.600          | 3.601            | Los Angeles Department of Water & Power,<br>California Revenue Bonds, Series 2010 |                |                  |
| Fannie Mae<br>5,524 % fällig am 25.07.2055                                       | 3.000          | 2.999            | 5,516 % fällig am 01.07.2027                                                      | \$ 500         | 501              |
| Fannie Mae<br>5,255 % fällig am 25.01.2055                                       | 2.700          | 2.702            |                                                                                   |                |                  |

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                          | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                    |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                |                  |
| U.S. Treasury Notes<br>4,375 % fällig am 31.12.2029                                   | \$ 17.600      | \$ 17.590        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 1.197.576      | \$ 11.942        |
| U.S. Treasury Notes<br>4,125 % fällig am 31.03.2031                                   | 7.400          | 7.440            |                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                                   | 6.298          | 6.394            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.04.2029 (b) | \$ 10.015      | 10.089           |
| U.S. Treasury Notes<br>3,875 % fällig am 30.04.2030                                   | 5.700          | 5.696            | Live Nation Entertainment, Inc.<br>7,192 % fällig am 19.10.2026                  | 2.194          | 2.189            |
| Lloyds Banking Group PLC<br>6,068 % fällig am 13.06.2036                              | 3.400          | 3.400            | Imperial Brands Finance Netherlands BV<br>5,250 % fällig am 15.02.2031           | € 1.400        | 1.733            |
| Carnival Corp.<br>4,000 % fällig am 01.08.2028                                        | 3.100          | 2.963            | JetBlue Airways Corp.<br>9,875 % fällig am 20.09.2031                            | \$ 1.700       | 1.662            |
| Las Vegas Sands Corp.<br>3,900 % fällig am 08.08.2029                                 | 2.800          | 2.612            | Morgan Stanley<br>4,889 % fällig am 20.07.2033                                   | 1.300          | 1.269            |
| Cheniere Energy, Inc.<br>5,650 % fällig am 15.04.2034                                 | 2.300          | 2.299            | Carnival Corp.<br>4,000 % fällig am 01.08.2028                                   | 1.300          | 1.232            |
| Live Nation Entertainment, Inc.<br>7,192 % fällig am 19.10.2026                       | 2.194          | 2.194            | U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                              | 1.200          | 1.181            |
| International Distribution Services PLC<br>7,375 % fällig am 14.09.2030               | £ 1.400        | 1.966            | Walgreens Boots Alliance, Inc.<br>2,125 % fällig am 20.11.2026                   | € 1.000        | 1.100            |
| Synopsis, Inc.<br>5,000 % fällig am 01.04.2032                                        | \$ 1.900       | 1.896            | Carnival Corp.<br>6,000 % fällig am 15.05.2029                                   | \$ 1.100       | 1.096            |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>5,625 % fällig am 30.09.2031                          | 1.900          | 1.886            | Kaseya, Inc.<br>7,577 % fällig am 20.03.2032                                     | 1.100          | 1.089            |
| JetBlue Airways Corp.<br>9,875 % fällig am 20.09.2031                                 | 1.600          | 1.680            | Las Vegas Sands Corp.<br>3,900 % fällig am 08.08.2029                            | 1.200          | 1.088            |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,500 % fällig am 01.12.2054                      | 1.716          | 1.635            | Canary Wharf Group Investment Holdings PLC<br>3,375 % fällig am 23.04.2028       | £ 900          | 1.066            |
| Imperial Brands Finance Netherlands BV<br>5,250 % fällig am 15.02.2031                | € 1.400        | 1.623            | Ineos Finance PLC<br>5,613 % fällig am 07.02.2031                                | € 1.000        | 1.059            |
| DVI Deutsche Vermoögens- & Immobilienverwaltungs GmbH<br>4,875 % fällig am 21.08.2030 | 1.400          | 1.575            | Wells Fargo & Co.<br>4,897 % fällig am 25.07.2033                                | \$ 1.100       | 1.054            |
| Booz Allen Hamilton, Inc.<br>3,875 % fällig am 01.09.2028                             | \$ 1.600       | 1.542            | Santos Finance Ltd.<br>3,649 % fällig am 29.04.2031                              | 1.170          | 1.033            |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % fällig am 15.04.2032                              | € 1.300        | 1.512            | IHO Verwaltungs GmbH<br>6,750 % fällig am 15.11.2029                             | € 900          | 991              |
| Yorkshire Water Finance PLC<br>6,375 % fällig am 18.11.2034                           | £ 1.100        | 1.422            | Pinnacle Bidco PLC<br>8,250 % fällig am 11.10.2028                               | 700            | 832              |
| MGM China Holdings Ltd.<br>5,250 % fällig am 18.06.2025                               | \$ 1.400       | 1.397            | Gartner, Inc.<br>3,750 % fällig am 01.10.2030                                    | \$ 900         | 831              |
|                                                                                       |                |                  | Mahle GmbH<br>2,375 % fällig am 14.05.2028                                       | € 800          | 830              |

(a) Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                          |                 |                   | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)   | 90.162.866      | \$ 899.051        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 83.942.036      | \$ 837.000        |
|                                                                             | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| Curzon Mortgages PLC<br>5,482 % fällig am 28.07.2049                        | £ 48.572        | 62.915            | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034             | MXN 1.111.589   | 51.272            |
| Mexico Government International Bond<br>6,625 % fällig am 29.01.2038        | \$ 28.859       | 28.815            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | \$ 41.012       | 40.985            |
| Polaris PLC<br>5,044 % fällig am 26.02.2068                                 | £ 22.900        | 28.680            | Mundys SpA<br>1,875 % fällig am 12.02.2028                                       | € 32.775        | 33.550            |
| Republic of Panama<br>4,103 % fällig am 05.03.2027                          | € 22.350        | 24.009            | TDF Infrastructure SASU<br>1,750 % fällig am 01.12.2029                          | 20.400          | 20.797            |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028  | \$ 24.000       | 23.965            | Mexico Government International Bond<br>6,000 % fällig am 13.05.2030             | \$ 20.000       | 20.783            |
| Latitude Australia Credit Card Master Trust<br>0,000 % fällig am 23.11.2037 | AUD 36.100      | 23.640            | Adnoc Murban Rsc Ltd.<br>4,250 % fällig am 11.09.2029                            | 10.000          | 9.713             |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028        | EGP 1.195.700   | 22.685            | Archer Norge A/S<br>9,250 % fällig am 25.02.2030                                 | 8.375           | 8.596             |
| Poland Government International Bond<br>4,875 % fällig am 12.02.2030        | \$ 22.725       | 22.606            | Brandywine Operating Partnership LP<br>8,875 % fällig am 12.04.2029              | 8.000           | 8.553             |
| Avenir Issuer Ireland DAC<br>6,000 % fällig am 25.10.2027                   | 23.400          | 22.263            | El Salvador Government International Bond<br>9,250 % fällig am 17.04.2030        | 7.975           | 8.454             |
| Egypt Government International Bond<br>4,750 % fällig am 11.04.2025         | € 20.200        | 20.995            | AI Silk Midco Ltd.<br>8,101 % fällig am 04.03.2031                               | € 8.000         | 8.406             |
| IQVIA, Inc.<br>6,250 % fällig am 01.06.2032                                 | \$ 20.100       | 20.106            | Occidental Petroleum Corp.<br>6,625 % fällig am 01.09.2030                       | \$ 8.050        | 8.272             |
| Mexico Government International Bond<br>6,000 % fällig am 13.05.2030        | 20.000          | 19.891            | Gaci First Investment Co.<br>5,375 % fällig am 29.01.2054                        | 9.100           | 7.985             |
| Transnet SOC Ltd.<br>11,558 % fällig am 02.03.2028                          | ZAR 356.571     | 18.876            | UBS Group AG<br>4,125 % fällig am 15.04.2026                                     | 8.000           | 7.967             |
| Harbour Plc<br>5,332 % fällig am 28.10.2054                                 | £ 14.401        | 18.621            | AA Bond Co. Ltd.<br>7,375 % fällig am 31.07.2050                                 | £ 5.500         | 7.395             |
| Peru Government International Bond<br>5,500 % fällig am 30.03.2036          | \$ 17.600       | 17.535            | AA Bond Co. Ltd.<br>5,500 % fällig am 31.07.2050                                 | 5.700           | 7.339             |
| Greystone CRE Notes LLC<br>5,793 % fällig am 15.01.2043                     | 17.000          | 16.958            | Corp. Nacional del Cobre de Chile<br>6,330 % fällig am 13.01.2035                | \$ 6.400        | 6.600             |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.<br>5,574 % fällig am 16.01.2036        | 16.500          | 16.623            | Wand NewCo, Inc.<br>7,625 % fällig am 30.01.2032                                 | 6.400           | 6.572             |
| Citadel Finance LLC<br>5,900 % fällig am 10.02.2030                         | 16.600          | 16.490            | GN Bondco LLC<br>9,500 % fällig am 15.10.2031                                    | 6.325           | 6.534             |
| Voya Euro CLO DAC<br>3,249 % fällig am 15.10.2034                           | € 15.600        | 16.274            | Wells Fargo & Co.<br>1,741 % fällig am 04.05.2030                                | € 5.800         | 6.247             |

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Duration Hedged Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                              |  |  |  | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                   |        |                                                                           |  | KOSTEN<br>(000\$) |  |                 |        |        |
|---------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------|--------------------------------|--------|---------------------------------------------------------------------------|--|-------------------|--|-----------------|--------|--------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                               |  |  |  |                   | VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025 |        |                                                                           |  |                   |  |                 |        |        |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) |  |  |  | 3.829.683         | \$                             | 38.183 | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) |  |                   |  | 4.262.646       | \$     | 42.500 |
|                                                                           |  |  |  | PARI<br>(000\$)   |                                |        |                                                                           |  |                   |  | PARI<br>(000\$) |        |        |
| Curzon Mortgages PLC                                                      |  |  |  |                   |                                |        | TDF Infrastructure SASU                                                   |  |                   |  |                 |        |        |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                                              |  |  |  | £                 | 1.996                          | 2.586  | 1,750 % fällig am 01.12.2029                                              |  |                   |  | €               | 1.300  | 1.250  |
| Mexico Government International Bond                                      |  |  |  |                   |                                |        | Mexico Government International Bond                                      |  |                   |  |                 |        |        |
| 5,850 % fällig am 02.07.2032                                              |  |  |  | \$                | 1.851                          | 1.850  | 4,000 % fällig am 24.08.2034                                              |  |                   |  | MXN             | 25.237 | 1.164  |
| Latitude Australia Credit Card Master Trust                               |  |  |  |                   |                                |        | Mundys SpA                                                                |  |                   |  |                 |        |        |
| 0,000 % fällig am 23.11.2037                                              |  |  |  | AUD               | 2.500                          | 1.637  | 1,875 % fällig am 12.02.2028                                              |  |                   |  | €               | 850    | 886    |
| Republic of Panama                                                        |  |  |  |                   |                                |        | Santander UK Group Holdings PLC                                           |  |                   |  |                 |        |        |
| 4,804 % fällig am 01.04.2027                                              |  |  |  | €                 | 1.500                          | 1.621  | 3,823 % fällig am 03.11.2028                                              |  |                   |  | \$              | 750    | 724    |
| Saudi Arabia Government International Bond                                |  |  |  |                   |                                |        | Adler Financing SARL                                                      |  |                   |  |                 |        |        |
| 5,375 % fällig am 13.01.2031                                              |  |  |  | \$                | 1.400                          | 1.395  | 8,250 % fällig am 31.12.2028                                              |  |                   |  | €               | 664    | 703    |
| Peru Government International Bond                                        |  |  |  |                   |                                |        | AA Bond Co. Ltd.                                                          |  |                   |  |                 |        |        |
| 5,500 % fällig am 30.03.2036                                              |  |  |  |                   | 1.000                          | 996    | 5,500 % fällig am 31.07.2050                                              |  |                   |  | £               | 500    | 644    |
| Transnet SOC Ltd.                                                         |  |  |  |                   |                                |        | Fresenius Medical Care AG.                                                |  |                   |  |                 |        |        |
| 11,558 % fällig am 02.03.2028                                             |  |  |  | ZAR               | 16.286                         | 862    | 3,750 % fällig am 08.04.2032                                              |  |                   |  | €               | 550    | 640    |
| Saudi Arabia Government International Bond                                |  |  |  |                   |                                |        | Hungary Government International Bond                                     |  |                   |  |                 |        |        |
| 3,375 % fällig am 05.03.2032                                              |  |  |  | €                 | 800                            | 836    | 5,375 % fällig am 12.09.2033                                              |  |                   |  |                 | 500    | 568    |
| IQVIA, Inc.                                                               |  |  |  |                   |                                |        | Aircastle Ltd.                                                            |  |                   |  |                 |        |        |
| 6,250 % fällig am 01.06.2032                                              |  |  |  | \$                | 800                            | 800    | 2,850 % fällig am 26.01.2028                                              |  |                   |  | \$              | 600    | 562    |
| Egypt Government International Bond                                       |  |  |  |                   |                                |        | Avolon Holdings Funding Ltd.                                              |  |                   |  |                 |        |        |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028                                             |  |  |  | EGP               | 41.100                         | 780    | 2,125 % fällig am 21.02.2026                                              |  |                   |  |                 | 500    | 487    |
| Avenir Issuer Ireland DAC                                                 |  |  |  |                   |                                |        | ONEOK, Inc.                                                               |  |                   |  |                 |        |        |
| 6,000 % fällig am 25.10.2027                                              |  |  |  | \$                | 800                            | 761    | 5,700 % fällig am 01.11.2054                                              |  |                   |  |                 | 500    | 468    |
| Bank of America Corp.                                                     |  |  |  |                   |                                |        | Mexico Government International Bond                                      |  |                   |  |                 |        |        |
| 3,261 % fällig am 28.01.2031                                              |  |  |  | €                 | 700                            | 728    | 5,400 % fällig am 09.02.2028                                              |  |                   |  |                 | 450    | 460    |
| Prime Security Services Borrower LLC                                      |  |  |  |                   |                                |        | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |  |                   |  |                 |        |        |
| 3,375 % fällig am 31.08.2027                                              |  |  |  | \$                | 750                            | 716    | 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)                                          |  |                   |  |                 | 443    | 443    |
| SLM Corp.                                                                 |  |  |  |                   |                                |        | Esab Corp.                                                                |  |                   |  |                 |        |        |
| 6,500 % fällig am 31.01.2030                                              |  |  |  |                   | 675                            | 693    | 6,250 % fällig am 15.04.2029                                              |  |                   |  |                 | 425    | 430    |
| Adler Financing SARL                                                      |  |  |  |                   |                                |        | Carnival Corp.                                                            |  |                   |  |                 |        |        |
| 8,250 % fällig am 31.12.2028                                              |  |  |  | €                 | 664                            | 685    | 6,125 % fällig am 15.02.2033                                              |  |                   |  |                 | 425    | 424    |
| Viridien                                                                  |  |  |  |                   |                                |        | Wand NewCo, Inc.                                                          |  |                   |  |                 |        |        |
| 8,500 % fällig am 15.10.2030                                              |  |  |  |                   | 600                            | 656    | 7,625 % fällig am 30.01.2032                                              |  |                   |  |                 | 400    | 412    |
| Egypt Government International Bond                                       |  |  |  |                   |                                |        | NextEra Energy Operating Partners LP                                      |  |                   |  |                 |        |        |
| 4,750 % fällig am 11.04.2025                                              |  |  |  |                   | 600                            | 624    | 7,250 % fällig am 15.01.2029                                              |  |                   |  |                 | 400    | 405    |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU                               |  |  |  |                   |                                |        | Olympus Water U.S. Holding Corp.                                          |  |                   |  |                 |        |        |
| 3,375 % fällig am 21.04.2029                                              |  |  |  |                   | 600                            | 614    | 7,250 % fällig am 15.06.2031                                              |  |                   |  |                 | 400    | 402    |
| Axon Enterprise, Inc.                                                     |  |  |  |                   |                                |        | Brixmor Operating Partnership LP                                          |  |                   |  |                 |        |        |
| 6,125 % fällig am 15.03.2030                                              |  |  |  | \$                | 600                            | 606    | 5,200 % fällig am 01.04.2032                                              |  |                   |  |                 | 400    | 396    |

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income ESG Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                          | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | AKTIEN                 | ERLÖSE<br>(000S) |
|---------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                    |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                        |                  |
| Latitude Australia Credit Card Master Trust<br>0,000 % fällig am 23.11.2037           | AUD 500        | \$ 327           | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO ESG Income Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 27.276                 | \$ 275           |
|                                                                                       | <b>AKTIEN</b>  |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <b>PARI<br/>(000S)</b> |                  |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO ESG Income Fund (a)                  | 22.543         | 234              | Amgen, Inc.<br>3,000 % fällig am 22.02.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | \$ 250                 | 236              |
| BNP Paribas S.A.<br>9,250 % fällig am 17.11.2027                                      | \$ 200         | 211              | Mundys SpA<br>1,875 % fällig am 12.02.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | € 200                  | 224              |
| Commerzbank AG<br>3,625 % fällig am 14.01.2032                                        | € 200          | 206              | Volkswagen Leasing GmbH<br>3,875 % fällig am 11.10.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 200                    | 222              |
| Republic of Kenya Government International Bond<br>9,500 % fällig am 05.03.2036       | \$ 200         | 194              | BNP Paribas S.A.<br>8,500 % fällig am 14.08.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 200                 | 209              |
| Heathrow Funding Ltd.<br>3,875 % fällig am 16.01.2038                                 | € 150          | 153              | OneMain Finance Corp.<br>3,500 % fällig am 15.01.2027                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 200                    | 191              |
| Peru Government International Bond<br>7,300 % fällig am 12.08.2033                    | PEN 500        | 146              | WMG Acquisition Corp.<br>2,250 % fällig am 15.08.2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | € 200                  | 188              |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.<br>9,700 % fällig am 05.03.2045          | 500            | 138              | Reworld Holding Corp.<br>4,875 % fällig am 01.12.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | \$ 200                 | 188              |
| Rocket Cos., Inc.<br>6,125 % fällig am 01.08.2030                                     | \$ 125         | 125              | Sprint Capital Corp.<br>8,750 % fällig am 15.03.2032                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 150                    | 176              |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,350 % fällig am 27.03.2030               | 125            | 125              | Ball Corp.<br>2,875 % fällig am 15.08.2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 200                    | 170              |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028                  | EGP 6.400      | 121              | Intercontinental Exchange, Inc.<br>3,625 % fällig am 01.09.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 175                    | 167              |
| Credit Agricole S.A.<br>3,750 % fällig am 23.01.2031                                  | € 100          | 116              | E.ON SE<br>3,750 % fällig am 15.01.2036                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | € 150                  | 162              |
| Twilio, Inc.<br>3,875 % fällig am 15.03.2031                                          | \$ 125         | 114              | Mexico Government International Bond<br>2,750 % fällig am 27.11.2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | MXN 3.366              | 146              |
| Amprion GmbH<br>3,875 % fällig am 05.06.2036                                          | € 100          | 113              | Crown Castle, Inc.<br>2,500 % fällig am 15.07.2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | \$ 150                 | 127              |
| Block, Inc.<br>3,500 % fällig am 01.06.2031                                           | \$ 125         | 112              | AT&T, Inc.<br>4,300 % fällig am 15.02.2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 125                    | 123              |
| Electricite de France S.A.<br>4,625 % fällig am 07.05.2045                            | € 100          | 112              | ING Groep NV<br>4,125 % fällig am 24.08.2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | € 100                  | 117              |
| DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH<br>4,875 % fällig am 21.08.2030 | 100            | 111              | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | MXN 2.524              | 116              |
| IHO Verwaltungs GmbH<br>6,750 % fällig am 15.11.2029                                  | 100            | 110              | Fresenius Medical Care AG<br>3,125 % fällig am 08.12.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | € 100                  | 116              |
| SSE PLC<br>3,500 % fällig am 18.03.2032                                               | 100            | 109              | Panama Government International Bond<br>6,700 % fällig am 26.01.2036                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | \$ 125                 | 116              |
| Fresenius Medical Care AG.<br>3,125 % fällig am 08.12.2028                            | 100            | 108              | Ecuador Government International Bond<br>6,900 % fällig am 31.07.2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 128                    | 107              |
| Carvana Co. (13,000 % PIK)<br>13,000 % fällig am 01.06.2030                           | \$ 100         | 106              | Bank of America Corp.<br>6,204 % fällig am 10.11.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 100                    | 104              |
| United Utilities Water Finance PLC<br>3,500 % fällig am 27.02.2033                    | € 100          | 104              | Windstream Services LLC<br>8,250 % fällig am 01.10.2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 100                    | 103              |
| Sewern Trent Utilities Finance PLC<br>3,875 % fällig am 04.08.2035                    | 100            | 104              | Schaeffler AG<br>3,375 % fällig am 12.10.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | € 100                  | 103              |
| Norsk Hydro ASA<br>3,625 % fällig am 23.01.2032                                       | 100            | 103              | Crown European Holdings SACA<br>2,875 % fällig am 01.02.2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 100                    | 103              |
| Snap, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.03.2033                                            | \$ 100         | 101              | Santander Holdings USA, Inc.<br>5,807 % fällig am 09.09.2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | \$ 100                 | 100              |
| Starwood Property Trust, Inc.<br>6,500 % fällig am 15.10.2030                         | 100            | 100              | Forvia SE<br>2,375 % fällig am 15.06.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | € 100                  | 100              |
| Morgan Stanley<br>5,192 % fällig am 17.04.2031                                        | 100            | 100              | Wisconsin Power & Light Co.<br>4,950 % fällig am 01.04.2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | \$ 100                 | 99               |
| LifePoint Health, Inc.<br>8,406 % fällig am 17.05.2031                                | 100            | 96               | HCA, Inc.<br>4,125 % fällig am 15.06.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 100                    | 97               |
| Hologic, Inc.<br>3,250 % fällig am 15.02.2029                                         | 100            | 93               | ELO SACA<br>4,875 % fällig am 08.12.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | € 100                  | 96               |
| Owens & Minor, Inc.<br>10,000 % fällig am 15.04.2030                                  | 75             | 75               | JPMorgan Chase & Co.<br>2,580 % fällig am 22.04.2032                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | \$ 100                 | 87               |
| Newell Brands, Inc.<br>8,500 % fällig am 01.06.2028                                   | 75             | 75               | Rocket Mortgage LLC<br>4,000 % fällig am 15.10.2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 100                    | 83               |
| Santander Holdings USA, Inc.<br>5,473 % fällig am 20.03.2029                          | 75             | 75               | Dell International LLC<br>3,375 % fällig am 15.12.2041                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 100                    | 73               |
| Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.<br>6,750 % fällig am 15.04.2032                 | 75             | 75               | SBA Communications Corp.<br>3,125 % fällig am 01.02.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 75                     | 70               |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>5,500 % fällig am 01.08.2030                  | 75             | 75               | Gap, Inc.<br>3,875 % fällig am 01.10.2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 75                     | 64               |
| Realty Income Corp.<br>5,125 % fällig am 15.04.2035                                   | 75             | 74               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                        |                  |
| Bulgaria Government International Bond<br>4,125 % fällig am 07.05.2038                | € 50           | 56               | (a) Der Diversified Income ESG Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                        |                  |
| Elanco Animal Health, Inc.<br>6,650 % fällig am 28.08.2028                            | \$ 50          | 51               | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                        |                  |
| Wayfair LLC<br>7,250 % fällig am 31.10.2029                                           | 50             | 50               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                        |                  |

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN         |             | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN         |                | ERLÖSE<br>(000S) |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------|------------------|
| KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                               |                |             |                  | VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                            |                |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 49.246.718     | \$          | 491.043          | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 44.168.195     | \$             | 440.400          |
|                                                                           | PARI<br>(000S) |             |                  |                                                                           | PARI<br>(000S) |                |                  |
| U.S. Treasury Notes                                                       |                |             |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                |                  |
| 4,250 % fällig am 15.11.2034                                              | \$             | 163.200     | 158.004          | 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)                                          | \$             | 169.715        | 159.190          |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.03.2055                                              |                | 77.000      | 75.744           | 5,000 % fällig am 01.03.2055                                              |                | 77.000         | 73.812           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.12.2054                                              |                | 74.100      | 72.812           | 5,000 % fällig am 01.12.2054                                              |                | 74.100         | 71.032           |
| South Africa Government International Bond                                |                |             |                  |                                                                           |                |                |                  |
| 7,000 % fällig am 28.02.2031                                              | ZAR            | 950.100     | 49.161           | Amazon.com, Inc.                                                          |                | 254.000        | 56.729           |
| Peru Government International Bond                                        |                |             |                  | AT&T, Inc.                                                                |                | 2.414.500      | 52.900           |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032                                              | PEN            | 148.200     | 42.354           | Exxon Mobil Corp.                                                         |                | 445.600        | 49.687           |
| Colombia Government International Bond                                    |                |             |                  |                                                                           |                |                |                  |
| 1,000 % fällig am 28.04.2028                                              | COP            | 156.507.000 | 34.611           |                                                                           |                | PARI<br>(000S) |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.12.2054                                              | \$             | 32.944      | 32.412           | 5,000 % fällig am 01.12.2054                                              | \$             | 32.944         | 31.580           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.12.2054                                              |                | 31.735      | 31.222           | 5,000 % fällig am 01.12.2054                                              |                | 31.735         | 30.421           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  |                                                                           |                |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.04.2055                                              |                | 29.849      | 30.686           |                                                                           |                | AKTIEN         |                  |
| Japan Government International Bond                                       |                |             |                  | Apple, Inc.                                                               |                | 113.600        | 27.021           |
| 2,000 % fällig am 20.12.2044                                              | ¥              | 4.340.000   | 28.353           |                                                                           |                | PARI<br>(000S) |                  |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 1,875 % fällig am 15.07.2034 (b)                                          | \$             | 25.450      | 25.146           | 5,000 % fällig am 01.10.2054                                              | \$             | 25.060         | 24.022           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.10.2054                                              |                | 25.060      | 24.654           | 5,000 % fällig am 01.10.2054                                              |                | 24.940         | 23.908           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.10.2054                                              |                | 24.940      | 24.537           | 5,000 % fällig am 01.11.2054                                              |                | 21.548         | 20.656           |
| Colombia Government International Bond                                    |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 1,000 % fällig am 18.09.2030                                              | COP            | 108.685.000 | 23.033           | 5,000 % fällig am 01.11.2054                                              |                | 18.265         | 17.509           |
| South Africa Government International Bond                                |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030                                              | ZAR            | 392.700     | 21.626           | 5,000 % fällig am 01.01.2055                                              |                | 17.000         | 16.296           |
| Japan Government International Bond                                       |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 2,300 % fällig am 20.12.2054                                              | ¥              | 3.300.000   | 21.334           | 5,000 % fällig am 01.01.2055                                              |                | 15.790         | 15.136           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.11.2054                                              | \$             | 21.548      | 21.200           | 5,000 % fällig am 01.11.2054                                              |                | 15.056         | 14.432           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.11.2054                                              |                | 18.265      | 17.970           | 5,000 % fällig am 01.11.2054                                              |                | 14.452         | 13.853           |
| Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |             |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.01.2055                                              |                | 17.000      | 16.717           | 5,000 % fällig am 01.01.2055                                              |                | 8.210          | 7.870            |
|                                                                           |                |             |                  | Mexico Government International Bond                                      |                |                |                  |
|                                                                           |                |             |                  | 2,750 % fällig am 27.11.2031                                              | MXN            | 145.614        | 6.292            |

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                   |     |               | KOSTEN      | BESCHREIBUNG                   |                                                                           |                                                                           | AKTIEN        | ERLÖSE  |             |    |           |
|--------------------------------------------------------------------------------|-----|---------------|-------------|--------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------|---------------|---------|-------------|----|-----------|
| KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                                    |     |               | (000\$)     | VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025 |                                                                           |                                                                           |               | (000\$) |             |    |           |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      |     |               | 117.561.668 | \$                             | 1.172.232                                                                 | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) |               |         | 105.872.909 | \$ | 1.055.700 |
|                                                                                |     |               | PARI        |                                |                                                                           |                                                                           |               |         | PARI        |    |           |
|                                                                                |     |               | (000\$)     |                                |                                                                           |                                                                           |               |         | (000\$)     |    |           |
| Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 31.05.2029              | MXN | 3.477.300     |             | 166.946                        | Indonesia Government International Bond 6,500 % fällig am 15.07.2030      | IDR                                                                       | 1.348.588.000 |         | 81.555      |    |           |
| Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029              |     | 2.773.600     |             | 135.907                        | Colombian TES 11,500 % fällig am 25.07.2046                               | COP                                                                       | 324.241.500   |         | 70.570      |    |           |
| Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033                                    | COP | 440.549.800   |             | 111.976                        | Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 31.05.2029         | MXN                                                                       | 1.384.000     |         | 66.515      |    |           |
| Malaysia Government International Bond 3,582 % fällig am 15.07.2032            | MYR | 483.670       |             | 109.080                        | Indonesia Government International Bond 6,500 % fällig am 15.07.2030      | IDR                                                                       | 1.002.109.000 |         | 60.602      |    |           |
| Indonesia Government International Bond 6,750 % fällig am 15.07.2035           | IDR | 1.595.332.000 |             | 95.720                         | Indonesia Government International Bond 6,750 % fällig am 15.07.2035      |                                                                           | 993.370.000   |         | 59.694      |    |           |
| Poland Government International Bond 5,750 % fällig am 25.04.2029              | PLN | 311.200       |             | 85.582                         | Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 24.08.2034         | MXN                                                                       | 1.324.503     |         | 59.265      |    |           |
| Dominican Republic Government International Bond 10,500 % fällig am 15.03.2037 | DOP | 4.097.750     |             | 66.707                         | Czech Republic Government International Bond 1,000 % fällig am 26.06.2026 | CZK                                                                       | 1.414.200     |         | 56.588      |    |           |
| Indonesia Government International Bond 6,500 % fällig am 15.07.2030           | IDR | 1.077.020.000 |             | 64.028                         | Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 01.03.2029         | MXN                                                                       | 1.187.200     |         | 55.791      |    |           |
| Dominican Republic Government International Bond 10,500 % fällig am 15.03.2037 | DOP | 3.823.150     |             | 61.592                         | Indonesia Government International Bond 1,000 % fällig am 15.07.2030      | IDR                                                                       | 889.189.000   |         | 54.502      |    |           |
| Indonesia Government International Bond 6,750 % fällig am 15.07.2035           | IDR | 981.363.000   |             | 59.917                         | Malaysia Government International Bond 3,582 % fällig am 15.07.2032       | MYR                                                                       | 228.130       |         | 53.578      |    |           |
| Egypt Government International Bond 21,954 % fällig am 04.03.2028              | EGP | 3.076.100     |             | 58.359                         | Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                         | COP                                                                       | 239.322.000   |         | 51.943      |    |           |
| Indonesia Government International Bond 1,000 % fällig am 15.07.2030           | IDR | 889.189.000   |             | 53.529                         | Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                         |                                                                           | 239.322.000   |         | 51.621      |    |           |
| Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043            | THB | 1.571.227     |             | 52.566                         | Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                         |                                                                           | 239.322.000   |         | 51.527      |    |           |
| South Africa Government International Bond 8,875 % fällig am 28.02.2035        | ZAR | 1.033.200     |             | 52.236                         | Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043       | THB                                                                       | 1.361.250     |         | 48.199      |    |           |
| Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                              | COP | 239.322.000   |             | 52.083                         | Malaysia Government International Bond 3,885 % fällig am 15.08.2029       | MYR                                                                       | 193.610       |         | 45.212      |    |           |
| Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                              |     | 239.322.000   |             | 51.769                         | Poland Government International Bond 5,000 % fällig am 25.01.2030         | PLN                                                                       | 161.500       |         | 43.448      |    |           |
| Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                              |     | 239.322.000   |             | 51.028                         | Thailand Government International Bond 2,500 % fällig am 17.11.2029       | THB                                                                       | 1.451.420     |         | 42.864      |    |           |
| Czech Republic Government International Bond 4,500 % fällig am 11.11.2032      | CZK | 1.125.400     |             | 48.471                         | Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 23.11.2034         | MXN                                                                       | 972.900       |         | 40.890      |    |           |
| Colombian TES 11,500 % fällig am 25.07.2046                                    | COP | 222.507.800   |             | 48.005                         | Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                         | COP                                                                       | 182.796.000   |         | 40.072      |    |           |
|                                                                                |     |               |             |                                | Republic of Colombia 1,000 % fällig am 28.04.2028                         |                                                                           | 182.796.000   |         | 39.466      |    |           |

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond ESG Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                               |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                            |     | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |     |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                   |     |                |                  |
| Indonesia Government International Bond<br>6,750 % fällig am 15.07.2035    | IDR | 126.774.000    | \$ 7.668         | Indonesia Government International Bond<br>6,500 % fällig am 15.07.2030 | IDR | 64.987.000     | \$ 3.927         |
| Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 31.05.2029       | MXN | 96.900         | 4.540            | Indonesia Government International Bond<br>7,375 % fällig am 15.10.2030 |     | 55.855.000     | 3.509            |
| Dominican Republic Government International<br>Bond                        |     |                |                  | Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 31.05.2029    | MXN | 67.700         | 3.248            |
| 10,500 % fällig am 15.03.2037                                              | DOP | 259.500        | 4.197            | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034    |     | 57.392         | 2.573            |
| Poland Government International Bond<br>5,000 % fällig am 25.01.2030       | PLN | 14.300         | 3.760            | Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 01.03.2029    |     | 54.500         | 2.561            |
| Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 01.03.2029       | MXN | 71.800         | 3.419            | Poland Government International Bond<br>5,000 % fällig am 25.01.2030    | PLN | 9.100          | 2.357            |
| Indonesia Government International Bond<br>6,500 % fällig am 15.07.2030    | IDR | 50.510.000     | 2.992            | Czech Republic Government International<br>Bond                         |     |                |                  |
| Colombian TES<br>13,250 % fällig am 09.02.2033                             | COP | 9.778.700      | 2.488            | 1,000 % fällig am 26.06.2026                                            | CZK | 58.100         | 2.325            |
| Czech Republic Government International<br>Bond                            |     |                |                  | Poland Government International Bond<br>3,750 % fällig am 25.05.2027    | PLN | 9.000          | 2.251            |
| 4,500 % fällig am 11.11.2032                                               | CZK | 56.400         | 2.484            | Mexico Government International Bond<br>7,750 % fällig am 23.11.2034    | MXN | 51.400         | 2.170            |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028       | EGP | 113.100        | 2.146            | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                    | COP | 9.393.900      | 2.077            |
| Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                       | COP | 9.393.900      | 2.081            | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                    |     | 9.393.900      | 2.066            |
| Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                       |     | 9.393.900      | 2.062            | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                    |     | 9.393.900      | 2.050            |
| Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                       |     | 9.393.900      | 2.042            | Colombian TES<br>11,500 % fällig am 25.07.2046                          |     | 9.202.100      | 2.011            |
| Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 02.03.2028       | MXN | 40.000         | 2.037            | Czech Republic Government International<br>Bond                         |     |                |                  |
| Mexico Government International Bond<br>7,750 % fällig am 23.11.2034       |     | 42.100         | 1.764            | 2,500 % fällig am 25.08.2028                                            | CZK | 46.500         | 1.876            |
| Thailand Government International Bond<br>3,450 % fällig am 17.06.2043     | THB | 51.976         | 1.738            | Asian Infrastructure Investment Bank<br>7,000 % fällig am 01.03.2029    | INR | 161.100        | 1.859            |
| Malaysia Government International Bond<br>3,582 % fällig am 15.07.2032     | MYR | 7.540          | 1.685            | Malaysia Government International Bond<br>3,582 % fällig am 15.07.2032  | MYR | 7.540          | 1.793            |
| Deutsche Bank AG<br>8,010 % fällig am 18.07.2034                           | INR | 142.000        | 1.659            | South Africa Government International<br>Bond                           |     |                |                  |
| Colombian TES<br>11,500 % fällig am 25.07.2046                             | COP | 6.730.500      | 1.450            | 8,000 % fällig am 31.01.2030                                            | ZAR | 34.100         | 1.771            |
| Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                       |     | 6.369.700      | 1.401            | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 03.11.2027                    | COP | 6.369.700      | 1.401            |
| Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 28.04.2028                       |     | 6.237.100      | 1.357            | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 28.04.2028                    |     | 6.237.100      | 1.354            |
| Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 28.04.2028                       |     | 6.237.100      | 1.349            | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 28.04.2028                    |     | 6.237.100      | 1.345            |
| Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 28.04.2028                       |     | 6.237.100      | 1.330            | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 28.04.2028                    |     | 6.237.100      | 1.343            |
| Peru Government International Bond<br>7,600 % fällig am 12.08.2039         | PEN | 4.600          | 1.287            | Indonesia Government International Bond<br>6,750 % fällig am 15.07.2035 | IDR | 21.853.000     | 1.311            |
| South Africa Government International Bond<br>8,500 % fällig am 31.01.2037 | ZAR | 25.100         | 1.110            | Peru Government International Bond<br>7,600 % fällig am 12.08.2039      | PEN | 4.600          | 1.282            |
| Romania Government International Bond<br>7,350 % fällig am 28.04.2031      | RON | 5.300          | 1.102            | Mexico Government International Bond<br>8,000 % fällig am 07.11.2047    | MXN | 28.400         | 1.155            |
| Asian Development Bank<br>5,750 % fällig am 23.01.2030                     | HUF | 443.000        | 1.080            | South Africa Government International<br>Bond                           |     |                |                  |
|                                                                            |     |                |                  | 8,250 % fällig am 31.03.2032                                            | ZAR | 22.100         | 1.111            |
|                                                                            |     |                |                  | Mexico Government International Bond<br>8,000 % fällig am 31.07.2053    | MXN | 27.500         | 1.028            |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                         | AKTIEN      |                 | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                        | AKTIEN      |                 | ERLÖSE<br>(000\$) |
|--------------------------------------------------------------------------------------|-------------|-----------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------|-----------------|-------------------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                                          |             |                 |                   | VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                                      |             |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)            | 174.570.911 | \$              | 1.740.678         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)           | 157.624.437 | \$              | 1.571.700         |
|                                                                                      |             | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                     |             | PARI<br>(000\$) |                   |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028                 | EGP         | 2.191.300       | 41.573            | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034                | MXN         | 1.239.662       | 56.793            |
| Mexico Government International Bond<br>6,875 % fällig am 13.05.2037                 | \$          | 37.900          | 38.118            | Mexico Government International Bond<br>7,750 % fällig am 23.11.2034                |             | 1.309.200       | 54.656            |
| Pakistan Government International Bond<br>8,250 % fällig am 30.09.2025               |             | 35.327          | 35.291            | U.S. Treasury Bonds<br>3,250 % fällig am 15.05.2042                                 | \$          | 53.000          | 42.810            |
| Mexico Government International Bond<br>4,875 % fällig am 19.05.2033                 |             | 37.050          | 34.253            | Israel Government International Bond<br>5,000 % fällig am 30.10.2026                | €           | 35.500          | 38.335            |
| Dominican Republic Government<br>International Bond<br>10,500 % fällig am 15.03.2037 | DOP         | 1.955.700       | 31.992            | Pakistan Government International Bond<br>6,000 % fällig am 08.04.2026              | \$          | 24.900          | 23.470            |
| Colombia Government International Bond<br>8,500 % fällig am 25.04.2035               | \$          | 27.200          | 27.313            | Petronas Capital Ltd.<br>5,848 % fällig am 03.04.2055                               |             | 22.100          | 21.918            |
| Senegal Government International Bond<br>4,750 % fällig am 13.03.2028                | €           | 28.200          | 26.229            | Gaci First Investment Co.<br>5,375 % fällig am 29.01.2054                           |             | 24.900          | 21.724            |
| Egyptian Financial Co. For Sovereign<br>Taskeek<br>10,875 % fällig am 28.02.2026     | \$          | 24.800          | 25.488            | Turkey Government International Bond<br>5,125 % fällig am 17.02.2028                |             | 22.300          | 21.349            |
| Republic of Panama<br>4,103 % fällig am 05.03.2027                                   | €           | 22.400          | 24.063            | Pakistan Government International Bond<br>8,875 % fällig am 08.04.2051              |             | 23.905          | 19.012            |
| Poland Government International Bond<br>5,375 % fällig am 12.02.2035                 | \$          | 22.900          | 22.919            | Turkey Government International Bond<br>27,700 % fällig am 27.09.2034               | TRY         | 744.700         | 18.179            |
| Petronas Capital Ltd.<br>5,848 % fällig am 03.04.2055                                |             | 22.100          | 22.100            | Turkey Government International Bond<br>6,875 % fällig am 17.03.2036                | \$          | 17.970          | 17.386            |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,750 % fällig am 16.01.2054           |             | 23.000          | 21.572            | Saudi Arabian Oil Co.<br>5,250 % fällig am 17.07.2034                               |             | 17.700          | 17.382            |
| RAK Capital<br>5,000 % fällig am 12.03.2035                                          |             | 20.600          | 20.539            | Turkey Government International Bond<br>9,875 % fällig am 15.01.2028                |             | 15.900          | 17.013            |
| Qatar Government International Bond<br>4,875 % fällig am 27.02.2035                  |             | 20.400          | 20.522            | Dominican Republic Government<br>International Bond<br>5,500 % fällig am 22.02.2029 |             | 17.000          | 16.427            |
| Nigeria Government International Bond<br>7,625 % fällig am 21.11.2025                |             | 20.000          | 20.080            | Morocco Government International Bond<br>4,750 % fällig am 02.04.2035               | €           | 15.100          | 16.135            |
| MTR Corp. Ltd.<br>5,250 % fällig am 01.04.2055                                       |             | 20.000          | 19.691            | Suci Second Investment Co.<br>6,000 % fällig am 25.10.2028                          | \$          | 15.500          | 15.888            |
| Republic of Kenya Government International<br>Bond<br>9,500 % fällig am 05.03.2036   |             | 20.500          | 19.478            | Finance Department Government of Sharjah<br>6,125 % fällig am 06.03.2036            |             | 15.300          | 15.185            |
| Pakistan Government International Bond<br>6,000 % fällig am 08.04.2026               |             | 18.975          | 18.061            | RAK Capital<br>5,000 % fällig am 12.03.2035                                         |             | 14.300          | 14.476            |
| Stepstone Group Midco GmbH<br>0,000 % fällig am 04.12.2031                           | €           | 16.500          | 17.272            | U.S. Treasury Notes<br>3,125 % fällig am 31.08.2029                                 |             | 14.700          | 14.247            |
|                                                                                      |             |                 |                   | (a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds      |             |                 |                   |

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond ESG Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                     |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                             |     | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|--------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|----------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|
| KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                      |     |                |                  | VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                           |     |                |                  |
| Egypt Government International Bond              |     |                |                  | Mexico Government International Bond                     |     |                |                  |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028                    | EGP | 1.286.900      | \$ 24.415        | 4,000 % fällig am 24.08.2034                             | MXN | 812.393        | \$ 37.184        |
| Dominican Republic Government International Bond |     |                |                  | LG Energy Solution Ltd.                                  |     |                |                  |
| 10,500 % fällig am 15.03.2037                    | DOP | 1.356.300      | 22.090           | 5,375 % fällig am 02.07.2029                             | \$  | 22.600         | 22.500           |
| Colombia Government International Bond           |     |                |                  | Ghana Government International Bond                      |     |                |                  |
| 3,250 % fällig am 22.04.2032                     | \$  | 22.600         | 17.460           | 5,000 % fällig am 03.07.2035                             |     | 17.300         | 12.096           |
| SK Hynix, Inc.                                   |     |                |                  | Qatar Government International Bond                      |     |                |                  |
| 2,375 % fällig am 19.01.2031                     |     | 16.500         | 14.215           | 4,875 % fällig am 27.02.2035                             |     | 11.100         | 11.194           |
| Republic of Panama                               |     |                |                  | Finance Department Government of Sharjah                 |     |                |                  |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027                     | €   | 13.200         | 14.180           | 6,125 % fällig am 06.03.2036                             |     | 11.200         | 11.182           |
| Colombia Government International Bond           |     |                |                  | Turkey Government International Bond                     |     |                |                  |
| 8,500 % fällig am 25.04.2035                     | \$  | 13.400         | 13.615           | 27,700 % fällig am 27.09.2034                            | TRY | 467.800        | 11.143           |
| MTR Corp. Ltd.                                   |     |                |                  | Finance Department Government of Sharjah                 |     |                |                  |
| 5,250 % fällig am 01.04.2055                     |     | 13.800         | 13.587           | 6,500 % fällig am 23.11.2032                             | \$  | 10.300         | 10.698           |
| Hungary Government International Bond            |     |                |                  | Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik            |     |                |                  |
| 4,875 % fällig am 22.03.2040                     | €   | 13.000         | 13.467           | 13,000 % fällig am 05.12.2025                            | DOP | 477.200        | 7.886            |
| Raizen Fuels Finance S.A.                        |     |                |                  | Hyundai Capital Services, Inc.                           |     |                |                  |
| 6,950 % fällig am 05.03.2054                     | \$  | 13.600         | 13.103           | 1,250 % fällig am 08.02.2026                             | \$  | 8.200          | 7.873            |
| RAK Capital                                      |     |                |                  | Finance Department Government of Sharjah                 |     |                |                  |
| 5,000 % fällig am 12.03.2035                     |     | 12.200         | 12.164           | 4,625 % fällig am 13.02.2032                             | €   | 5.900          | 6.656            |
| Qatar Government International Bond              |     |                |                  | Banco do Brasil S.A.                                     |     |                |                  |
| 4,875 % fällig am 27.02.2035                     |     | 11.100         | 11.159           | 6,000 % fällig am 18.03.2031                             | \$  | 6.200          | 6.278            |
| Gabon Government International Bond              |     |                |                  | Benin Government International Bond                      |     |                |                  |
| 9,500 % fällig am 18.02.2029                     |     | 12.000         | 10.945           | 7,960 % fällig am 13.02.2038                             |     | 6.500          | 6.110            |
| Stepstone Group Midco GmbH                       |     |                |                  | Romania Government International Bond                    |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 04.12.2031                     | €   | 10.200         | 10.677           | 5,250 % fällig am 10.03.2030                             | €   | 5.100          | 5.587            |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.             |     |                |                  | Jordan Government International Bond                     |     |                |                  |
| 7,250 % fällig am 27.09.2028                     | \$  | 10.000         | 10.000           | 7,375 % fällig am 10.10.2047                             | \$  | 6.500          | 5.586            |
| Korea Water Resources Corp.                      |     |                |                  | Mexico Government International Bond                     |     |                |                  |
| 4,375 % fällig am 21.05.2027                     |     | 10.000         | 9.967            | 2,750 % fällig am 27.11.2031                             | MXN | 125.273        | 5.361            |
| Republic of Uzbekistan International Bond        |     |                |                  | RAK Capital                                              |     |                |                  |
| 5,100 % fällig am 25.02.2029                     | €   | 9.200          | 9.630            | 5,000 % fällig am 12.03.2035                             | \$  | 5.000          | 5.063            |
| Romania Government International Bond            |     |                |                  | Banco Davivienda S.A.                                    |     |                |                  |
| 5,250 % fällig am 10.03.2030                     |     | 9.200          | 9.473            | 6,650 % fällig am 22.04.2031                             |     | 4.600          | 4.129            |
| Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.     |     |                |                  | Telecom Argentina S.A.                                   |     |                |                  |
| 9,700 % fällig am 05.03.2045                     | PEN | 31.400         | 8.653            | 9,500 % fällig am 18.07.2031                             |     | 4.000          | 4.094            |
| Globe Telecom, Inc.                              |     |                |                  | Qatar Government International Bond                      |     |                |                  |
| 2,500 % fällig am 23.07.2030                     | \$  | 9.600          | 8.499            | 4,400 % fällig am 16.04.2050                             |     | 4.900          | 4.031            |
| Virtuo2 Finance SARL                             |     |                |                  | Hungary Government International Bond                    |     |                |                  |
| 7,930 % fällig am 12.01.2034                     | €   | 6.700          | 7.761            | 5,250 % fällig am 16.06.2029                             |     | 4.100          | 3.995            |
| Corp. Financiera de Desarrollo S.A.              |     |                |                  | CFAMC Co. Ltd.                                           |     |                |                  |
| 5,500 % fällig am 06.05.2030                     | \$  | 7.000          | 6.963            | 4,500 % fällig am 29.05.2029                             |     | 4.200          | 3.994            |
| Turkey Government International Bond             |     |                |                  | South Africa Government International Bond               |     |                |                  |
| 7,125 % fällig am 12.02.2032                     |     | 6.800          | 6.772            | 4,850 % fällig am 30.09.2029                             |     | 4.300          | 3.972            |
| Bulgaria Government International Bond           |     |                |                  | Ecuador Government International Bond                    |     |                |                  |
| 3,500 % fällig am 07.05.2034                     | €   | 6.000          | 6.734            | 6,900 % fällig am 31.07.2030                             |     | 4.436          | 3.607            |
| Bulgaria Government International Bond           |     |                |                  | Emirate of Abu Dhabi Government International Bond       |     |                |                  |
| 4,125 % fällig am 07.05.2038                     |     | 6.000          | 6.689            | 5,500 % fällig am 30.04.2054                             |     | 3.600          | 3.405            |
| Banco Nacional de Comercio Exterior SNC          |     |                |                  | Sri Lanka Government International Bond                  |     |                |                  |
| 5,875 % fällig am 07.05.2030                     | \$  | 6.700          | 6.670            | 3,600 % fällig am 15.06.2035                             |     | 5.300          | 3.392            |
| Baiterek National Managing Holding JSC           |     |                |                  | Banco Mercantil del Norte S.A.                           |     |                |                  |
| 5,450 % fällig am 08.05.2028                     |     | 6.700          | 6.663            | 7,500 % fällig am 27.06.2029                             |     | 3.400          | 3.366            |
| Bahrain Government International Bond            |     |                |                  | Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC            |     |                |                  |
| 7,500 % fällig am 07.07.2037                     |     | 6.600          | 6.600            | 7,875 % fällig am 15.07.2028                             |     | 3.800          | 3.094            |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT                      |     |                |                  | Peru Government International Bond                       |     |                |                  |
| 4,900 % fällig am 24.03.2028                     |     | 6.600          | 6.559            | 6,900 % fällig am 12.08.2037                             | PEN | 11.400         | 3.031            |
| Caixa Economica Federal                          |     |                |                  | Corp. Nacional del Cobre de Chile                        |     |                |                  |
| 5,625 % fällig am 13.05.2030                     |     | 6.300          | 6.233            | 6,440 % fällig am 26.01.2036                             | \$  | 3.000          | 3.011            |
| Ivory Coast Government International Bond        |     |                |                  | Banque Centrale de Tunisie Government International Bond |     |                |                  |
| 8,250 % fällig am 30.01.2037                     |     | 6.500          | 6.208            | 6,375 % fällig am 15.07.2026                             | €   | 2.900          | 2.901            |
| Finance Department Government of Sharjah         |     |                |                  | Shinhan Card Co. Ltd.                                    |     |                |                  |
| 4,625 % fällig am 13.02.2032                     | €   | 5.900          | 6.092            | 1,375 % fällig am 23.06.2026                             | \$  | 3.000          | 2.893            |
| Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S          |     |                |                  | Hungary Government International Bond                    |     |                |                  |
| 6,750 % fällig am 01.09.2030                     | \$  | 5.800          | 5.776            | 4,000 % fällig am 25.07.2029                             | €   | 2.700          | 2.892            |
| Dominican Republic Government International Bond |     |                |                  |                                                          |     |                |                  |
| 6,950 % fällig am 15.03.2037                     |     | 5.500          | 5.500            |                                                          |     |                |                  |
| Poland Government International Bond             |     |                |                  |                                                          |     |                |                  |
| 5,375 % fällig am 12.02.2035                     |     | 5.400          | 5.360            |                                                          |     |                |                  |
| Ghana Government International Bond              |     |                |                  |                                                          |     |                |                  |
| 1,500 % fällig am 03.01.2037                     |     | 12.300         | 5.111            |                                                          |     |                |                  |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                               | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                               | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                      |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)  | 6.526.184       | \$ 65.074         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)  | 6.458.649       | \$ 64.400         |
|                                                                            | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                            | PARI<br>(000\$) |                   |
| Chile Electricity Lux MPC SARL<br>5,672 % fällig am 20.10.2035             | \$ 1.600        | 1.600             | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>3,750 % fällig am 09.05.2027 | € 1.400         | 1.420             |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT<br>4,900 % fällig am 24.03.2028                | 1.600           | 1.590             | Israel Electric Corp. Ltd.<br>4,250 % fällig am 14.08.2028                 | \$ 1.300        | 1.252             |
| Melco Resorts Finance Ltd.<br>4,875 % fällig am 06.06.2025                 | 1.400           | 1.395             | Embraer Netherlands Finance BV<br>5,980 % fällig am 11.02.2035             | 1.100           | 1.114             |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028       | EGP 72.700      | 1.379             | South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031 | ZAR 20.300      | 1.032             |
| Windfall Mining Group, Inc.<br>5,854 % fällig am 13.05.2032                | \$ 1.200        | 1.200             | Citadel Finance LLC<br>5,962 % fällig am 10.02.2030                        | \$ 1.000        | 993               |
| South Africa Government International Bond<br>8,875 % fällig am 28.02.2035 | ZAR 23.000      | 1.185             | ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.<br>3,750 % fällig am 27.07.2026           | 1.000           | 987               |
| Saudi Arabian Oil Co.<br>6,375 % fällig am 02.06.2055                      | \$ 1.200        | 1.176             | Petronas Capital Ltd.<br>5,848 % fällig am 03.04.2055                      | 900             | 890               |
| Las Vegas Sands Corp.<br>6,000 % fällig am 15.08.2029                      | 1.100           | 1.119             | Muthoot Finance Ltd.<br>6,375 % fällig am 23.04.2029                       | 900             | 887               |
| Embraer Netherlands Finance BV<br>5,980 % fällig am 11.02.2035             | 1.100           | 1.114             | Cibanco S.A. Ibm<br>4,962 % fällig am 18.07.2029                           | 900             | 863               |
| Southern Gas Corridor CJSC<br>6,875 % fällig am 24.03.2026                 | 1.100           | 1.112             | FWD Group Holdings Ltd.<br>7,635 % fällig am 02.07.2031                    | 800             | 850               |
| BBVA Bancomer S.A.<br>7,625 % fällig am 11.02.2035                         | 1.100           | 1.100             | IRB Infrastructure Developers Ltd.<br>7,110 % fällig am 11.03.2032         | 800             | 816               |
| Embraer Netherlands Finance BV<br>7,000 % fällig am 28.07.2030             | 1.000           | 1.068             | Jollibee Worldwide Pte Ltd.<br>5,332 % fällig am 02.04.2030                | 800             | 811               |
| Azule Energy Finance PLC<br>8,125 % fällig am 23.01.2030                   | 1.000           | 1.007             | MTR Corp. Ltd.<br>4,375 % fällig am 01.04.2030                             | 800             | 804               |
| South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031 | ZAR 20.300      | 998               | Southern Copper Corp.<br>7,500 % fällig am 27.07.2035                      | 700             | 793               |
| Citadel Finance LLC<br>5,900 % fällig am 10.02.2030                        | \$ 1.000        | 994               | Raizen Fuels Finance S.A.<br>6,700 % fällig am 25.02.2037                  | 800             | 784               |
| Elect Global Investments Ltd.<br>7,200 % fällig am 11.09.2030              | 900             | 900               | Banco Internacional del Peru SAA Interbank<br>3,250 % fällig am 04.10.2026 | 800             | 782               |
| Petronas Capital Ltd.<br>5,848 % fällig am 03.04.2055                      | 900             | 900               | Bank Mandiri Persero Tbk PT<br>2,000 % fällig am 19.04.2026                | 800             | 778               |
| Endeavour Mining PLC<br>7,000 % fällig am 28.05.2030                       | 850             | 841               | Saudi Arabian Oil Co.<br>4,250 % fällig am 16.04.2039                      | 900             | 768               |
| Banco Davivienda S.A.<br>8,125 % fällig am 02.07.2035                      | 800             | 800               | Ooredoo International Finance Ltd.<br>4,625 % fällig am 10.10.2034         | 800             | 763               |

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                              |     | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                              |     | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|---------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                               |     |                |                  | VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                            |     |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) |     | 15.351.525     | \$ 153.074       | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) |     | 13.508.524     | \$ 134.700       |
|                                                                           |     | PARI<br>(000S) |                  |                                                                           |     | PARI<br>(000S) |                  |
| Dominican Republic Government International Bond                          |     |                |                  | South Africa Government International Bond                                |     |                |                  |
| 10,500 % fällig am 15.03.2037                                             | DOP | 1.682.600      | 27.088           | 8,500 % fällig am 31.01.2037                                              | ZAR | 264.500        | 11.482           |
| Poland Government International Bond                                      |     |                |                  | Colombian TES                                                             |     |                |                  |
| 5,750 % fällig am 25.04.2029                                              | PLN | 63.700         | 17.413           | 5,750 % fällig am 03.11.2027                                              | COP | 35.000.000     | 7.774            |
| Mexico Government International Bond                                      |     |                |                  | Banque Centrale de Tunisie Government International Bond                  |     |                |                  |
| 8,500 % fällig am 01.03.2029                                              | MXN | 327.000        | 16.774           | 6,375 % fällig am 15.07.2026                                              | €   | 3.400          | 3.401            |
| South Africa Government International Bond                                |     |                |                  | Peru Government International Bond                                        |     |                |                  |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030                                              | ZAR | 259.400        | 13.704           | 6,850 % fällig am 12.08.2035                                              | PEN | 11.000         | 3.116            |
| Colombian TES                                                             |     |                |                  | Finance Department Government of Sharjah                                  |     |                |                  |
| 7,000 % fällig am 26.03.2031                                              | COP | 64.083.400     | 12.388           | 6,125 % fällig am 06.03.2036                                              | \$  | 2.900          | 2.773            |
| Colombian TES                                                             |     |                |                  | RAK Capital                                                               |     |                |                  |
| 5,750 % fällig am 03.11.2027                                              |     | 35.000.000     | 7.437            | 5,000 % fällig am 12.03.2035                                              |     | 2.700          | 2.735            |
| Czech Republic Government International Bond                              |     |                |                  | Republic of Kenya Government International Bond                           |     |                |                  |
| 5,000 % fällig am 30.09.2030                                              | CZK | 150.100        | 7.275            | 9,750 % fällig am 16.02.2031                                              |     | 2.600          | 2.631            |
| Mexico Government International Bond                                      |     |                |                  | Peru Government International Bond                                        |     |                |                  |
| 8,500 % fällig am 28.02.2030                                              | MXN | 146.000        | 7.183            | 6,900 % fällig am 12.08.2037                                              | PEN | 9.500          | 2.526            |
| Colombia Government International Bond                                    |     |                |                  | Romania Government International Bond                                     |     |                |                  |
| 1,000 % fällig am 09.02.2033                                              | COP | 25.000.000     | 6.428            | 5,250 % fällig am 10.03.2030                                              | €   | 2.300          | 2.516            |
| Egypt Government International Bond                                       |     |                |                  | Argentina Government International Bond                                   |     |                |                  |
| 21,954 % fällig am 04.03.2028                                             | EGP | 322.900        | 6.126            | 3,500 % fällig am 09.07.2041                                              | \$  | 4.100          | 2.476            |
| Peru Government International Bond                                        |     |                |                  | El Salvador Government International Bond                                 |     |                |                  |
| 6,850 % fällig am 12.08.2035                                              | PEN | 21.600         | 5.960            | 9,650 % fällig am 21.11.2054                                              |     | 2.500          | 2.445            |
| Ecuador Government International Bond                                     |     |                |                  | Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik                             |     |                |                  |
| 6,900 % fällig am 31.07.2030                                              | \$  | 5.710          | 3.946            | 13,000 % fällig am 05.12.2025                                             | DOP | 128.900        | 2.121            |
| Nigeria Treasury Bills                                                    |     |                |                  | Egypt Government International Bond                                       |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 11.06.2026                                              | NGN | 7.095.994      | 3.460            | 7,903 % fällig am 21.02.2048                                              | \$  | 3.100          | 2.103            |
| Nigeria Treasury Bills                                                    |     |                |                  | Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC                            |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 12.06.2026                                              |     | 7.089.519      | 3.460            | 0,000 % fällig am 05.04.2032                                              |     | 3.000          | 2.090            |
| Republic of Panama                                                        |     |                |                  | Bulgaria Government International Bond                                    |     |                |                  |
| 4,103 % fällig am 05.03.2027                                              | €   | 3.200          | 3.438            | 4,125 % fällig am 07.05.2038                                              | €   | 1.700          | 2.003            |
| Yinson Boronia Production BV                                              |     |                |                  | Fortune Star BVI Ltd.                                                     |     |                |                  |
| 8,947 % fällig am 31.07.2042                                              | \$  | 3.271          | 3.417            | 3,950 % fällig am 02.10.2026                                              |     | 1.900          | 1.985            |
| Chile Electricity Lux MPC SARL                                            |     |                |                  | Bulgaria Government International Bond                                    |     |                |                  |
| 5,672 % fällig am 20.10.2035                                              |     | 3.300          | 3.300            | 3,500 % fällig am 07.05.2034                                              |     | 1.700          | 1.976            |
| Senegal Government International Bond                                     |     |                |                  | Bahrain Government International Bond                                     |     |                |                  |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028                                              | €   | 3.400          | 3.256            | 7,500 % fällig am 07.07.2037                                              | \$  | 1.900          | 1.906            |
| Finance Ministry Angola                                                   |     |                |                  | City of Ulaanbaatar Mongolia                                              |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 11.12.2025                                              | \$  | 2.900          | 2.900            | 7,750 % fällig am 21.08.2027                                              |     | 1.900          | 1.886            |

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                      | AKTIEN |                | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                      | AKTIEN |                | ERLÖSE<br>(000S) |
|-----------------------------------------------------------------------------------|--------|----------------|------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                                       |        |                |                  | VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                                    |        |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)         |        | 120.567        | \$ 1.202         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)         |        | 120.343        | \$ 1.200         |
|                                                                                   |        | PARI<br>(000S) |                  |                                                                                   |        | PARI<br>(000S) |                  |
| Malaysia Government International Bond<br>3,899 % fällig am 16.11.2027            | MYR    | 4.120          | 989              | Mexico Government International Bond<br>3,000 % fällig am 03.12.2026              | MXN    | 8.444          | 407              |
| South Korea Government International Bond<br>2,625 % fällig am 10.03.2027         | KRW    | 578.300        | 426              | South Africa Government International Bond<br>10,500 % fällig am 21.12.2026       | ZAR    | 4.900          | 276              |
| Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 01.03.2029              | MXN    | 7.600          | 369              | Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 01.03.2029              | MXN    | 5.600          | 270              |
| Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 02.03.2028              |        | 7.000          | 346              | Philippines Government International Bond<br>6,250 % fällig am 28.02.2029         | PHP    | 12.170         | 220              |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028              | EGP    | 15.600         | 296              | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos<br>0,000 % fällig am 06.05.2027    | CLP    | 225.000        | 218              |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos<br>0,000 % fällig am 06.05.2027    | CLP    | 225.000        | 218              | Panama Infrastructure Receivable Purchaser<br>PLC<br>0,000 % fällig am 05.04.2032 | \$     | 300            | 209              |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile<br>6,330 % fällig am 13.01.2035                 | \$     | 200            | 200              | Corp. Nacional del Cobre de Chile<br>6,330 % fällig am 13.01.2035                 |        | 200            | 203              |
| Mexico Government International Bond<br>5,850 % fällig am 02.07.2032              |        | 200            | 200              | Korea Southern Power Co. Ltd.<br>5,375 % fällig am 21.09.2026                     |        | 200            | 202              |
| Mexico Government International Bond<br>6,625 % fällig am 29.01.2038              |        | 200            | 200              | Prosus NV<br>5,500 % fällig am 21.07.2025                                         |        | 200            | 200              |
| Turkey Government International Bond<br>7,125 % fällig am 12.02.2032              |        | 200            | 199              | Oman Government International Bond<br>4,750 % fällig am 15.06.2026                |        | 200            | 199              |
| South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031        | ZAR    | 4.000          | 194              | City of Ulaanbaatar Mongolia<br>7,750 % fällig am 21.08.2027                      |        | 200            | 199              |
| Colombian TES<br>13,250 % fällig am 09.02.2033                                    | COP    | 656.200        | 164              | Turkey Government International Bond<br>7,125 % fällig am 12.02.2032              |        | 200            | 196              |
| South Africa Government International Bond<br>8,000 % fällig am 31.01.2030        | ZAR    | 3.200          | 162              | Mexico Government International Bond<br>7,750 % fällig am 13.11.2042              | MXN    | 4.100          | 165              |
| Mexico Government International Bond<br>7,750 % fällig am 13.11.2042              | MXN    | 4.100          | 161              | Colombian TES<br>11,500 % fällig am 25.07.2046                                    | COP    | 757.200        | 164              |
| Turkey Government International Bond<br>37,000 % fällig am 18.02.2026             | TRY    | 5.700          | 140              | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos<br>5,000 % fällig am 01.10.2028    | CLP    | 135.000        | 142              |
| Dominican Republic Government International Bond<br>10,750 % fällig am 01.06.2036 | DOP    | 8.000          | 132              | Mexico Government International Bond<br>7,750 % fällig am 23.11.2034              | MXN    | 3.000          | 131              |
| Dominican Republic Government International Bond<br>10,500 % fällig am 15.03.2037 |        | 8.000          | 129              | Peru Government International Bond<br>7,300 % fällig am 12.08.2033                | PEN    | 400            | 115              |
| Philippines Government International Bond<br>6,250 % fällig am 28.02.2029         | PHP    | 7.020          | 122              | Israel Government International Bond<br>5,000 % fällig am 30.10.2026              | €      | 100            | 112              |
| Deutsche Bank AG<br>8,010 % fällig am 18.07.2034                                  | INR    | 10.000         | 117              | Arab Bank for Economic Development in Africa<br>3,750 % fällig am 25.01.2027      |        | 100            | 111              |
| Peru Government International Bond<br>6,850 % fällig am 12.08.2035                | PEN    | 400            | 110              | Thailand Government International Bond<br>2,500 % fällig am 17.11.2029            | THB    | 3.630          | 111              |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos<br>5,800 % fällig am 01.10.2029    | CLP    | 100.000        | 108              | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034              | MXN    | 2.510          | 110              |
| Thailand Government International Bond<br>2,500 % fällig am 17.11.2029            | THB    | 3.500          | 106              | Romania Government International Bond<br>5,250 % fällig am 10.03.2030             | €      | 100            | 109              |
| Egypt Government International Bond<br>4,750 % fällig am 11.04.2025               | €      | 100            | 104              | Poland Government International Bond<br>5,000 % fällig am 25.01.2030              | PLN    | 400            | 108              |
| Romania Government International Bond<br>5,250 % fällig am 10.03.2030             |        | 100            | 103              | Ivory Coast Government International Bond<br>5,250 % fällig am 22.03.2030         | €      | 100            | 100              |
| Nigeria Treasury Bills<br>0,000 % fällig am 29.06.2026                            | NGN    | 201.923        | 100              | Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos<br>4,700 % fällig am 01.09.2030    | CLP    | 100.000        | 95               |
|                                                                                   |        |                |                  | Turkey Government International Bond<br>27,700 % fällig am 27.09.2034             | TRY    | 3.700          | 91               |
|                                                                                   |        |                |                  | South Africa Government International Bond<br>8,000 % fällig am 31.01.2030        | ZAR    | 1.700          | 91               |
|                                                                                   |        |                |                  | Republic of Colombia<br>1,000 % fällig am 28.04.2028                              | COP    | 413.900        | 89               |

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                |                  |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,875 % fällig am 15.07.2034 (a) | \$ 14.281      | \$ 13.870        | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.05.2054                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 6.704       | \$ 6.722         |
| South Africa Government International Bond<br>8,875 % fällig am 28.02.2035       | ZAR 145.025    | 7.565            | TUI AG<br>5,875 % fällig am 15.03.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | € 400          | 449              |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.01.2055                 | \$ 6.700       | 6.723            | (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                |                  |
| Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034             | MXN 135.758    | 6.663            | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                |                  |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC<br>3,952 % fällig am 16.01.2033    | € 4.000        | 4.121            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC<br>3,683 % fällig am 15.08.2033           | 2.300          | 2.497            | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |                |                  |
| Plenti PL & Green ABS Trust<br>4,955 % fällig am 11.11.2036                      | AUD 3.850      | 2.481            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.<br>5,699 % fällig am 11.04.2045         | \$ 2.200       | 2.200            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Adagio CLO DAC<br>4,834 % fällig am 15.04.2032                                   | € 2.100        | 2.198            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Fair Oaks Loan Funding DAC<br>3,929 % fällig am 15.04.2034                       | 1.800          | 1.880            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,843 % fällig am 15.08.2033          | 1.400          | 1.509            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| EPH Financing International A/S<br>4,625 % fällig am 02.07.2032                  | 1.300          | 1.500            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| CVC Cordatus Loan Fund DAC<br>3,699 % fällig am 26.08.2032                       | 1.300          | 1.448            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| TDC Net A/S<br>5,000 % fällig am 09.08.2032                                      | 1.200          | 1.356            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Prologis LP<br>4,200 % fällig am 15.02.2033                                      | CAD 1.900      | 1.316            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Ford Motor Credit Co. LLC<br>5,918 % fällig am 20.03.2028                        | \$ 1.300       | 1.300            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Ares European CLO DAC<br>3,863 % fällig am 17.04.2032                            | € 1.200        | 1.237            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.<br>7,250 % fällig am 27.09.2028             | \$ 1.200       | 1.200            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Edison International<br>6,250 % fällig am 15.03.2030                             | 1.200          | 1.186            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| AIB Group PLC<br>6,000 % fällig am 14.07.2031                                    | € 1.100        | 1.171            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.<br>8,375 % fällig am 21.06.2028             | 1.000          | 1.169            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Credit Agricole S.A.<br>5,875 % fällig am 23.03.2035                             | 1.100          | 1.163            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| BNP Paribas S.A.<br>7,375 % fällig am 11.06.2030                                 | 1.000          | 1.159            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Erste Group Bank AG<br>7,000 % fällig am 15.04.2031                              | 1.000          | 1.127            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Electricite de France S.A.<br>4,625 % fällig am 07.05.2045                       | 1.000          | 1.118            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| ABN AMRO Bank NV<br>6,375 % fällig am 22.09.2034                                 | 1.000          | 1.108            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| KBC Group NV<br>6,250 % fällig am 17.09.2031                                     | 1.000          | 1.102            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| UBS Group AG<br>9,250 % fällig am 13.11.2028                                     | \$ 1.000       | 1.095            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Barclays PLC<br>9,250 % fällig am 15.09.2028                                     | £ 800          | 1.092            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| CaixaBank S.A.<br>5,875 % fällig am 09.10.2027                                   | € 1.000        | 1.089            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Weir Group, Inc.<br>5,350 % fällig am 06.05.2030                                 | \$ 1.000       | 999              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Severn Trent Utilities Finance PLC<br>3,875 % fällig am 04.08.2035               | € 900          | 932              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Commerzbank AG<br>3,625 % fällig am 14.01.2032                                   | 900            | 927              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |

| BESCHREIBUNG                                             |     | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                             |     | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|----------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                              |     |                |                  | VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                           |     |                |                  |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) |     | 1.860.000      | € 193.700        | PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) |     | 2.637.900      | € 274.523        |
|                                                          |     | PARI<br>(000S) |                  |                                                          |     | PARI<br>(000S) |                  |
| United Kingdom Gilt                                      |     |                |                  | Spain Government International Bond                      |     |                |                  |
| 4,375 % fällig am 07.03.2030                             | £   | 65.400         | 76.520           | 3,150 % fällig am 30.04.2035                             | €   | 30.800         | 30.765           |
| Spain Government International Bond                      |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |     |                |                  |
| 3,150 % fällig am 30.04.2035                             | €   | 33.050         | 32.947           | 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)                         | \$  | 30.496         | 27.715           |
| Spain Government International Bond                      |     |                |                  | Spain Government International Bond                      |     |                |                  |
| 3,200 % fällig am 31.10.2035                             |     | 32.400         | 32.313           | 3,450 % fällig am 31.10.2034                             | €   | 23.900         | 24.530           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |     |                |                  | Realkredit Danmark A/S                                   |     |                |                  |
| 1,625 % fällig am 15.10.2029 (b)                         | \$  | 19.320         | 16.842           | 1,000 % fällig am 01.01.2026                             | DKK | 138.500        | 18.336           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                        |     |                |                  | Spain Government International Bond                      |     |                |                  |
| 3,394 % fällig am 31.10.2031                             | €   | 13.500         | 13.765           | 0,600 % fällig am 15.10.2029                             | €   | 16.200         | 14.774           |
| United Kingdom Gilt                                      |     |                |                  | Nykredit Realkredit A/S                                  |     |                |                  |
| 4,750 % fällig am 22.10.2043                             | £   | 11.700         | 13.281           | 4,000 % fällig am 01.10.2056                             | DKK | 109.800        | 14.681           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |     |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                        |     |                |                  |
| 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)                         | \$  | 13.715         | 12.950           | 3,864 % fällig am 15.10.2028                             | €   | 13.500         | 13.712           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |     |                |                  |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)                         |     | 13.544         | 12.910           | 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)                         | \$  | 13.828         | 12.313           |
| Nykredit Realkredit A/S                                  |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |     |                |                  |
| 1,000 % fällig am 20.02.2026                             | DKK | 81.800         | 10.850           | 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)                         |     | 13.655         | 12.237           |
| Treasury Corp. of Victoria                               |     |                |                  | France Government International Bond                     |     |                |                  |
| 2,000 % fällig am 17.09.2035                             | AUD | 25.100         | 10.623           | 2,750 % fällig am 25.02.2029                             | €   | 12.000         | 12.080           |
| Curzon Mortgages PLC                                     |     |                |                  | Banco de Sabadell S.A.                                   |     |                |                  |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                             | £   | 8.916          | 10.622           | 3,500 % fällig am 28.08.2026                             |     | 10.000         | 10.150           |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                     |     |                |                  | Nationwide Building Society                              |     |                |                  |
| 1,000 % fällig am 01.04.2026                             | DKK | 75.300         | 10.022           | 1,125 % fällig am 31.05.2028                             |     | 10.000         | 9.588            |
| Saudi Arabia Government International Bond               |     |                |                  | Austria Government International Bond                    |     |                |                  |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028                             | \$  | 10.300         | 9.895            | 2,900 % fällig am 20.02.2033                             |     | 9.000          | 9.029            |
| Economic Master Issuer PLC                               |     |                |                  | SpareBank Boligkredit A/S                                |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 25.04.2075                             | £   | 7.600          | 8.915            | 3,625 % fällig am 31.07.2028                             |     | 8.100          | 8.357            |
| E-Carat DE                                               |     |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                        |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 25.05.2034                             | €   | 8.300          | 8.300            | 4,400 % fällig am 01.05.2033                             |     | 7.000          | 7.555            |
| Hops Hill PLC                                            |     |                |                  | UBS Switzerland AG                                       |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 21.06.2056                             | £   | 7.000          | 8.193            | 3,449 % fällig am 21.04.2027                             |     | 7.500          | 7.493            |
| Mexico Government International Bond                     |     |                |                  | Mexico Government International Bond                     |     |                |                  |
| 6,625 % fällig am 29.01.2038                             | \$  | 9.500          | 8.165            | 2,659 % fällig am 24.05.2031                             | \$  | 9.700          | 7.231            |
| Carlyle Euro CLO DAC                                     |     |                |                  | Canadian Imperial Bank of Commerce                       |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 15.08.2038                             | €   | 8.000          | 8.000            | 4,876 % fällig am 14.01.2030                             |     | 7.400          | 6.627            |
| FTA Consumo Santander                                    |     |                |                  | Commonwealth Bank of Australia                           |     |                |                  |
| 2,860 % fällig am 21.01.2040                             |     | 7.900          | 7.900            | 4,971 % fällig am 22.01.2030                             |     | 6.100          | 5.485            |

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Credit Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                         | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                 | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|--------------------------------------|----------------|------------------|----------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>   |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>        |                |                  |
| Europäische Union                    |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities |                |                  |
| 2,750 % fällig am 04.02.2033         | € 14.300       | € 14.310         | 1,875 % fällig am 15.07.2034 (a)             | \$ 12.747      | € 11.630         |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau      |                |                  | BNP Paribas S.A.                             |                |                  |
| 2,375 % fällig am 11.04.2028         | 4.900          | 4.911            | 2,750 % fällig am 25.07.2028                 | € 6.700        | 6.666            |
| AT&T, Inc.                           |                |                  | Europäische Union                            |                |                  |
| 3,150 % fällig am 01.06.2030         | 4.200          | 4.214            | 1,500 % fällig am 04.10.2035                 | 7.400          | 6.327            |
| Universal Music Group NV             |                |                  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau              |                |                  |
| 3,750 % fällig am 30.06.2032         | 3.100          | 3.080            | 0,750 % fällig am 15.01.2029                 | 6.000          | 5.609            |
| Nykredit Realkredit A/S              |                |                  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau              |                |                  |
| 3,625 % fällig am 24.07.2030         | 2.900          | 2.905            | 2,375 % fällig am 11.04.2028                 | 4.900          | 4.939            |
| T-Mobile USA, Inc.                   |                |                  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau              |                |                  |
| 3,150 % fällig am 11.02.2032         | 2.900          | 2.863            | 0,000 % fällig am 09.11.2028                 | 5.400          | 4.908            |
| Vmed O2 UK Financing PLC             |                |                  | Morgan Stanley                               |                |                  |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032         | 2.800          | 2.842            | 4,656 % fällig am 02.03.2029                 | 4.000          | 4.174            |
| American Medical Systems Europe BV   |                |                  | Bank of America Corp.                        |                |                  |
| 3,000 % fällig am 08.03.2031         | 2.600          | 2.572            | 4,134 % fällig am 12.06.2028                 | 3.100          | 3.232            |
| Kommunekredit                        |                |                  | Europäische Union                            |                |                  |
| 2,375 % fällig am 15.09.2032         | 2.500          | 2.452            | 0,450 % fällig am 04.07.2041                 | 5.000          | 3.100            |
| Europäische Investitionsbank         |                |                  | ING-DiBa AG                                  |                |                  |
| 2,750 % fällig am 28.07.2028         | 2.400          | 2.437            | 2,750 % fällig am 09.09.2029                 | 3.000          | 3.022            |
| CPPIB Capital, Inc.                  |                |                  | Argenta Spaarbank NV                         |                |                  |
| 4,300 % fällig am 02.06.2034         | CAD 3.500      | 2.418            | 2,500 % fällig am 25.10.2027                 | 2.700          | 2.706            |
| Morgan Stanley                       |                |                  | Mundys SpA                                   |                |                  |
| 4,656 % fällig am 02.03.2029         | € 2.300        | 2.408            | 1,875 % fällig am 12.02.2028                 | 2.800          | 2.694            |
| UniCredit SpA                        |                |                  | Equitable Financial Life Global Funding      |                |                  |
| 1,000 % fällig am 16.07.2029         | 2.400          | 2.401            | 0,600 % fällig am 16.06.2028                 | 2.900          | 2.673            |
| Commerzbank AG                       |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro            |                |                  |
| 2,500 % fällig am 17.09.2030         | 2.300          | 2.290            | 4,000 % fällig am 30.10.2031                 | 2.500          | 2.591            |
| CaixaBank S.A.                       |                |                  | CPPIB Capital, Inc.                          |                |                  |
| 4,125 % fällig am 09.02.2032         | 2.200          | 2.288            | 0,050 % fällig am 24.02.2031                 | 2.900          | 2.446            |
| Cencora, Inc.                        |                |                  | UniCredit SpA                                |                |                  |
| 3,625 % fällig am 22.05.2032         | 2.100          | 2.095            | 1,000 % fällig am 16.07.2029                 | 2.400          | 2.393            |
| Pacific Life Global Funding          |                |                  | DNB Bank ASA                                 |                |                  |
| 3,125 % fällig am 18.06.2031         | 2.100          | 2.086            | 3,000 % fällig am 29.11.2030                 | 2.300          | 2.269            |
| Becton Dickinson & Co.               |                |                  | Banco Santander S.A.                         |                |                  |
| 3,828 % fällig am 07.06.2032         | 2.000          | 2.025            | 3,500 % fällig am 02.10.2032                 | 2.100          | 2.110            |
| Morgan Stanley                       |                |                  | Haleon UK Capital PLC                        |                |                  |
| 5,192 % fällig am 17.04.2031         | \$ 2.300       | 2.023            | 2,875 % fällig am 18.09.2028                 | 2.100          | 2.096            |
| Cooperatieve Rabobank UA             |                |                  | Coca-Cola Europacific Partners PLC           |                |                  |
| 3,250 % fällig am 29.12.2026         | € 2.000        | 1.951            | 3,250 % fällig am 21.03.2032                 | 2.100          | 2.096            |
| Mexico Government International Bond |                |                  | Goldman Sachs Group, Inc.                    |                |                  |
| 1,125 % fällig am 17.01.2030         | 2.200          | 1.939            | 0,875 % fällig am 09.05.2029                 | 2.300          | 2.092            |
| BP Capital Markets BV                |                |                  |                                              |                |                  |
| 3,360 % fällig am 12.09.2031         | 1.900          | 1.906            |                                              |                |                  |

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                         | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                             | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|--------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                          |                |                  | KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025 (Forts.)                                     |                |                  |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)             | 148.500        | € 15.475         | Bulgaria Government International Bond 3,500 % fällig am 07.05.2034      | € 4.500        | € 4.439          |
|                                                                      | PARI<br>(000S) |                  | Bulgaria Government International Bond 4,125 % fällig am 07.05.2038      | 4.500          | 4.409            |
| FCT Ponant                                                           | € 13.900       | 13.900           | Holding d'Infrastructures de Transport SASU 3,375 % fällig am 21.04.2029 | 4.400          | 4.376            |
| 2,564 % fällig am 27.09.2038                                         |                |                  | BPCE S.A. 5,876 % fällig am 14.01.2031                                   | \$ 4.300       | 4.146            |
| Nykredit Realkredit A/S 3,625 % fällig am 24.07.2030                 | 10.500         | 10.489           | Auto1 Car Funding SARL 3,602 % fällig am 15.12.2033                      | € 4.117        | 4.124            |
| Vmed O2 UK Financing PLC 5,625 % fällig am 15.04.2032                | 10.000         | 10.150           | Fair Oaks Loan Funding DAC 4,184 % fällig am 15.10.2034                  | 4.000          | 4.004            |
| Marzio Finance SRL 2,649 % fällig am 30.06.2050                      | 10.000         | 10.000           | Altrad Investment Authority S.A.S. 4,429 % fällig am 23.06.2032          | 4.000          | 4.000            |
| Galderma Finance Europe BV 3,500 % fällig am 20.03.2030              | 10.000         | 9.986            | Informa PLC 3,375 % fällig am 09.06.2031                                 | 3.900          | 3.884            |
| Volkswagen Financial Services AG 3,250 % fällig am 19.05.2027        | 10.000         | 9.980            |                                                                          |                |                  |
| Indonesia Government International Bond 3,875 % fällig am 15.01.2033 | 10.000         | 9.972            |                                                                          |                |                  |
| Athene Global Funding 3,534 % fällig am 23.02.2027                   | 9.300          | 9.353            |                                                                          |                |                  |
| Golden Bar Securitisation SRL 2,747 % fällig am 20.12.2044           | 9.200          | 9.200            |                                                                          |                |                  |
| Universal Music Group NV 3,750 % fällig am 30.06.2032                | 9.200          | 9.141            |                                                                          |                |                  |
| Republic of Panama 4,804 % fällig am 01.04.2027                      | 8.700          | 8.700            |                                                                          |                |                  |
| Stepstone Group Midco GmbH 0,000 % fällig am 04.12.2031              | 8.700          | 8.613            |                                                                          |                |                  |
| Var Energi ASA 3,875 % fällig am 12.03.2031                          | 8.600          | 8.534            |                                                                          |                |                  |
| BNP Paribas S.A. 3,583 % fällig am 15.01.2031                        | 8.400          | 8.400            |                                                                          |                |                  |
| Koromo Italy Compartment 2,614 % fällig am 26.02.2032                | 8.400          | 8.400            |                                                                          |                |                  |
| Chile Government International Bond 3,750 % fällig am 14.01.2032     | 8.400          | 8.372            |                                                                          |                |                  |
| Universal Music Group NV 4,000 % fällig am 13.06.2031                | 7.500          | 7.750            |                                                                          |                |                  |
| Adagio CLO DAC 3,209 % fällig am 15.04.2032                          | 7.434          | 7.449            |                                                                          |                |                  |
| Barry Callebaut Services NV 3,750 % fällig am 19.02.2028             | 7.400          | 7.393            |                                                                          |                |                  |
| FACT S.A. 3,412 % fällig am 22.09.2031                               | 7.349          | 7.371            |                                                                          |                |                  |
| St. Paul's CLO DAC 3,138 % fällig am 25.10.2035                      | 7.300          | 7.306            |                                                                          |                |                  |
| Voya Euro CLO DAC 3,249 % fällig am 15.10.2034                       | 7.300          | 7.305            |                                                                          |                |                  |
| Blackrock European CLO DAC 3,116 % fällig am 19.07.2035              | 7.300          | 7.303            |                                                                          |                |                  |
| Realty Income Corp. 3,375 % fällig am 20.06.2031                     | 7.100          | 7.069            |                                                                          |                |                  |
| HLD Europe S.C.A. 4,125 % fällig am 02.04.2030                       | 6.700          | 6.686            |                                                                          |                |                  |
| Bank Gospodarstwa Krajowego 3,250 % fällig am 18.03.2030             | 6.500          | 6.466            |                                                                          |                |                  |
| Sandoz Finance BV 4,000 % fällig am 26.03.2035                       | 5.700          | 5.666            |                                                                          |                |                  |
| Amadeus IT Group S.A. 3,375 % fällig am 25.03.2030                   | 5.600          | 5.594            |                                                                          |                |                  |
| JDE Peet's NV 2,250 % fällig am 24.09.2031                           | \$ 6.894       | 5.328            |                                                                          |                |                  |
| United Utilities Water Finance PLC 3,500 % fällig am 27.02.2033      | € 5.200        | 5.163            |                                                                          |                |                  |
| Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025  | 5.179          | 5.114            |                                                                          |                |                  |
| Euro-Galaxy CLO DAC 3,973 % fällig am 15.02.2034                     | 5.000          | 5.003            |                                                                          |                |                  |
| Ipsen S.A. 3,875 % fällig am 25.03.2032                              | 5.000          | 4.982            |                                                                          |                |                  |
| Severn Trent Utilities Finance PLC 3,875 % fällig am 04.08.2035      | 4.900          | 4.869            |                                                                          |                |                  |
| Wells Fargo & Co. 3,900 % fällig am 22.07.2032                       | 4.695          | 4.797            |                                                                          |                |                  |

| BESCHREIBUNG                                |     | PARI<br>(000\$) | ERLÖSE<br>(000\$) |
|---------------------------------------------|-----|-----------------|-------------------|
| <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>       |     |                 |                   |
| U.S. Treasury Bonds                         |     |                 |                   |
| 4,625 % fällig am 15.05.2054                | \$  | 32.000          | € 30.045          |
| Magyar Export-Import Bank                   |     |                 |                   |
| 4,500 % fällig am 27.11.2031                | €   | 20.800          | 21.250            |
| U.S. Treasury Bonds                         |     |                 |                   |
| 4,500 % fällig am 15.11.2054                | \$  | 19.800          | 18.255            |
| Towd Point Mortgage Funding PLC             |     |                 |                   |
| 5,719 % fällig am 20.07.2053                | £   | 10.999          | 13.310            |
| Mortimer BTL PLC                            |     |                 |                   |
| 5,897 % fällig am 22.12.2056                |     | 10.406          | 12.690            |
| Lloyds Banking Group PLC                    |     |                 |                   |
| 4,750 % fällig am 21.09.2031                | €   | 0.800           | 11.483            |
| Nykredit Realkredit A/S                     |     |                 |                   |
| 3,625 % fällig am 24.07.2030                |     | 10.500          | 10.631            |
| Indonesia Government International Bond     |     |                 |                   |
| 3,875 % fällig am 15.01.2033                |     | 10.000          | 10.125            |
| Volkswagen Financial Services AG            |     |                 |                   |
| 3,250 % fällig am 19.05.2027                |     | 10.000          | 10.093            |
| Haleon UK Capital PLC                       |     |                 |                   |
| 2,875 % fällig am 18.09.2028                |     | 10.000          | 9.955             |
| Braccan Mortgage Funding PLC                |     |                 |                   |
| 0,000 % fällig am 15.02.2067                | £   | 8.100           | 9.839             |
| London Wall Mortgage Capital PLC            |     |                 |                   |
| 5,718 % fällig am 15.05.2057                |     | 7.827           | 9.519             |
| Sandoz Finance BV                           |     |                 |                   |
| 3,250 % fällig am 12.09.2029                | €   | 9.500           | 9.497             |
| Chile Government International Bond         |     |                 |                   |
| 3,750 % fällig am 14.01.2032                |     | 8.400           | 8.517             |
| Avon Finance PLC                            |     |                 |                   |
| 5,626 % fällig am 28.12.2049                | £   | 6.839           | 8.301             |
| Chile Government International Bond         |     |                 |                   |
| 3,875 % fällig am 09.07.2031                | €   | 7.500           | 7.679             |
| BNP Paribas S.A.                            |     |                 |                   |
| 3,583 % fällig am 15.01.2031                |     | 7.200           | 7.264             |
| JDE Peet's NV                               |     |                 |                   |
| 0,500 % fällig am 16.01.2029                |     | 6.400           | 5.800             |
| Deutsche Bank AG                            |     |                 |                   |
| 1,750 % fällig am 19.11.2030                |     | 6.200           | 5.741             |
| Sandoz Finance BV                           |     |                 |                   |
| 4,000 % fällig am 26.03.2035                |     | 5.700           | 5.725             |
| Amadeus IT Group S.A.                       |     |                 |                   |
| 3,375 % fällig am 25.03.2030                |     | 5.600           | 5.690             |
| Mexico Government International Bond        |     |                 |                   |
| 7,000 % fällig am 03.09.2026                | MXN | 120.000         | 5.386             |
| United Utilities Water Finance PLC          |     |                 |                   |
| 3,500 % fällig am 27.02.2033                | €   | 5.200           | 5.119             |
| JDE Peet's NV                               |     |                 |                   |
| 2,250 % fällig am 24.09.2031                | \$  | 6.894           | 5.054             |
| Severn Trent Utilities Finance PLC          |     |                 |                   |
| 3,875 % fällig am 04.08.2035                | €   | 4.900           | 4.823             |
| Wells Fargo & Co.                           |     |                 |                   |
| 3,900 % fällig am 22.07.2032                |     | 4.695           | 4.792             |
| Holding d'Infrastructures de Transport SASU |     |                 |                   |
| 3,375 % fällig am 21.04.2029                |     | 4.400           | 4.428             |
| Bank Gospodarstwa Krajowego                 |     |                 |                   |
| 4,000 % fällig am 13.03.2032                |     | 4.200           | 4.295             |
| Commerzbank AG                              |     |                 |                   |
| 4,625 % fällig am 17.01.2031                |     | 4.000           | 4.178             |
| Volkswagen International Finance NV         |     |                 |                   |
| 1,875 % fällig am 30.03.2027                |     | 3.500           | 3.454             |

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                     |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |     | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |     |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |     |                |                  |
| France Government International Bond<br>3,600 % fällig am 25.05.2042             | €   | 41.500         | € 41.158         | France Government International Bond<br>3,000 % fällig am 25.05.2054                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | €   | 36.500         | € 31.648         |
| France Government International Bond<br>3,750 % fällig am 25.05.2056             |     | 37.800         | 37.392           | Europäische Union<br>3,000 % fällig am 04.12.2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     | 23.700         | 23.794           |
| Bundesrepublik Deutschland<br>2,200 % fällig am 15.02.2034                       |     | 16.800         | 16.490           | France Government International Bond<br>4,500 % fällig am 25.04.2041                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     | 19.800         | 21.997           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,375 % fällig am 15.07.2033 (a) | \$  | 17.661         | 15.966           | Nykredit Realkredit A/S<br>4,000 % fällig am 01.10.2056                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | DKK | 161.700        | 21.620           |
| Bundesrepublik Deutschland<br>0,250 % fällig am 15.02.2029                       | €   | 16.700         | 15.502           | France Government International Bond<br>2,500 % fällig am 25.05.2043                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | €   | 21.500         | 18.221           |
| France Government International Bond<br>3,250 % fällig am 25.05.2055             |     | 17.000         | 15.334           | Bundesrepublik Deutschland<br>0,250 % fällig am 15.02.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |     | 16.700         | 15.650           |
| United Kingdom Gilt<br>4,750 % fällig am 22.10.2043                              | £   | 13.300         | 15.021           | Bundesrepublik Deutschland<br>2,600 % fällig am 15.05.2041                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |     | 16.200         | 15.584           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2033 (a) | \$  | 15.476         | 13.491           | Europäische Union<br>2,625 % fällig am 04.07.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     | 11.000         | 11.150           |
| France Government International Bond<br>4,000 % fällig am 25.04.2055             | €   | 12.500         | 12.645           | Netherlands Government International Bond<br>0,000 % fällig am 15.01.2038                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |     | 13.700         | 9.543            |
| Bundesrepublik Deutschland<br>1,800 % fällig am 15.08.2053                       |     | 15.000         | 12.175           | Bundesrepublik Deutschland<br>0,250 % fällig am 15.02.2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |     | 8.800          | 8.643            |
| Europäische Union<br>2,625 % fällig am 04.07.2028                                |     | 11.000         | 11.116           | France Government International Bond<br>3,250 % fällig am 25.05.2055                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     | 9.700          | 8.316            |
| Europäische Union<br>3,375 % fällig am 12.12.2035                                |     | 9.200          | 9.446            | Netherlands Government International Bond<br>0,000 % fällig am 15.01.2052                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |     | 16.400         | 7.611            |
| Bundesrepublik Deutschland<br>1,000 % fällig am 15.05.2038                       |     | 11.100         | 9.048            | Bundesrepublik Deutschland<br>2,500 % fällig am 04.07.2044                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |     | 7.800          | 7.190            |
| Curzon Mortgages PLC<br>5,482 % fällig am 28.07.2049                             | £   | 6.720          | 8.006            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,864 % fällig am 15.10.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     | 6.100          | 6.196            |
| Europäische Union<br>3,750 % fällig am 12.10.2045                                | €   | 8.000          | 7.935            | France Government International Bond<br>4,000 % fällig am 25.04.2055                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     | 5.400          | 5.482            |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028       | \$  | 7.200          | 6.917            | France Government International Bond<br>1,750 % fällig am 25.05.2066                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |     | 5.700          | 3.418            |
| France Government International Bond<br>3,000 % fällig am 25.05.2054             | €   | 7.900          | 6.747            | Driver UK Multi-Compartment S.A.<br>5,309 % fällig am 25.09.2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | £   | 2.746          | 3.254            |
| New South Wales Treasury Corp.<br>2,000 % fällig am 08.03.2033                   | AUD | 14.100         | 6.612            | France Government International Bond<br>0,500 % fällig am 25.05.2072                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | €   | 7.600          | 2.236            |
| France Government International Bond<br>0,750 % fällig am 25.05.2052             | €   | 13.200         | 6.277            | Nykredit Realkredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.10.2056                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | DKK | 16.096         | 1.520            |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,394 % fällig am 15.10.2031                |     | 6.100          | 6.220            | Europäische Union<br>3,250 % fällig am 04.07.2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | €   | 1.400          | 1.437            |
| Braccan Mortgage Funding PLC<br>0,000 % fällig am 17.05.2067                     | £   | 5.200          | 6.137            | (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |     |                |                  |
| Golden Bar Securitisation SRL<br>2,747 % fällig am 20.12.2044                    | €   | 6.100          | 6.100            | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |     |                |                  |
| E-Carat DE<br>0,000 % fällig am 25.05.2034                                       |     | 6.100          | 6.100            | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |     |                |                  |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,203 % fällig am 15.02.2035          |     | 6.100          | 6.100            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Autonoria Spain<br>2,530 % fällig am 30.04.2043                                  |     | 6.100          | 6.100            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Red & Black Auto Germany UG<br>2,482 % fällig am 15.04.2034                      |     | 6.000          | 6.000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Economic Master Issuer PLC<br>0,000 % fällig am 25.04.2075                       | £   | 5.100          | 5.982            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| France Government International Bond<br>1,750 % fällig am 25.05.2066             | €   | 10.000         | 5.938            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Compartment VCL<br>2,431 % fällig am 21.04.2031                                  |     | 5.700          | 5.700            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Netherlands Government International Bond<br>2,000 % fällig am 15.01.2054        |     | 6.700          | 5.320            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Treasury Corp. of Victoria<br>4,250 % fällig am 20.12.2032                       | AUD | 9.000          | 5.151            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Europäische Union<br>2,500 % fällig am 04.10.2052                                | €   | 6.500          | 5.022            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Canadian Imperial Bank of Commerce<br>4,876 % fällig am 14.01.2030               | \$  | 5.100          | 4.917            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Auto ABS Italian Stella Loans SRL<br>2,773 % fällig am 28.12.2040                | €   | 4.800          | 4.800            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Bowbell Master Issuer PLC<br>0,000 % fällig am 23.07.2071                        | £   | 3.800          | 4.514            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Slovenia Government International Bond<br>3,500 % fällig am 14.04.2055           | €   | 4.200          | 4.162            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |
| Bavarian Sky S.A.<br>0,000 % fällig am 20.08.2032                                |     | 4.100          | 4.100            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |     |                |                  |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Short-Term Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                         | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                      | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                   |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                             |                |                  |
| Santander UK PLC<br>2,625 % fällig am 12.04.2028                     | € 4.400        | € 4.417          | Sandoz Finance BV<br>3,970 % fällig am 17.04.2027                                 | € 2.650        | € 2.711          |
| Yorkshire Building Society<br>0,010 % fällig am 13.10.2027           | 3.500          | 3.319            | DS Smith PLC<br>4,375 % fällig am 27.07.2027                                      | 2.200          | 2.271            |
| Bendigo & Adelaide Bank Ltd.<br>4,020 % fällig am 04.10.2026         | 3.000          | 3.074            | Fidelity National Information Services, Inc.<br>1,500 % fällig am 21.05.2027      | 2.200          | 2.141            |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>0,000 % fällig am 15.06.2026      | 3.100          | 3.035            | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>0,000 % fällig am 15.06.2026                   | 2.000          | 1.958            |
| Achmea Bank NV<br>2,625 % fällig am 15.10.2027                       | 3.000          | 3.029            | IMCD NV<br>4,875 % fällig am 18.09.2028                                           | 1.700          | 1.773            |
| Europäische Union<br>0,250 % fällig am 22.10.2026                    | 3.100          | 3.024            | Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.<br>1,750 % fällig am 26.04.2028              | 1.800          | 1.739            |
| Argenta Spaarbank NV<br>2,500 % fällig am 25.10.2027                 | 3.000          | 3.019            | Clydesdale Bank PLC<br>0,010 % fällig am 22.09.2026                               | 1.800          | 1.736            |
| DNB Boligkreditt A/S<br>0,010 % fällig am 12.05.2028                 | 3.100          | 2.900            | France Treasury Bills<br>0,000 % fällig am 23.07.2025                             | 1.720          | 1.716            |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab<br>1,000 % fällig am 01.04.2026 | DKK 21.600     | 2.869            | Kraft Heinz Foods Co.<br>2,250 % fällig am 25.05.2028                             | 1.700          | 1.677            |
| Bank of Nova Scotia<br>3,250 % fällig am 18.01.2028                  | € 2.800        | 2.856            | Fortum Oyj<br>4,000 % fällig am 26.05.2028                                        | 1.600          | 1.654            |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp.<br>0,267 % fällig am 18.06.2026        | 2.900          | 2.819            | Elia Transmission Belgium S.A.<br>3,250 % fällig am 04.04.2028                    | 1.600          | 1.623            |
| Kraft Heinz Foods Co.<br>2,250 % fällig am 25.05.2028                | 2.800          | 2.759            | Commerzbank AG<br>2,500 % fällig am 25.02.2028                                    | 1.500          | 1.502            |
| Dexia S.A.<br>2,500 % fällig am 05.04.2028                           | 2.700          | 2.699            | Hamburg Commercial Bank AG<br>1,375 % fällig am 27.05.2025                        | 1.500          | 1.496            |
| Europäische Investitionsbank<br>2,250 % fällig am 14.08.2028         | 2.000          | 2.000            | AT&T, Inc.<br>1,800 % fällig am 05.09.2026                                        | 1.500          | 1.488            |
| Commonwealth Bank of Australia<br>0,750 % fällig am 28.02.2028       | 1.900          | 1.824            | DSV A/S<br>0,375 % fällig am 26.02.2027                                           | 1.400          | 1.350            |
| Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.<br>2,750 % fällig am 08.12.2027     | 1.800          | 1.822            | Achmea Bank NV<br>2,625 % fällig am 15.10.2027                                    | 1.200          | 1.202            |
| Credit Agricole Home Loan SFH S.A.<br>2,750 % fällig am 12.01.2028   | 1.800          | 1.822            | Fortum Oyj<br>1,625 % fällig am 27.02.2026                                        | 1.200          | 1.189            |
| Canadian Imperial Bank of Commerce<br>0,040 % fällig am 09.07.2027   | 1.900          | 1.818            | Tesco Corporate Treasury Services PLC<br>0,875 % fällig am 29.05.2026             | 1.200          | 1.175            |
| UBS Switzerland AG<br>2,583 % fällig am 23.09.2027                   | 1.800          | 1.811            | AyT Cedula Cajas Fondo de Titulizacion de Activos<br>3,750 % fällig am 30.06.2025 | 1.100          | 1.104            |
| Macquarie Bank Ltd.<br>2,574 % fällig am 15.09.2027                  | 1.800          | 1.811            | Canadian Imperial Bank of Commerce<br>0,375 % fällig am 10.03.2026                | 1.000          | 980              |
|                                                                      |                |                  | Commonwealth Bank of Australia<br>0,500 % fällig am 27.07.2026                    | 1.000          | 975              |
|                                                                      |                |                  | Canadian Imperial Bank of Commerce<br>0,010 % fällig am 07.10.2026                | 1.000          | 963              |
|                                                                      |                |                  | Banco Santander Totta S.A.<br>3,750 % fällig am 11.09.2026                        | 900            | 916              |
|                                                                      |                |                  | Prima Banka Slovensko A/S<br>4,250 % fällig am 06.10.2025                         | 900            | 909              |
|                                                                      |                |                  | American Tower Corp.<br>1,375 % fällig am 04.04.2025                              | 900            | 899              |
|                                                                      |                |                  | Visa, Inc.<br>2,250 % fällig am 15.05.2028                                        | 900            | 895              |
|                                                                      |                |                  | Westpac Securities NZ Ltd.<br>1,777 % fällig am 14.01.2026                        | 900            | 895              |
|                                                                      |                |                  | Royal Bank of Canada<br>0,625 % fällig am 23.03.2026                              | 900            | 883              |
|                                                                      |                |                  | Federation des Caisses Desjardins du Quebec<br>0,010 % fällig am 08.04.2026       | 900            | 876              |
|                                                                      |                |                  | DAA Finance PLC<br>1,554 % fällig am 07.06.2028                                   | 900            | 873              |
|                                                                      |                |                  | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE<br>2,750 % fällig am 07.11.2027               | 800            | 805              |
|                                                                      |                |                  | ABN AMRO Bank NV<br>3,184 % fällig am 21.01.2028                                  | 800            | 800              |
|                                                                      |                |                  | Becton Dickinson Euro Finance SARL<br>1,208 % fällig am 04.06.2026                | 800            | 789              |
|                                                                      |                |                  | BP Capital Markets PLC<br>1,573 % fällig am 16.02.2027                            | 800            | 784              |
|                                                                      |                |                  | JDE Peet's NV<br>0,000 % fällig am 16.01.2026                                     | 800            | 782              |
|                                                                      |                |                  | Chanel Ceres PLC<br>0,500 % fällig am 31.07.2026                                  | 800            | 780              |
|                                                                      |                |                  | CaixaBank S.A.<br>4,625 % fällig am 16.05.2027                                    | 700            | 715              |

| BESCHREIBUNG                                   | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025 (Forts.)</b> |                |                  |
| <b>Lseg Netherlands BV</b>                     |                |                  |
| 2,750 % fällig am 20.09.2027                   | € 700          | € 703            |
| <b>Toyota Motor Finance Netherlands BV</b>     |                |                  |
| 3,443 % fällig am 21.08.2026                   | 700            | 701              |
| <b>ABN AMRO Bank NV</b>                        |                |                  |
| 1,000 % fällig am 25.02.2027                   | 700            | 700              |
| <b>Nationwide Building Society</b>             |                |                  |
| 3,242 % fällig am 02.05.2027                   | 700            | 700              |
| <b>Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.</b>          |                |                  |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026                   | 700            | 698              |
| <b>Proximus SADP</b>                           |                |                  |
| 1,875 % fällig am 01.10.2025                   | 700            | 697              |
| <b>Heathrow Funding Ltd.</b>                   |                |                  |
| 1,500 % fällig am 12.10.2027                   | 700            | 697              |
| <b>Coloplast Finance BV</b>                    |                |                  |
| 2,250 % fällig am 19.05.2027                   | 700            | 696              |
| <b>JAB Holdings BV</b>                         |                |                  |
| 1,750 % fällig am 25.06.2026                   | 700            | 695              |
| <b>McDonald's Corp.</b>                        |                |                  |
| 1,875 % fällig am 26.05.2027                   | 700            | 692              |
| <b>Haleon Netherlands Capital BV</b>           |                |                  |
| 1,250 % fällig am 29.03.2026                   | 700            | 690              |
| <b>Abertis Infraestructuras S.A.</b>           |                |                  |
| 2,375 % fällig am 27.09.2027                   | 700            | 690              |
| <b>TenneT Holding BV</b>                       |                |                  |
| 1,625 % fällig am 17.11.2026                   | 700            | 689              |
| <b>CRH SMW Finance DAC</b>                     |                |                  |
| 1,250 % fällig am 05.11.2026                   | 700            | 689              |
| <b>SSE PLC</b>                                 |                |                  |
| 1,375 % fällig am 04.09.2027                   | 700            | 684              |
| <b>EDP Finance BV</b>                          |                |                  |
| 0,375 % fällig am 16.09.2026                   | 700            | 681              |
| <b>Orange S.A.</b>                             |                |                  |
| 0,875 % fällig am 03.02.2027                   | 700            | 678              |
| <b>Enel Finance International NV</b>           |                |                  |
| 0,375 % fällig am 17.06.2027                   | 700            | 669              |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



| BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                               | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                      |                |                  |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>4,375 % fällig am 09.05.2030 | € 5.100        | € 5.221          | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>1,875 % fällig am 31.03.2027 | € 6.200        | € 5.984          |
| Opal Bidco S.A.S.<br>5,500 % fällig am 13.03.2032                          | 4.700          | 4.700            | Lorca Holdco Ltd.<br>0,000 % fällig am 25.03.2031                          | 4.056          | 4.079            |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV<br>4,125 % fällig am 01.06.2031 | 4.400          | 4.385            | Wintershall Dea Finance BV<br>2,499 % fällig am 20.04.2026                 | 3.800          | 3.669            |
| Heimstaden Bostad AB<br>3,625 % fällig am 13.10.2026                       | 3.900          | 3.800            | Abertis Infraestructuras Finance BV<br>2,625 % fällig am 26.01.2027        | 3.100          | 3.053            |
| Telefonica Europe BV<br>6,135 % fällig am 03.02.2030                       | 3.500          | 3.754            | Carnival PLC<br>1,000 % fällig am 28.10.2029                               | 3.200          | 2.824            |
| TK Elevator Midco GmbH<br>4,375 % fällig am 15.07.2027                     | 3.700          | 3.708            | Opal Bidco S.A.S.<br>5,500 % fällig am 31.03.2032                          | 2.700          | 2.747            |
| Canary Wharf Group Investment Holdings PLC<br>3,375 % fällig am 23.04.2028 | £ 3.100        | 3.370            | ZF Finance GmbH<br>2,750 % fällig am 25.05.2027                            | 2.700          | 2.606            |
| ZF Europe Finance BV<br>7,000 % fällig am 12.06.2030                       | € 3.100        | 3.100            | Grifols S.A.<br>2,250 % fällig am 15.11.2027                               | 2.600          | 2.516            |
| Bellis Acquisition Co. PLC<br>8,125 % fällig am 14.05.2030                 | £ 2.700        | 3.004            | VF Corp.<br>4,250 % fällig am 07.03.2029                                   | 2.400          | 2.383            |
| Albion Financing 1 SARL<br>5,375 % fällig am 21.05.2030                    | € 3.000        | 3.000            | ZF Europe Finance BV<br>5,125 % fällig am 13.03.2029                       | 2.300          | 2.357            |
| Aroundtown Finance SARL<br>7,125 % fällig am 16.01.2030                    | 2.800          | 2.952            | ZF Europe Finance BV<br>2,000 % fällig am 23.02.2026                       | 2.200          | 2.173            |
| Cidron Aida Finco SARL<br>7,000 % fällig am 27.10.2031                     | 2.900          | 2.900            | Mobico Group PLC<br>4,250 % fällig am 26.11.2025                           | £ 1.900        | 2.135            |
| EC Finance PLC<br>3,000 % fällig am 15.10.2026                             | 3.000          | 2.887            | Monitchem HoldCo S.A.<br>8,750 % fällig am 01.05.2028                      | € 2.100        | 2.096            |
| Gatwick Airport Finance PLC<br>4,375 % fällig am 07.04.2026                | £ 2.400        | 2.759            | Miller Homes Group Finco PLC<br>7,000 % fällig am 15.05.2029               | £ 1.700        | 2.010            |
| Manuchar Group SARL<br>6,943 % fällig am 07.07.2032                        | € 2.800        | 2.744            | Stepstone Group Midco GmbH<br>0,000 % fällig am 04.12.2031                 | € 1.900        | 1.902            |
| New Immo Holding S.A.<br>2,750 % fällig am 26.11.2026                      | 2.800          | 2.667            | Energian Israel Finance Ltd.<br>8,500 % fällig am 30.09.2033               | \$ 1.900       | 1.845            |
| Wintershall Dea Finance BV<br>6,117 % fällig am 08.05.2030                 | 2.600          | 2.635            | Piraeus Financial Holdings S.A.<br>5,375 % fällig am 18.09.2035            | € 1.800        | 1.821            |
| CAB SELAS<br>3,375 % fällig am 01.02.2028                                  | 2.700          | 2.566            | Boels Topholding BV<br>6,250 % fällig am 15.02.2029                        | 1.700          | 1.772            |
| INEOS Quattro Holdings U.K. Ltd.<br>6,429 % fällig am 02.04.2029           | 2.500          | 2.444            | Nidda Healthcare Holding GmbH<br>7,500 % fällig am 21.08.2026              | 1.718          | 1.764            |
| TDC Net A/S<br>5,000 % fällig am 09.08.2032                                | 2.400          | 2.426            | Eurobank S.A.<br>4,000 % fällig am 24.09.2030                              | 1.600          | 1.627            |
|                                                                            |                |                  | Flora Food Management BV<br>6,875 % fällig am 02.07.2029                   | 1.500          | 1.551            |
|                                                                            |                |                  | Eutelsat S.A.<br>9,750 % fällig am 13.04.2029                              | 1.500          | 1.485            |
|                                                                            |                |                  | ELO SACA<br>3,250 % fällig am 23.07.2027                                   | 1.500          | 1.444            |
|                                                                            |                |                  | Citycon Oyj<br>7,875 % fällig am 10.06.2029                                | 1.400          | 1.366            |
|                                                                            |                |                  | New Immo Holding S.A.<br>2,750 % fällig am 26.11.2026                      | 1.400          | 1.355            |
|                                                                            |                |                  | Grifols S.A.<br>3,875 % fällig am 15.10.2028                               | 1.400          | 1.351            |
|                                                                            |                |                  | Heimstaden Bostad AB<br>6,250 % fällig am 04.12.2029                       | 1.400          | 1.330            |
|                                                                            |                |                  | ELO SACA<br>2,875 % fällig am 29.01.2026                                   | 1.300          | 1.277            |
|                                                                            |                |                  | Crown European Holdings SACA<br>4,750 % fällig am 15.03.2029               | 1.200          | 1.241            |
|                                                                            |                |                  | Transportes Aereos Portugueses S.A.<br>5,125 % fällig am 15.11.2029        | 1.200          | 1.194            |
|                                                                            |                |                  | Drax Finco PLC<br>5,875 % fällig am 15.04.2029                             | 1.100          | 1.158            |
|                                                                            |                |                  | AccorInvest Group S.A.<br>5,500 % fällig am 15.11.2031                     | 1.100          | 1.131            |
|                                                                            |                |                  | Quicktop Holdco AB<br>6,911 % fällig am 21.03.2030                         | 1.100          | 1.119            |
|                                                                            |                |                  | Amber Finco PLC<br>6,625 % fällig am 15.07.2029                            | 1.000          | 1.058            |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                             | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                             | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------|----------------|------------------|----------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                       |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                    |                |                  |
| PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 687.000        | € 71.731         | PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a) | 625.000        | € 65.206         |
|                                                          | PARI<br>(000S) |                  |                                                          | PARI<br>(000S) |                  |
| United Kingdom Gilt                                      |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                        |                |                  |
| 4,375 % fällig am 07.03.2030                             | £ 43.200       | 50.447           | 3,864 % fällig am 15.10.2028                             | € 46.100       | 46.823           |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                        |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |                |                  |
| 3,394 % fällig am 15.10.2031                             | € 46.100       | 47.006           | 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)                         | \$ 34.426      | 29.970           |
| United Kingdom Gilt                                      |                |                  | United Kingdom Gilt                                      |                |                  |
| 1,500 % fällig am 22.07.2026                             | £ 30.300       | 35.042           | 0,375 % fällig am 22.10.2026                             | £ 25.200       | 28.584           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |                |                  | Realkredit Danmark A/S                                   |                |                  |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)                         | \$ 34.327      | 29.589           | 5,000 % fällig am 01.10.2053                             | DKK 125.600    | 17.242           |
| United Kingdom Gilt                                      |                |                  | UBS Switzerland AG                                       |                |                  |
| 0,375 % fällig am 22.10.2026                             | £ 25.200       | 27.905           | 3,390 % fällig am 05.12.2025                             | € 15.600       | 15.714           |
| United Kingdom Gilt                                      |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                        |                |                  |
| 4,250 % fällig am 07.12.2027                             | 23.100         | 27.568           | 1,400 % fällig am 26.05.2025                             | 12.116         | 12.125           |
| Bundesrepublik Deutschland                               |                |                  | Nykredit Realkredit A/S                                  |                |                  |
| 2,200 % fällig am 15.02.2034                             | € 17.000       | 16.690           | 2,400 % fällig am 01.10.2056                             | DKK 82.300     | 11.017           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |                |                  | Realkredit Danmark A/S                                   |                |                  |
| 1,625 % fällig am 15.10.2029 (b)                         | \$ 16.083      | 14.020           | 1,000 % fällig am 01.01.2026                             | 79.100         | 10.525           |
| United Kingdom Gilt                                      |                |                  | Europäische Finanzstabilisierungsfazilität               |                |                  |
| 4,750 % fällig am 22.10.2043                             | £ 9.400        | 10.673           | 2,875 % fällig am 13.02.2034                             | € 8.500        | 8.528            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities             |                |                  | Europäische Union                                        |                |                  |
| 1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)                         | \$ 11.532      | 10.425           | 3,250 % fällig am 04.07.2034                             | 8.100          | 8.313            |
| Curzon Mortgages PLC                                     |                |                  | Bundesrepublik Deutschland                               |                |                  |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                             | £ 5.722        | 6.817            | 2,200 % fällig am 15.02.2034                             | 7.200          | 6.973            |
| Nykredit Realkredit A/S                                  |                |                  | United Kingdom Gilt                                      |                |                  |
| 1,000 % fällig am 01.10.2056                             | DKK 62.100     | 5.982            | 0,375 % fällig am 22.10.2030                             | £ 7.300        | 6.951            |
| Saudi Arabia Government International Bond               |                |                  | Charles Schwab Corp.                                     |                |                  |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028                             | \$ 5.900       | 5.668            | 5,014 % fällig am 13.05.2026                             | \$ 8.000       | 6.947            |
| BNP Paribas S.A.                                         |                |                  | Nykredit Realkredit A/S                                  |                |                  |
| 3,583 % fällig am 15.01.2031                             | € 5.400        | 5.471            | 1,000 % fällig am 01.10.2056                             | DKK 61.723     | 5.830            |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab                     |                |                  | Santander UK PLC                                         |                |                  |
| 1,000 % fällig am 01.04.2026                             | DKK 40.000     | 5.327            | 2,625 % fällig am 12.04.2028                             | € 5.000        | 5.026            |
| Jyske Realkredit A/S                                     |                |                  | Realkredit Danmark A/S                                   |                |                  |
| 2,360 % fällig am 01.07.2025                             | 38.900         | 5.215            | 1,000 % fällig am 01.04.2026                             | DKK 36.200     | 4.807            |
| Economic Master Issuer PLC                               |                |                  | Lloyds Banking Group PLC                                 |                |                  |
| 0,000 % fällig am 25.04.2075                             | £ 4.400        | 5.161            | 6,098 % fällig am 07.08.2027                             | \$ 4.800       | 4.199            |
| Bletchley Park Funding PLC                               |                |                  | Canadian Imperial Bank of Commerce                       |                |                  |
| 0,000 % fällig am 27.01.2070                             | 4.300          | 5.108            | 4,876 % fällig am 14.01.2030                             | 4.300          | 3.820            |
| E-Carat DE                                               |                |                  | AstraZeneca PLC                                          |                |                  |
| 0,000 % fällig am 25.05.2034                             | € 5.100        | 5.100            | 1,375 % fällig am 06.08.2030                             | 4.800          | 3.574            |

(a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|---------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                        |                 |                   | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 12.622.574      | \$ 125.859        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 12.586.496      | \$ 125.500        |
|                                                                           | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,500 % fällig am 15.11.2054                       | \$ 11.200       | 10.734            | Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033             | CAD 14.000      | 9.740             |
| France Government International Bond<br>2,750 % fällig am 25.02.2030      | € 9.900         | 10.318            | U.S. Treasury Notes<br>4,000 % fällig am 15.02.2034                              | \$ 5.000        | 4.788             |
| Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033      | CAD 14.000      | 9.729             | Canada Government International Bond<br>4,000 % fällig am 01.03.2029             | CAD 6.000       | 4.394             |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                       | \$ 5.800        | 5.851             | Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.12.2054                                       | \$ 4.481        | 4.022             |
| Spain Government International Bond<br>3,550 % fällig am 31.10.2033       | € 5.100         | 5.515             | Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.01.2055                                       | 4.285           | 3.845             |
| Jyske Realkredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.04.2026                      | DKK 36.900      | 5.065             | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.06.2054                 | 3.674           | 3.709             |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.12.2054                                | \$ 4.500        | 4.030             | Jyske Realkredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.04.2026                             | DKK 23.400      | 3.538             |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.01.2055                                | 4.300           | 3.881             | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | \$ 3.492        | 3.499             |
| Spain Government International Bond<br>0,000 % fällig am 31.01.2028       | € 3.500         | 3.531             | Japan Government International Bond<br>0,100 % fällig am 01.01.2026              | ¥ 480.000       | 3.356             |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.02.2055                                | \$ 3.600        | 3.216             | Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.02.2055                                       | \$ 3.586        | 3.219             |
| France Government International Bond<br>2,750 % fällig am 25.10.2027      | € 2.650         | 2.892             | U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                              | 3.100           | 3.044             |
| France Government International Bond<br>0,750 % fällig am 25.02.2028      | 2.750           | 2.835             | Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.12.2033             | CAD 4.100       | 2.970             |
| Japan Government International Bond<br>2,300 % fällig am 20.12.2054       | ¥ 422.000       | 2.781             | DBS Bank Ltd.<br>5,277 % fällig am 14.05.2027                                    | £ 1.800         | 2.410             |
| Spain Government International Bond<br>2,400 % fällig am 31.05.2028       | € 2.400         | 2.583             | UBS Group AG<br>7,750 % fällig am 01.03.2029                                     | € 1.900         | 2.323             |
| U.S. Treasury Notes<br>4,000 % fällig am 15.02.2034                       | \$ 2.600        | 2.490             | South Africa Government International Bond<br>10,000 % fällig am 31.03.2033      | ZAR 41.700      | 2.293             |
| Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2045       | ¥ 338.000       | 2.419             | Israel Government International Bond<br>5,000 % fällig am 30.10.2026             | € 2.100         | 2.237             |
| Freddie Mac<br>5,255 % fällig am 25.04.2055                               | \$ 2.200        | 2.202             | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.06.2054                 | \$ 1.972        | 1.998             |
| Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2055       | ¥ 325.000       | 2.142             | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.06.2054                 | 1.943           | 1.969             |
| Elstree Funding<br>4,943 % fällig am 21.01.2065                           | £ 1.700         | 2.140             | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.09.2054                 | 1.934           | 1.962             |

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                 | AKTIEN          |            | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                 | AKTIEN          |            | ERLÖSE<br>(000\$) |
|------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------------|-------------------|------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------------|-------------------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                                  |                 |            |                   | VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                               |                 |            |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating NAV Fund (a) | 469.799.338     | \$         | 4.684.518         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating NAV Fund (a) | 443.430.484     | \$         | 4.421.600         |
|                                                                              | PARI<br>(000\$) |            |                   |                                                                              | PARI<br>(000\$) |            |                   |
| U.S. Treasury Bonds                                                          |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 4,500 % fällig am 15.11.2054                                                 | \$              | 638.900    | 611.551           | 6,000 % fällig am 01.06.2054                                                 | \$              | 652.458    | 658.602           |
| Canada Government International Bond                                         |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 2,750 % fällig am 01.06.2033                                                 | CAD             | 742.800    | 513.556           | 6,000 % fällig am 01.02.2054                                                 |                 | 525.712    | 531.302           |
| France Government International Bond                                         |                 |            |                   | Canada Government International Bond                                         |                 |            |                   |
| 2,750 % fällig am 25.02.2030                                                 | €               | 353.200    | 368.042           | 2,750 % fällig am 01.06.2033                                                 | CAD             | 742.800    | 514.090           |
| Ginnie Mae                                                                   |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 3,500 % fällig am 20.02.2055                                                 | \$              | 263.452    | 238.741           | 6,000 % fällig am 01.07.2054                                                 | \$              | 485.414    | 492.003           |
| France Government International Bond                                         |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 2,750 % fällig am 25.10.2027                                                 | €               | 197.250    | 216.034           | 6,000 % fällig am 01.05.2054                                                 |                 | 422.529    | 429.014           |
| Spain Government International Bond                                          |                 |            |                   | Ginnie Mae                                                                   |                 |            |                   |
| 3,550 % fällig am 31.10.2033                                                 |                 | 192.200    | 207.853           | 3,500 % fällig am 20.02.2055                                                 |                 | 262.453    | 235.552           |
| U.S. Treasury Bonds                                                          |                 |            |                   | Ginnie Mae                                                                   |                 |            |                   |
| 4,625 % fällig am 15.02.2055                                                 | \$              | 183.700    | 185.242           | 3,500 % fällig am 20.01.2055                                                 |                 | 175.286    | 157.319           |
| Japan Government International Bond                                          |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 2,300 % fällig am 20.12.2054                                                 | ¥               | 25.428.000 | 167.568           | 6,000 % fällig am 01.09.2054                                                 |                 | 154.010    | 156.010           |
| Ginnie Mae                                                                   |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 3,500 % fällig am 20.01.2055                                                 | \$              | 175.917    | 157.836           | 6,000 % fällig am 01.02.2054                                                 |                 | 154.734    | 155.932           |
| France Government International Bond                                         |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 0,750 % fällig am 25.02.2028                                                 | €               | 144.250    | 149.040           | 6,000 % fällig am 01.03.2054                                                 |                 | 131.635    | 132.568           |
| Spain Government International Bond                                          |                 |            |                   | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                                 |                 |            |                   |
| 3,150 % fällig am 30.04.2035                                                 |                 | 135.526    | 142.488           | 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)                                             |                 | 102.549    | 102.771           |
| Spain Government International Bond                                          |                 |            |                   | Ginnie Mae                                                                   |                 |            |                   |
| 0,000 % fällig am 31.01.2028                                                 |                 | 130.700    | 131.871           | 3,500 % fällig am 20.12.2054                                                 |                 | 114.063    | 102.372           |
| Ginnie Mae                                                                   |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 3,500 % fällig am 20.12.2054                                                 | \$              | 14.548     | 102.914           | 6,500 % fällig am 01.12.2053                                                 |                 | 86.987     | 88.785            |
| Spain Government International Bond                                          |                 |            |                   | Canada Government International Bond                                         |                 |            |                   |
| 2,400 % fällig am 31.05.2028                                                 | €               | 88.300     | 95.034            | 2,750 % fällig am 01.03.2030                                                 | CAD             | 105.400    | 76.153            |
| Japan Government International Bond                                          |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 2,400 % fällig am 20.03.2045                                                 | ¥               | 11.959.000 | 85.458            | 6,500 % fällig am 01.11.2053                                                 | \$              | 73.376     | 74.534            |
| Spain Government International Bond                                          |                 |            |                   | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                                 |                 |            |                   |
| 3,200 % fällig am 31.10.2035                                                 | €               | 70.400     | 79.707            | 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)                                             |                 | 73.175     | 73.127            |
| Canada Government International Bond                                         |                 |            |                   | Uniform Mortgage-Backed Security                                             |                 |            |                   |
| 2,750 % fällig am 01.03.2030                                                 | CAD             | 107.100    | 77.082            | 6,500 % fällig am 01.11.2053                                                 |                 | 65.596     | 67.048            |
| United Kingdom Gilt                                                          |                 |            |                   | South Korea Government International<br>Bond                                 |                 |            |                   |
| 4,375 % fällig am 31.07.2054                                                 | £               | 62.470     | 72.928            | 4,250 % fällig am 10.12.2032                                                 | KRW             | 88.261.410 | 65.125            |
| Japan Government International Bond                                          |                 |            |                   | Province of Ontario                                                          |                 |            |                   |
| 2,000 % fällig am 20.12.2044                                                 | ¥               | 11.038.000 | 71.718            | 3,650 % fällig am 02.06.2033                                                 | CAD             | 87.400     | 63.136            |

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                               |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                   |     | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|--------------------------------------------|-----|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>         |     |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                          |     |                |                  |
| U.S. Treasury Bonds                        |     |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                               |     |                |                  |
| 4,500 % fällig am 15.11.2054               | \$  | 162.900        | \$ 155.970       | 6,000 % fällig am 01.06.2054                                   | \$  | 402.677        | \$ 409.278       |
| France Government International Bond       |     |                |                  | Canada Government International Bond                           |     |                |                  |
| 2,750 % fällig am 25.02.2030               | €   | 104.000        | 108.379          | 2,750 % fällig am 01.06.2033                                   | CAD | 137.400        | 95.576           |
| Canada Government International Bond       |     |                |                  | Ginnie Mae                                                     |     |                |                  |
| 2,750 % fällig am 01.06.2033               | CAD | 137.400        | 95.469           | 3,500 % fällig am 20.12.2054                                   | \$  | 94.896         | 85.170           |
| Ginnie Mae                                 |     |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                               |     |                |                  |
| 3,500 % fällig am 20.12.2054               | \$  | 95.300         | 86.368           | 6,000 % fällig am 01.05.2054                                   |     | 51.671         | 52.638           |
| Spain Government International Bond        |     |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                               |     |                |                  |
| 3,550 % fällig am 31.10.2033               | €   | 53.748         | 58.138           | 6,000 % fällig am 01.06.2054                                   |     | 51.985         | 52.608           |
| U.S. Treasury Bonds                        |     |                |                  | Europäische Investitionsbank                                   |     |                |                  |
| 4,625 % fällig am 15.02.2055               | \$  | 51.900         | 52.545           | 1,500 % fällig am 15.06.2032                                   | €   | 40.800         | 39.484           |
| Europäische Investitionsbank               |     |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                               |     |                |                  |
| 1,500 % fällig am 15.06.2032               | €   | 40.800         | 39.129           | 6,000 % fällig am 01.07.2054                                   | \$  | 38.835         | 39.362           |
| Japan Government International Bond        |     |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                               |     |                |                  |
| 2,300 % fällig am 20.12.2054               | ¥   | 5.186.000      | 34.113           | 6,000 % fällig am 01.12.2053                                   |     | 38.600         | 39.026           |
| Spain Government International Bond        |     |                |                  | Canada Government International Bond                           |     |                |                  |
| 0,000 % fällig am 31.01.2028               | €   | 32.150         | 32.437           | 4,000 % fällig am 01.03.2029                                   | CAD | 53.000         | 38.890           |
| Europäische Union                          |     |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                               |     |                |                  |
| 2,500 % fällig am 04.12.2031               |     | 30.400         | 31.138           | 6,500 % fällig am 01.12.2053                                   | \$  | 32.213         | 32.885           |
| Japan Government International Bond        |     |                |                  | Europäische Union                                              |     |                |                  |
| 2,000 % fällig am 20.12.2044               | ¥   | 4.225.000      | 27.578           | 2,500 % fällig am 04.12.2031                                   | €   | 30.400         | 31.669           |
| France Government International Bond       |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                   |     |                |                  |
| 2,750 % fällig am 25.10.2027               | €   | 24.700         | 26.952           | 0,125 % fällig am 15.04.2025 (a)                               | \$  | 27.812         | 27.872           |
| Spain Government International Bond        |     |                |                  | U.S. Treasury Bonds                                            |     |                |                  |
| 3,150 % fällig am 30.04.2035               |     | 24.530         | 25.805           | 4,500 % fällig am 15.11.2054                                   |     | 22.900         | 22.805           |
| France Government International Bond       |     |                |                  | Canada Government International Bond                           |     |                |                  |
| 0,750 % fällig am 25.02.2028               |     | 24.800         | 25.564           | 2,750 % fällig am 01.12.2033                                   | CAD | 31.500         | 22.496           |
| Saudi Arabia Government International Bond |     |                |                  | South Korea Government International Bond                      |     |                |                  |
| 3,375 % fällig am 05.03.2032               |     | 21.800         | 24.988           | 4,000 % fällig am 10.12.2031                                   | KRW | 29.799.950     | 21.805           |
| Spain Government International Bond        |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                   |     |                |                  |
| 2,700 % fällig am 31.01.2030               |     | 23.695         | 24.726           | 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)                               | \$  | 19.306         | 19.294           |
| Hanwha Energy USA Holdings Corp.           |     |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                               |     |                |                  |
| 4,375 % fällig am 02.07.2028               | \$  | 24.500         | 24.476           | 6,000 % fällig am 01.09.2054                                   |     | 18.880         | 19.175           |
| Spain Government International Bond        |     |                |                  | Ginnie Mae                                                     |     |                |                  |
| 2,400 % fällig am 31.05.2028               | €   | 21.850         | 23.516           | 3,500 % fällig am 20.11.2054                                   |     | 20.173         | 18.105           |
| United Utilities Water Finance PLC         |     |                |                  | Enel Finance International NV                                  |     |                |                  |
| 3,500 % fällig am 27.02.2033               |     | 19.400         | 20.174           | 3,875 % fällig am 23.01.2035                                   | €   | 15.100         | 17.019           |
| Coöperatieve Rabobank UA                   |     |                |                  | Ginnie Mae                                                     |     |                |                  |
| 4,875 % fällig am 01.11.2030               | £   | 15.000         | 18.889           | 3,500 % fällig am 20.01.2055                                   | \$  | 16.838         | 15.112           |
| Japan Government International Bond        |     |                |                  |                                                                |     |                |                  |
| 2,400 % fällig am 20.03.2045               | ¥   | 2.593.000      | 18.541           | (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt. |     |                |                  |
| Ginnie Mae                                 |     |                |                  |                                                                |     |                |                  |
| 3,500 % fällig am 20.11.2054               | \$  | 20.273         | 18.151           |                                                                |     |                |                  |
| Agence Francaise de Developpement          |     |                |                  |                                                                |     |                |                  |
| 4,500 % fällig am 05.03.2029               |     | 17.200         | 17.266           |                                                                |     |                |                  |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                              |     | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                  |     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|---------------------------------------------------------------------------|-----|-----------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------|-----|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                        |     |                 |                   | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |     |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) |     | 48.876.368      | \$ 487.354        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)     |     | 57.725.999      | \$ 575.600        |
|                                                                           |     | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                               |     | PARI<br>(000\$) |                   |
| France Government International Bond 2,750 % fällig am 25.02.2030         | €   | 27.500          | 28.658            | Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053                 | \$  | 33.659          | 34.513            |
| Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033         | CAD | 41.000          | 28.493            | Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.07.2054                 |     | 28.847          | 29.239            |
| U.S. Treasury Bonds 4,500 % fällig am 15.11.2054                          | \$  | 25.200          | 24.143            | Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033             | CAD | 41.000          | 28.504            |
| Spain Government International Bond 3,150 % fällig am 30.04.2035          | €   | 13.160          | 13.808            | Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.07.2054                 | \$  | 23.818          | 24.016            |
| U.S. Treasury Bonds 4,625 % fällig am 15.02.2055                          | \$  | 13.500          | 13.616            | Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.06.2054                 |     | 21.374          | 21.556            |
| Spain Government International Bond 3,550 % fällig am 31.10.2033          | €   | 12.500          | 13.518            | Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.03.2030             | CAD | 17.700          | 12.788            |
| Japan Government International Bond 2,000 % fällig am 20.12.2044          | ¥   | 2.005.000       | 13.130            | Province of Ontario 3,650 % fällig am 02.06.2033                              |     | 17.700          | 12.783            |
| Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.03.2030         | CAD | 17.900          | 12.883            | Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2026                          | DKK | 81.900          | 12.201            |
| Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.11.2054                                   | \$  | 13.500          | 12.083            | Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.11.2054                                       | \$  | 13.433          | 12.056            |
| Spain Government International Bond 2,700 % fällig am 31.01.2030          | €   | 10.900          | 11.387            | Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.12.2053                 |     | 11.327          | 11.572            |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2026                      | DKK | 81.900          | 11.238            | Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2026                             | DKK | 76.600          | 11.035            |
| Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2026                         |     | 76.600          | 10.515            | Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.03.2055                                       | \$  | 10.154          | 9.113             |
| Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.03.2055                                   | \$  | 10.200          | 9.112             | Spain Government International Bond 3,150 % fällig am 30.04.2035              | €   | 7.000           | 7.971             |
| Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2028          | €   | 8.050           | 8.122             | Canada Government International Bond 4,000 % fällig am 01.03.2029             | CAD | 9.800           | 7.214             |
| Canadian Imperial Bank of Commerce 4,876 % fällig am 14.01.2030           | \$  | 7.400           | 7.400             | Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.01.2055                                       | \$  | 7.573           | 6.796             |
| Japan Government International Bond 2,300 % fällig am 20.12.2054          | ¥   | 1.098.000       | 7.213             | South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032        | KRW | 9.063.260       | 6.777             |
| Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.01.2055                                   | \$  | 7.600           | 6.883             | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | \$  | 6.310           | 6.323             |
| France Government International Bond 2,750 % fällig am 25.10.2027         | €   | 6.200           | 6.765             | Europäische Union 3,375 % fällig am 04.10.2039                                | €   | 5.700           | 6.034             |
| France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.02.2028         |     | 6.200           | 6.391             | Canada Government International Bond 2,750 % fällig am 01.12.2033             | CAD | 7.700           | 5.558             |

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



| BESCHREIBUNG                                                                       | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                         | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                 |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)          | 59.506.761      | \$ 593.361        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)            | 61.906.952      | \$ 617.300        |
|                                                                                    | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                      | PARI<br>(000\$) |                   |
| Alliant Holdings Intermediate LLC<br>6,750 % fällig am 15.04.2028                  | \$ 20.800       | 20.930            | Imola Merger Corp.<br>4,750 % fällig am 15.05.2029                                   | \$ 20.600       | 19.673            |
| CCO Holdings LLC<br>5,000 % fällig am 01.02.2028                                   | 16.400          | 15.998            | Electricite de France S.A.<br>9,125 % fällig am 15.03.2033                           | 16.125          | 18.228            |
| Owens & Minor, Inc.<br>10,000 % fällig am 15.04.2030                               | 15.800          | 15.800            | Monitchem HoldCo S.A.<br>8,750 % fällig am 01.05.2028                                | € 14.350        | 16.138            |
| Albion Financing 1 SARL<br>7,000 % fällig am 21.05.2030                            | 15.025          | 15.025            | Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>5,500 % fällig am 01.04.2028                         | \$ 14.960       | 15.047            |
| Canary Wharf Group Investment Holdings PLC<br>1,750 % fällig am 07.04.2026         | € 13.100        | 14.529            | Kronos International, Inc.<br>9,500 % fällig am 15.03.2029                           | € 9.633         | 11.485            |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC<br>2,000 % fällig am 01.09.2028             | 13.312          | 13.925            | Abertis Infraestructuras Finance BV<br>2,625 % fällig am 26.01.2027                  | 10.900          | 11.131            |
| Organon & Co.<br>2,875 % fällig am 30.04.2028                                      | 11.650          | 12.642            | Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>6,250 % fällig am 15.01.2030                    | \$ 11.000       | 10.987            |
| TransDigm, Inc.<br>6,829 % fällig am 28.02.2031                                    | \$ 12.323       | 12.333            | INEOS Quattro Finance PLC<br>6,750 % fällig am 15.04.2030                            | € 9.725         | 10.719            |
| VF Corp.<br>0,250 % fällig am 25.02.2028                                           | € 12.175        | 12.278            | Prime Healthcare Services, Inc.<br>9,375 % fällig am 15.03.2029                      | \$ 9.525        | 9.180             |
| Carnival Corp.<br>5,750 % fällig am 15.03.2030                                     | \$ 12.150       | 12.129            | alstria office REIT-AG<br>1,500 % fällig am 15.11.2027                               | € 8.900         | 9.149             |
| OneMain Finance Corp.<br>6,625 % fällig am 15.01.2028                              | 11.700          | 11.856            | Verisure Holding AB<br>6,715 % fällig am 27.03.2028                                  | 8.475           | 9.049             |
| Quikrete Holdings, Inc.<br>6,375 % fällig am 01.03.2032                            | 11.675          | 11.764            | CCO Holdings LLC<br>5,125 % fällig am 01.05.2027                                     | \$ 9.000        | 8.826             |
| Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033               | CAD 16.275      | 11.242            | Cirsa Finance International SARL<br>4,500 % fällig am 15.03.2027                     | € 8.400         | 8.799             |
| Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.<br>6,750 % fällig am 15.04.2032              | \$ 10.925       | 10.925            | ams-OSRAM AG<br>10,500 % fällig am 30.03.2029                                        | 8.425           | 8.773             |
| Opal Bidco S.A.S.<br>5,500 % fällig am 31.03.2032                                  | € 9.675         | 10.710            | Alliant Holdings Intermediate LLC<br>6,500 % fällig am 01.10.2031                    | \$ 8.700        | 8.607             |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % fällig am 15.04.2032                           | 9.000           | 10.695            | ZipRecruiter, Inc.<br>5,000 % fällig am 15.01.2030                                   | 9.600           | 8.116             |
| EQM Midstream Partners LP<br>7,500 % fällig am 01.06.2030                          | \$ 9.700        | 10.440            | Expand Energy Corp.<br>6,750 % fällig am 15.04.2029                                  | 8.000           | 8.089             |
|                                                                                    | AKTIEN          |                   | Viridien<br>8,500 % fällig am 15.10.2030                                             | € 7.400         | 8.023             |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a) | 808.831         | 10.258            | SS&C Technologies, Inc.<br>6,500 % fällig am 01.06.2032                              | \$ 7.625        | 7.748             |
|                                                                                    | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                      |                 |                   |
| SS&C Technologies, Inc.<br>5,500 % fällig am 30.09.2027                            | \$ 10.100       | 10.075            | (a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an. |                 |                   |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                             | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) |
|--------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                       |                |                  | <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025 (Forts.)</b>                             |                |                  |
| Perrigo Finance Unlimited Co.<br>5,375 % fällig am 30.09.2032            | € 150          | \$ 162           | CCO Holdings LLC<br>5,000 % fällig am 01.02.2028                        | \$ 49          | \$ 48            |
| CPI Property Group S.A.<br>6,000 % fällig am 27.01.2032                  | 150            | 158              | Iron Mountain, Inc.<br>4,500 % fällig am 15.02.2031                     | 51             | 47               |
| Novelis Sheet Ingot GmbH<br>3,375 % fällig am 15.04.2029                 | 150            | 150              | ADT Security Corp.<br>4,875 % fällig am 15.07.2032                      | 50             | 47               |
| VZ Secured Financing BV<br>3,500 % fällig am 15.01.2032                  | 150            | 147              | DaVita, Inc.<br>4,625 % fällig am 01.06.2030                            | 50             | 46               |
| Walgreens Boots Alliance, Inc.<br>8,125 % fällig am 15.08.2029           | \$ 125         | 129              | Leeward Renewable Energy Operations LLC<br>4,250 % fällig am 01.07.2029 | 50             | 46               |
| Ocado Group PLC<br>10,500 % fällig am 08.08.2029                         | £ 100          | 125              | Service Corp. International<br>3,375 % fällig am 15.08.2030             | 50             | 45               |
| Aston Martin Capital Holdings Ltd.<br>10,375 % fällig am 31.03.2029      | 100            | 122              | Block, Inc.<br>3,500 % fällig am 01.06.2031                             | 50             | 45               |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % fällig am 15.04.2032                 | € 100          | 119              | Levi Strauss & Co.<br>3,500 % fällig am 01.03.2031                      | 50             | 45               |
| TeamSystem SpA<br>5,000 % fällig am 01.07.2031                           | 100            | 115              | Hilton Domestic Operating Co., Inc.<br>3,625 % fällig am 15.02.2032     | 50             | 45               |
| Grifols S.A.<br>3,875 % fällig am 15.10.2028                             | 100            | 111              | Ball Corp.<br>2,875 % fällig am 15.08.2030                              | 50             | 44               |
| Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC<br>2,000 % fällig am 01.09.2028   | 100            | 106              | Crocs, Inc.<br>4,125 % fällig am 15.08.2031                             | 50             | 44               |
| VF Corp.<br>4,125 % fällig am 07.03.2026                                 | 100            | 105              |                                                                         |                |                  |
| ELO SACA<br>2,875 % fällig am 29.01.2026                                 | 100            | 101              |                                                                         |                |                  |
| NCR Voyix Corp.<br>5,000 % fällig am 01.10.2028                          | \$ 100         | 98               |                                                                         |                |                  |
| RHP Hotel Properties LP<br>7,250 % fällig am 15.07.2028                  | 75             | 77               |                                                                         |                |                  |
| QXO Building Products, Inc.<br>6,750 % fällig am 30.04.2032              | 75             | 76               |                                                                         |                |                  |
| Seagate Data Storage Technology Pte Ltd.<br>5,875 % fällig am 15.07.2030 | 75             | 75               |                                                                         |                |                  |
| Owens & Minor, Inc.<br>10,000 % fällig am 15.04.2030                     | 75             | 75               |                                                                         |                |                  |
| Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.<br>6,750 % fällig am 15.04.2032    | 75             | 75               |                                                                         |                |                  |
| Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>7,050 % fällig am 15.09.2028          | 50             | 52               |                                                                         |                |                  |
| AES Corp.<br>7,600 % fällig am 15.01.2055                                | 50             | 51               |                                                                         |                |                  |
| Hilton Grand Vacations Borrower LLC<br>6,625 % fällig am 15.01.2032      | 50             | 50               |                                                                         |                |                  |
| BCPE Empire Holdings, Inc.<br>7,625 % fällig am 01.05.2027               | 50             | 50               |                                                                         |                |                  |
| ZF North America Capital, Inc.<br>6,875 % fällig am 14.04.2028           | 50             | 50               |                                                                         |                |                  |
| Snap, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.03.2033                               | 50             | 50               |                                                                         |                |                  |
| FMG Resources Pty. Ltd.<br>5,875 % fällig am 15.04.2030                  | 50             | 50               |                                                                         |                |                  |
| Whirlpool Corp.<br>6,125 % fällig am 15.06.2030                          | 50             | 50               |                                                                         |                |                  |
| MPT Operating Partnership LP<br>8,500 % fällig am 15.02.2032             | 50             | 49               |                                                                         |                |                  |
| Park Intermediate Holdings LLC<br>5,875 % fällig am 01.10.2028           | 50             | 49               |                                                                         |                |                  |
| Directv Financing LLC<br>5,875 % fällig am 15.08.2027                    | 50             | 49               |                                                                         |                |                  |
| Block, Inc.<br>2,750 % fällig am 01.06.2026                              | 50             | 49               |                                                                         |                |                  |
| Rakuten Group, Inc.<br>11,250 % fällig am 15.02.2027                     | 45             | 49               |                                                                         |                |                  |
| Clearway Energy Operating LLC<br>4,750 % fällig am 15.03.2028            | 50             | 48               |                                                                         |                |                  |
| Ladder Capital Finance Holdings LLLP<br>4,750 % fällig am 15.06.2029     | 50             | 48               |                                                                         |                |                  |
| Calpine Corp.<br>4,625 % fällig am 01.02.2029                            | 50             | 48               |                                                                         |                |                  |
| Stagwell Global LLC<br>5,625 % fällig am 15.08.2029                      | 50             | 48               |                                                                         |                |                  |
| TerraForm Power Operating LLC<br>4,750 % fällig am 15.01.2030            | 50             | 48               |                                                                         |                |                  |

| BESCHREIBUNG                                                            | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|-------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                          |                |                  | VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025 (Forts.)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                |                  |
| Ocado Group PLC<br>10,500 % fällig am 08.08.2029                        | £ 150          | \$ 188           | American Airlines, Inc.<br>5,500 % fällig am 20.04.2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | \$ 42          | \$ 42            |
| Kronos International, Inc.<br>9,500 % fällig am 15.03.2029              | € 100          | 118              | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                |                  |
| Monitchem HoldCo S.A.<br>8,750 % fällig am 01.05.2028                   | 100            | 114              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| CCO Holdings LLC<br>4,250 % fällig am 01.02.2031                        | \$ 125         | 111              | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |                |                  |
| INEOS Quattro Finance PLC<br>8,500 % fällig am 15.03.2029               | € 100          | 111              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Mundys SpA<br>4,750 % fällig am 24.01.2029                              | 100            | 109              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Perrigo Finance Unlimited Co.<br>5,375 % fällig am 30.09.2032           | 100            | 108              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| VF Corp.<br>4,125 % fällig am 07.03.2026                                | 100            | 107              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Schaeffler AG<br>4,750 % fällig am 14.08.2029                           | 100            | 106              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| CPI Property Group S.A.<br>6,000 % fällig am 27.01.2032                 | 100            | 106              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Walgreens Boots Alliance, Inc.<br>8,125 % fällig am 15.08.2029          | \$ 100         | 101              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Eramet S.A.<br>6,500 % fällig am 30.11.2029                             | € 100          | 101              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Novelis Sheet Ingot GmbH<br>3,375 % fällig am 15.04.2029                | 100            | 100              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>5,500 % fällig am 31.08.2026            | \$ 100         | 100              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| VZ Secured Financing BV<br>3,500 % fällig am 15.01.2032                 | € 100          | 98               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Live Nation Entertainment, Inc.<br>3,750 % fällig am 15.01.2028         | \$ 100         | 95               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Bausch & Lomb Corp.<br>8,375 % fällig am 01.10.2028                     | 75             | 78               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Midcontinent Communications<br>8,000 % fällig am 15.08.2032             | 75             | 77               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| PetSmart, Inc.<br>4,750 % fällig am 15.02.2028                          | 75             | 72               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Calpine Corp.<br>5,000 % fällig am 01.02.2031                           | 75             | 72               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| NextEra Energy Operating Partners LP<br>3,875 % fällig am 15.10.2026    | 75             | 72               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Imola Merger Corp.<br>4,750 % fällig am 15.05.2029                      | 75             | 72               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Jazz Securities DAC<br>4,375 % fällig am 15.01.2029                     | 75             | 71               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| WMG Acquisition Corp.<br>3,750 % fällig am 01.12.2029                   | 75             | 69               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| LifePoint Health, Inc.<br>11,000 % fällig am 15.10.2030                 | 50             | 55               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Windstream Services LLC<br>8,250 % fällig am 01.10.2031                 | 50             | 52               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| XPO, Inc.<br>7,125 % fällig am 01.06.2031                               | 50             | 52               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Kinetik Holdings LP<br>6,625 % fällig am 15.12.2028                     | 50             | 51               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| ams-OSRAM AG<br>12,250 % fällig am 30.03.2029                           | 50             | 51               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| MPT Operating Partnership LP<br>8,500 % fällig am 15.02.2032            | 50             | 51               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Service Properties Trust<br>8,375 % fällig am 15.06.2029                | 50             | 50               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Directv Financing LLC<br>5,875 % fällig am 15.08.2027                   | 50             | 50               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Calpine Corp.<br>4,625 % fällig am 01.02.2029                           | 50             | 48               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Prime Healthcare Services, Inc.<br>9,375 % fällig am 01.09.2029         | 50             | 48               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Medline Borrower LP<br>3,875 % fällig am 01.04.2029                     | 50             | 47               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Avantor Funding, Inc.<br>3,875 % fällig am 01.11.2029                   | 50             | 46               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Leeward Renewable Energy Operations LLC<br>4,250 % fällig am 01.07.2029 | 50             | 45               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |

| BESCHREIBUNG                                                                        | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                  |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)           | 146.798.656     | \$ 1.463.709      | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 145.355.706     | \$ 1.449.400      |
|                                                                                     | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| U.S. Treasury Notes<br>4,625 % fällig am 15.02.2035                                 | \$ 298.500      | 306.679           | U.S. Treasury Notes<br>4,625 % fällig am 15.02.2035                              | \$ 236.600      | 240.984           |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                                 | 123.675         | 122.468           | U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                              | 123.675         | 118.763           |
| U.S. Treasury STRIPS<br>0,000 % fällig am 15.08.2047                                | 100.000         | 33.283            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.04.2029 (b) | 109.681         | 111.908           |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,500 % fällig am 15.11.2054                                 | 27.200          | 25.871            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,500 % fällig am 15.02.2053 (b) | 64.134          | 50.315            |
| Japan Government International Bond<br>2,000 % fällig am 20.12.2044                 | ¥ 3.840.000     | 25.047            | Deutsche Bank AG<br>1,750 % fällig am 19.11.2030                                 | € 32.100        | 33.564            |
| UniCredit SpA<br>5,625 % fällig am 03.12.2032                                       | € 23.300        | 24.388            | Australia Government International Bond<br>1,000 % fällig am 21.11.2031          | AUD 51.800      | 27.409            |
| TP ICAP Finance PLC<br>6,375 % fällig am 12.06.2032                                 | £ 17.000        | 22.958            | U.S. Treasury Bonds<br>4,500 % fällig am 15.11.2054                              | \$ 27.200       | 25.772            |
|                                                                                     | AKTIEN          |                   | UniCredit SpA<br>5,625 % fällig am 03.12.2032                                    | € 23.300        | 24.916            |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (a) | 2.202.381       | 22.200            | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA<br>1,875 % fällig am 09.01.2026              | 21.300          | 24.180            |
|                                                                                     | PARI<br>(000\$) |                   | Netflix, Inc.<br>3,625 % fällig am 15.06.2030                                    | 22.000          | 23.213            |
| Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2045                 | ¥ 2.968.800     | 21.181            | Prosus NV<br>2,031 % fällig am 03.08.2032                                        | 25.387          | 22.496            |
| NatWest Group PLC<br>7,500 % fällig am 28.02.2032                                   | £ 15.375        | 19.521            | NatWest Group PLC<br>7,500 % fällig am 28.02.2032                                | £ 15.375        | 19.985            |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % fällig am 15.04.2032                            | € 15.600        | 18.538            | BNP Paribas S.A.<br>7,375 % fällig am 10.09.2034                                 | \$ 20.100       | 19.899            |
| Pacific Life Global Funding<br>4,955 % fällig am 27.01.2028                         | \$ 17.500       | 17.500            | EQT AB<br>2,875 % fällig am 06.04.2032                                           | € 16.700        | 17.958            |
| BNP Paribas S.A.<br>5,786 % fällig am 13.01.2033                                    | 17.300          | 17.300            | Credit Agricole S.A.<br>5,875 % fällig am 23.03.2035                             | 16.500          | 17.805            |
| Credit Agricole S.A.<br>5,875 % fällig am 23.03.2035                                | € 16.500        | 17.215            | Saudi Arabia Government International Bond<br>4,875 % fällig am 18.07.2033       | \$ 17.700       | 17.511            |
| Itau Unibanco Holding S.A.<br>6,000 % fällig am 27.02.2030                          | \$ 17.000       | 17.000            | American Tower Corp.<br>0,500 % fällig am 15.01.2028                             | € 16.000        | 16.544            |
| Southern California Edison Co.<br>5,450 % fällig am 01.03.2035                      | 16.100          | 16.066            | UniCredit SpA<br>5,375 % fällig am 16.04.2034                                    | 15.300          | 16.513            |
| Kinder Morgan, Inc.<br>2,250 % fällig am 16.03.2027                                 | € 14.640        | 14.900            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,500 % fällig am 01.12.2052                 | \$ 16.786       | 15.758            |
| Welltower OP LLC<br>4,500 % fällig am 01.07.2030                                    | \$ 14.500       | 14.492            |                                                                                  |                 |                   |
| American Medical Systems Europe BV<br>3,250 % fällig am 08.03.2034                  | € 13.800        | 14.387            |                                                                                  |                 |                   |

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                             |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                     |     | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|--------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                       |     |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |     |                |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,500 % fällig am 01.06.2054         | \$  | 21.451         | \$ 20.117        | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,625 % fällig am 15.07.2032 (a) | \$  | 31.280         | \$ 28.125        |
| Australia Government International Bond<br>4,250 % fällig am 15.02.2034  | AUD | 25.900         | 16.144           | Realkredit Danmark A/S<br>1,000 % fällig am 01.01.2026                           | DKK | 148.800        | 21.364           |
| United Kingdom Gilt<br>4,375 % fällig am 31.07.2054                      | £   | 14.000         | 15.478           | Europäische Union<br>2,875 % fällig am 05.10.2029                                | €   | 12.800         | 14.532           |
| Bundesrepublik Deutschland<br>2,500 % fällig am 15.02.2035               | €   | 13.000         | 14.431           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,250 % fällig am 15.07.2029 (a) | \$  | 15.423         | 14.281           |
| U.S. Treasury Bonds<br>3,000 % fällig am 15.08.2048                      | \$  | 16.100         | 12.034           | Nykredit Realkredit A/S<br>4,000 % fällig am 01.10.2056                          | DKK | 91.025         | 13.570           |
| JPMorgan Chase & Co.<br>5,766 % fällig am 22.04.2035                     |     | 10.000         | 10.468           | U.S. Treasury Bonds<br>3,000 % fällig am 15.08.2048                              | \$  | 15.200         | 11.349           |
| Morgan Stanley<br>5,587 % fällig am 18.01.2036                           |     | 10.000         | 10.300           | Citigroup, Inc.<br>5,449 % fällig am 11.06.2035                                  |     | 10.000         | 10.042           |
| Bank of America Corp.<br>5,511 % fällig am 24.01.2036                    |     | 10.000         | 10.265           | Realkredit Danmark A/S<br>1,000 % fällig am 15.01.2026                           | DKK | 61.300         | 8.801            |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>5,536 % fällig am 28.01.2036                |     | 10.000         | 10.206           | France Government International Bond<br>3,000 % fällig am 25.06.2049             | €   | 9.400          | 8.800            |
| Citigroup, Inc.<br>5,449 % fällig am 11.06.2035                          |     | 10.000         | 10.119           | United Kingdom Gilt<br>4,375 % fällig am 31.07.2054                              | £   | 7.600          | 8.578            |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                      |     | 8.900          | 8.631            | KEB Hana Bank<br>3,750 % fällig am 04.05.2026                                    | €   | 7.300          | 8.077            |
| HCA, Inc.<br>5,257 % fällig am 01.03.2028                                |     | 8.064          | 8.040            | Nykredit Realkredit A/S<br>4,000 % fällig am 01.10.2056                          | DKK | 52.809         | 7.942            |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.<br>5,699 % fällig am 11.04.2045 |     | 8.000          | 8.000            | Morgan Stanley<br>3,875 % fällig am 27.01.2026                                   | \$  | 7.743          | 7.693            |
| Keysight Technologies, Inc.<br>5,350 % fällig am 30.07.2030              |     | 7.200          | 7.183            | Ford Motor Credit Co. LLC<br>3,250 % fällig am 15.09.2025                        | €   | 6.700          | 7.329            |
| Oracle Corp.<br>5,500 % fällig am 03.08.2035                             |     | 7.000          | 6.999            | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale<br>1,375 % fällig am 20.01.2031       | \$  | 7.700          | 6.539            |
| Hungary Government International Bond<br>4,875 % fällig am 22.03.2040    | €   | 6.260          | 6.485            | Region Wallonne Belgium<br>3,500 % fällig am 15.03.2043                          | €   | 5.800          | 5.929            |
| ING Groep NV<br>5,525 % fällig am 25.03.2036                             | \$  | 6.500          | 6.477            | PNC Financial Services Group, Inc.<br>4,758 % fällig am 26.01.2027               | \$  | 5.880          | 5.882            |
| TDC Net A/S<br>5,000 % fällig am 09.08.2032                              | €   | 5.600          | 6.328            | Bank of America Corp.<br>6,204 % fällig am 10.11.2028                            |     | 5.360          | 5.538            |
| Oglethorpe Power Corp.<br>5,900 % fällig am 01.02.2055                   | \$  | 6.200          | 6.268            | U.S. Treasury Bonds<br>4,000 % fällig am 15.11.2042                              |     | 6.000          | 5.486            |
| Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2045      | ¥   | 808.000        | 5.741            | Action Logement Services<br>3,625 % fällig am 25.05.2043                         | €   | 5.000          | 5.481            |

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 31.196.668      | \$ 311.067        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 32.814.247      | \$ 327.200        |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | PARI<br>(000\$) |                   |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,750 % fällig am 15.01.2028 (b) | \$ 76.944       | 77.858            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,875 % fällig am 15.07.2034 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 59.298       | 59.029            |
| United Kingdom Gilt<br>4,375 % fällig am 07.03.2030                              | £ 57.900        | 73.712            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 58.492          | 58.367            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2029 (b) | \$ 65.830       | 66.139            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 29.096          | 29.050            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.04.2030 (b) | 49.209          | 49.046            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.01.2035 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 27.863          | 28.210            |
| United Kingdom Gilt<br>4,250 % fällig am 07.12.2027                              | £ 36.100        | 45.186            | United Kingdom Gilt<br>4,750 % fällig am 07.12.2027                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | £ 19.100        | 24.846            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,250 % fällig am 15.04.2028 (b) | \$ 43.836       | 43.854            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,375 % fällig am 15.07.2033 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 23.395       | 22.533            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,250 % fällig am 15.07.2029 (b) | 43.529          | 41.657            | United Kingdom Gilt<br>4,750 % fällig am 07.12.2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | £ 14.500        | 18.037            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | 40.564          | 39.804            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 15.992       | 15.389            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,875 % fällig am 15.01.2031 (b) | 35.552          | 34.717            | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,864 % fällig am 15.10.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | € 8.600         | 9.938             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.01.2030 (b) | 35.014          | 32.624            | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau<br>3,125 % fällig am 10.10.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 7.600           | 8.294             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,875 % fällig am 15.07.2034 (b) | 29.619          | 29.508            | United Kingdom Gilt<br>4,500 % fällig am 07.06.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | £ 5.200         | 6.530             |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.06.2052                                       | 31.917          | 28.835            | Nykredit Realkredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.10.2056                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | DKK 18.367      | 1.991             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.01.2035 (b) | 27.742          | 27.667            | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | MXN 21.771      | 1.004             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.01.2031 (b) | 29.611          | 27.047            | Realkredit Danmark A/S<br>1,000 % fällig am 01.10.2056                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | DKK 8.474       | 917               |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>3,100 % fällig am 15.09.2026                | € 18.618        | 22.115            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.02.2041                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | \$ 871          | 842               |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro<br>1,300 % fällig am 15.05.2028                | 19.046          | 22.103            | Nykredit Realkredit A/S<br>4,000 % fällig am 01.10.2056                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | DKK 6.000       | 826               |
| United Kingdom Gilt<br>0,125 % fällig am 10.08.2028                              | £ 12.000        | 15.976            | (a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                 |                   |
| France Government International Bond<br>0,100 % fällig am 01.03.2029             | € 13.250        | 14.790            | (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                 |                   |
| France Government International Bond<br>1,850 % fällig am 25.07.2027             | 12.421          | 14.703            | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                 |                   |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | \$ 13.413       | 13.402            | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |                 |                   |



| BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                        |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                     |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 70.556.551     | \$ 703.561       | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 67.742.647     | \$ 675.500       |
|                                                                           | PARI<br>(000S) |                  |                                                                           | PARI<br>(000S) |                  |
| United Kingdom Gilt                                                       |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
| 4,375 % fällig am 07.03.2030                                              | £ 72.000       | 92.810           | 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)                                          | \$ 94.752      | 93.744           |
| Ginnie Mae                                                                |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
| 3,500 % fällig am 20.06.2052                                              | \$ 65.135      | 58.845           | 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)                                          | 63.521         | 57.325           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
| 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)                                          | 35.928         | 35.557           | 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)                                          | 53.318         | 52.887           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                          |                |                  |
| 2,125 % fällig am 15.01.2035 (b)                                          | 31.491         | 31.161           | 6,000 % fällig am 01.03.2054                                              | 35.339         | 35.597           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  | United Kingdom Gilt                                                       |                |                  |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)                                          | 26.658         | 26.446           | 0,125 % fällig am 10.08.2031                                              | £ 20.170       | 25.667           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                         |                |                  |
| 1,625 % fällig am 15.10.2029 (b)                                          | 22.759         | 22.495           | 3,864 % fällig am 15.10.2028                                              | € 20.100       | 23.419           |
| France Government International Bond                                      |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                         |                |                  |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028                                              | € 18.083       | 20.066           | 0,250 % fällig am 01.02.2029                                              | 20.200         | 23.311           |
| United Kingdom Gilt                                                       |                |                  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                                           |                |                  |
| 1,250 % fällig am 22.11.2054                                              | £ 17.917       | 19.223           | 3,125 % fällig am 10.10.2028                                              | 21.300         | 22.941           |
| United Kingdom Gilt                                                       |                |                  | Bundesrepublik Deutschland                                                |                |                  |
| 4,750 % fällig am 22.10.2043                                              | 13.500         | 17.287           | 2,600 % fällig am 15.08.2033                                              | 20.700         | 22.909           |
| Europäische Investitionsbank                                              |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
| 2,250 % fällig am 14.08.2028                                              | € 14.700       | 16.484           | 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)                                          | \$ 22.339      | 22.342           |
| United Kingdom Gilt                                                       |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
| 0,125 % fällig am 10.08.2031                                              | £ 13.576       | 15.894           | 0,250 % fällig am 15.07.2029 (b)                                          | 22.560         | 21.589           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
| 1,750 % fällig am 15.01.2034 (b)                                          | \$ 15.506      | 15.434           | 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)                                          | 21.052         | 21.097           |
| France Government International Bond                                      |                |                  | United Kingdom Gilt                                                       |                |                  |
| 0,950 % fällig am 25.07.2043                                              | € 14.543       | 13.921           | 4,125 % fällig am 22.07.2030                                              | £ 4.993        | 20.645           |
| United Kingdom Gilt                                                       |                |                  | France Government International Bond                                      |                |                  |
| 4,250 % fällig am 07.12.2055                                              | £ 12.000       | 13.239           | 0,100 % fällig am 01.03.2026                                              | € 18.359       | 20.376           |
| Saudi Arabia Government International Bond                                |                |                  | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro                                         |                |                  |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028                                              | \$ 12.600      | 12.582           | 1,300 % fällig am 15.05.2028                                              | 17.384         | 20.092           |
| RevoCar S.A., Compartment                                                 |                |                  | Ginnie Mae                                                                |                |                  |
| 2,411 % fällig am 25.03.2038                                              | € 9.500        | 10.314           | 3,500 % fällig am 20.06.2052                                              | \$ 20.826      | 18.604           |
| Treasury Corp. of Victoria                                                |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
| 4,250 % fällig am 20.12.2032                                              | AUD 17.000     | 10.244           | 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b)                                          | 18.255         | 18.418           |
| United Kingdom Gilt                                                       |                |                  | Europäische Union                                                         |                |                  |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040                                              | £ 8.921        | 10.109           | 3,000 % fällig am 04.12.2034                                              | € 15.600       | 17.953           |
| Hadrian Funding PLC                                                       |                |                  | France Government International Bond                                      |                |                  |
| 0,000 % fällig am 20.05.2072                                              | 7.200          | 9.807            | 1,800 % fällig am 25.07.2040                                              | 15.778         | 17.558           |
|                                                                           |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
|                                                                           |                |                  | 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)                                          | \$ 17.357      | 17.483           |
|                                                                           |                |                  | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau                                           |                |                  |
|                                                                           |                |                  | 0,000 % fällig am 31.03.2027                                              | € 15.300       | 16.524           |
|                                                                           |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                |                  |
|                                                                           |                |                  | 2,125 % fällig am 15.02.2041 (b)                                          | \$ 16.424      | 15.894           |

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 652.669.166     | \$ 6.507.597      | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 627.080.718     | \$ 6.252.490      |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.12.2054                 | \$ 1.303.009    | 1.281.930         | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.12.2054                 | \$ 1.303.009    | 1.249.056         |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.01.2055                 | 910.812         | 896.079           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | 1.249.541       | 1.248.718         |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.11.2054                 | 516.850         | 508.492           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.01.2055                 | 910.812         | 873.099           |
| Gaci First Investment Co.<br>5,250 % fällig am 29.01.2030                        | 384.000         | 381.669           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,500 % fällig am 01.01.2054                 | 795.329         | 814.715           |
| U.S. Treasury Notes<br>3,375 % fällig am 15.09.2027                              | 375.000         | 366.504           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>7,000 % fällig am 01.12.2053                 | 628.718         | 656.465           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2026 (b) | 346.981         | 342.808           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.11.2054                 | 516.850         | 495.449           |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028       | 327.200         | 326.722           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>7,000 % fällig am 01.02.2054                 | 398.594         | 416.214           |
| U.S. Treasury Notes<br>4,250 % fällig am 15.01.2028                              | 300.000         | 303.609           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | 343.541         | 344.313           |
| U.S. Treasury Notes<br>4,250 % fällig am 15.02.2028                              | 250.000         | 253.135           | U.S. Treasury STRIPS<br>0,000 % fällig am 15.02.2027                             | 350.000         | 320.851           |
| Republic of Panama<br>4,804 % fällig am 01.04.2027                               | € 233.400       | 252.282           | Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028       | 281.500         | 284.964           |
| U.S. Treasury Notes<br>2,625 % fällig am 31.01.2026                              | \$ 250.000      | 247.549           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.12.2053                 | 240.135         | 246.634           |
| Egypt Government International Bond<br>21,954 % fällig am 04.03.2028             | EGP 12.282.700  | 233.026           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>7,000 % fällig am 01.01.2054                 | 220.634         | 230.465           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>7,000 % fällig am 01.01.2054                 | \$ 210.979      | 219.880           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.07.2053                 | 223.677         | 224.656           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>7,000 % fällig am 01.12.2053                 | 210.979         | 219.880           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>7,000 % fällig am 01.01.2054                 | 201.938         | 211.530           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.07.2026 (b) | 202.611         | 200.587           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.07.2054                 | 171.441         | 172.914           |
| U.S. Treasury Notes<br>4,375 % fällig am 31.07.2026                              | 200.000         | 200.547           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.11.2054                 | 174.882         | 167.640           |
| Poland Government International Bond<br>4,875 % fällig am 12.02.2030             | 184.100         | 183.133           | Saudi Arabia Government International Bond<br>5,625 % fällig am 13.01.2035       | 163.700         | 166.953           |
| SRC Sukuk Ltd.<br>5,000 % fällig am 27.02.2028                                   | 182.900         | 182.558           | Saudi Arabia Government International Bond<br>5,375 % fällig am 13.01.2031       | 163.700         | 165.601           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.11.2054                 | 174.882         | 171.753           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>7,000 % fällig am 01.03.2054                 | 151.991         | 158.498           |

(a) Der Income Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund II

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                               | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)  | 10.438.098     | \$ 104.076       | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 8.404.637      | \$ 83.800        |
|                                                                            | PARI<br>(000S) |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | PARI<br>(000S) |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.03.2055           | \$ 9.131       | 9.241            | U.S. Treasury Notes<br>4,500 % fällig am 31.03.2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | \$ 11.400      | 11.448           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.11.2054           | 9.431          | 9.174            | U.S. Treasury Notes<br>4,500 % fällig am 15.04.2027                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 11.000         | 11.128           |
| DB Master Finance LLC<br>4,021 % fällig am 15.05.2049                      | 3.213          | 3.175            | U.S. Treasury Notes<br>3,125 % fällig am 15.08.2025                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 7.500          | 7.471            |
| Edison International<br>6,250 % fällig am 15.03.2030                       | 3.000          | 2.965            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.02.2054                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 5.953          | 6.002            |
| Cairn CLO DAC<br>3,729 % fällig am 15.10.2031                              | € 2.800        | 2.922            | Mexico Government International Bond<br>7,101 % fällig am 03.09.2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | MXN 30.000     | 1.526            |
| Wingstop Funding LLC<br>2,841 % fällig am 05.12.2050                       | \$ 2.266       | 2.118            | Barclays PLC<br>4,347 % fällig am 08.05.2035                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | € 1.100        | 1.190            |
| Peru Government International Bond<br>6,150 % fällig am 12.08.2032         | PEN 6.800      | 1.843            | AI Silk Midco Ltd.<br>8,101 % fällig am 04.03.2031                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 1.000          | 1.039            |
| South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031 | ZAR 35.900     | 1.710            | Credit Agricole S.A.<br>6,500 % fällig am 23.09.2029                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 800            | 947              |
| Taco Bell Funding LLC<br>2,542 % fällig am 25.08.2051                      | \$ 1.936       | 1.636            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.08.2053                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 496         | 500              |
| CVC Cordatus Opportunity Loan Fund DAC<br>3,683 % fällig am 15.08.2033     | € 1.500        | 1.629            | Deutsche Bank AG<br>3,742 % fällig am 07.01.2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 200            | 174              |
| Gaci First Investment Co.<br>5,250 % fällig am 29.01.2030                  | \$ 1.600       | 1.590            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 122            | 123              |
| Domino's Pizza Master Issuer LLC<br>3,151 % fällig am 25.04.2051           | 1.741          | 1.533            | (a) Der Income Fund II legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                |                  |
| New York City, New York, General Obligation<br>Bonds, Series 2025          | 1.530          | 1.530            | (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                |                  |
| DB Master Finance LLC<br>2,791 % fällig am 20.11.2051                      | 1.645          | 1.406            | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                |                  |
| Taco Bell Funding LLC<br>1,946 % fällig am 25.08.2051                      | 1.474          | 1.393            | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |                |                  |
| Fair Oaks Loan Funding DAC<br>3,929 % fällig am 15.04.2034                 | € 1.200        | 1.253            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Barclays PLC<br>3,941 % fällig am 31.01.2036                               | 1.100          | 1.143            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Bayer U.S. Finance LLC<br>6,375 % fällig am 21.11.2030                     | \$ 1.000       | 1.040            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Credit Agricole S.A.<br>7,250 % fällig am 23.09.2028                       | € 800          | 966              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |

| BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 4.875.394       | \$ 48.614         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 4.863.913       | \$ 48.500         |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.06.2055                                       | \$ 9.899        | 8.839             | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2027 (b) | \$ 11.534       | 11.685            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2026     | 8.661           | 8.523             | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2026 (b) | 11.441          | 11.262            |
| France Government International Bond<br>0,100 % fällig am 01.03.2028             | € 5.606         | 6.263             | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,875 % fällig am 15.07.2034 (b) | 10.874          | 10.906            |
|                                                                                  | AKTIEN          |                   | Spain Government International Bond<br>0,650 % fällig am 30.11.2027              | € 8.119         | 9.292             |
| Invesco Physical Gold ETC                                                        | 20.570          | 5.883             |                                                                                  | AKTIEN          |                   |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   | Invesco Physical Gold ETC                                                        | 16.410          | 4.858             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2027 (b) | \$ 5.767        | 5.844             |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,875 % fällig am 15.07.2034 (b) | 5.435           | 5.453             | Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.05.2052                                       | \$ 4.026        | 3.606             |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.05.2052                                       | 6.000           | 5.443             | United Kingdom Gilt<br>0,750 % fällig am 22.11.2047                              | £ 1.887         | 1.914             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,625 % fällig am 15.10.2029 (b) | 4.046           | 3.999             | United Kingdom Gilt<br>0,125 % fällig am 10.08.2048                              | 1.932           | 1.626             |
| United Kingdom Gilt<br>1,875 % fällig am 22.09.2049                              | £ 2.700         | 3.396             |                                                                                  | AKTIEN          |                   |
| France Government International Bond<br>0,700 % fällig am 25.07.2030             | € 1.659         | 1.892             | iShares Physical Gold ETC                                                        | 27.470          | 1.498             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.01.2035 (b) | \$ 1.752        | 1.780             |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.02.2055                                       | 1.500           | 1.342             | One Market Plaza Trust<br>3,614 % fällig am 10.02.2032                           | \$ 1.461        | 1.382             |
| France Government International Bond<br>0,100 % fällig am 25.07.2031             | € 607           | 663               | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.07.2031 (b) | 1.298           | 1.182             |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,375 % fällig am 15.02.2055 (b) | \$ 507          | 477               | Spain Government International Bond<br>0,700 % fällig am 30.11.2033              | € 875           | 962               |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.10.2054                                       | 500             | 454               | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.01.2035 (b) | \$ 746          | 759               |
| United Kingdom Gilt<br>1,250 % fällig am 22.11.2054                              | £ 210           | 224               |                                                                                  | AKTIEN          |                   |
| United Kingdom Gilt<br>0,625 % fällig am 22.03.2045                              | 218             | 222               | Invesco Physical Gold ETC                                                        | 2.085           | 575               |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,750 % fällig am 15.02.2042 (b) | \$ 282          | 215               |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
|                                                                                  | AKTIEN          |                   | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.02.2041 (b) | \$ 435          | 420               |
| Iron Mountain, Inc.                                                              | 1.600           | 149               |                                                                                  | AKTIEN          |                   |
|                                                                                  |                 |                   | Prologis, Inc.                                                                   | 2.851           | 351               |
|                                                                                  |                 |                   | Welltower, Inc.                                                                  | 2.302           | 328               |
|                                                                                  |                 |                   | Simon Property Group, Inc.                                                       | 1.700           | 308               |
|                                                                                  |                 |                   | Equinix, Inc.                                                                    | 316             | 287               |

(a) Der Inflation Multi-Asset Fund legt in Anteilen eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 4.880.269       | \$ 48.658         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 3.670.695       | \$ 36.600         |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | PARI<br>(000\$) |                   |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.04.2055                 | \$ 3.623        | 3.725             | U.S. Treasury Notes<br>4,875 % fällig am 30.04.2026                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | \$ 4.600        | 4.630             |
| Freddie Mac<br>5,245 % fällig am 25.11.2054                                      | 2.750           | 2.750             | Mars, Inc.<br>4,600 % fällig am 01.03.2028                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 400             | 402               |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>5,074 % fällig am 20.04.2051                  | £ 1.900         | 2.326             | (a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                 |                   |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028       | \$ 2.300        | 2.297             | (b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                 |                   |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,937 % fällig am 23.04.2028                        | 2.200           | 2.200             | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                 |                   |
| Fannie Mae<br>5,805 % fällig am 25.12.2054                                       | 2.125           | 2.132             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Bank of America Corp.<br>4,623 % fällig am 09.05.2029                            | 1.900           | 1.900             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Philip Morris International, Inc.<br>4,125 % fällig am 28.04.2028                | 1.900           | 1.894             | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |                 |                   |
| Athene Global Funding<br>5,097 % fällig am 16.07.2026                            | 1.800           | 1.800             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.<br>0,000 % fällig am 22.04.2035                     | 1.800           | 1.800             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Freddie Mac<br>5,705 % fällig am 25.03.2055                                      | 1.740           | 1.740             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Carlyle Euro CLO DAC<br>0,000 % fällig am 15.08.2038                             | € 1.500         | 1.703             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,170 % fällig am 15.10.2034          | 1.600           | 1.655             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Fannie Mae<br>5,402 % fällig am 25.07.2055                                       | \$ 1.600        | 1.600             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Freddie Mac<br>5,404 % fällig am 25.07.2055                                      | 1.600           | 1.600             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,203 % fällig am 15.02.2035          | € 1.400         | 1.579             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Fannie Mae<br>5,465 % fällig am 25.03.2055                                       | \$ 1.500        | 1.500             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>4,950 % fällig am 25.03.2027          | 1.500           | 1.499             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Mercedes-Benz Finance North America LLC<br>4,750 % fällig am 31.03.2028          | 1.500           | 1.499             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Fannie Mae<br>2,000 % fällig am 25.11.2046                                       | 1.429           | 1.305             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Volkswagen Group of America Finance LLC<br>5,050 % fällig am 27.03.2028          | 1.300           | 1.300             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| International Business Machines Corp.<br>4,650 % fällig am 10.02.2028            | 1.300           | 1.300             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Freddie Mac<br>5,255 % fällig am 25.03.2055                                      | 1.250           | 1.251             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Freddie Mac<br>5,455 % fällig am 25.03.2055                                      | 1.229           | 1.229             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,625 % fällig am 15.07.2032 (b) | 1.320           | 1.210             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |
| Morgan Stanley Bank N.A.<br>5,016 % fällig am 12.01.2029                         | 1.200           | 1.200             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                 |                   |

| BESCHREIBUNG                                                                        | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|---------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                  |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                     |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)           | 3.419.575       | \$ 34.100         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 8.702.076       | \$ 86.777         |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (a) | 2.083.333       | 21.000            |                                                                           | PARI<br>(000\$) |                   |
|                                                                                     | PARI<br>(000\$) |                   | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                 |                   |
| Province of Ontario                                                                 |                 |                   | 3,875 % fällig am 15.04.2029 (b)                                          | \$ 42.746       | 46.168            |
| 1,550 % fällig am 01.11.2029                                                        | CAD 18.600      | 12.140            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                              |                 |                   |
| Saudi Arabia Government International Bond                                          |                 |                   | 2,125 % fällig am 15.04.2029 (b)                                          | 10.265          | 10.496            |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028                                                        | \$ 10.600       | 10.585            | United Kingdom Gilt                                                       |                 |                   |
| Woodside Finance Ltd.                                                               |                 |                   | 0,500 % fällig am 31.01.2029                                              | £ 7.800         | 8.792             |
| 5,400 % fällig am 19.05.2030                                                        | 4.400           | 4.387             | United Kingdom Gilt                                                       |                 |                   |
| Citigroup, Inc.                                                                     |                 |                   | 1,625 % fällig am 22.10.2028                                              | 7.200           | 8.533             |
| 4,412 % fällig am 31.03.2031                                                        | 4.300           | 4.184             | Credit Agricole S.A.                                                      |                 |                   |
| GA Global Funding Trust                                                             |                 |                   | 3,125 % fällig am 26.01.2029                                              | € 3.400         | 3.890             |
| 5,400 % fällig am 13.01.2030                                                        | 3.800           | 3.794             | Cheniere Energy Partners LP                                               |                 |                   |
| Pacific Gas & Electric Co.                                                          |                 |                   | 4,500 % fällig am 01.10.2029                                              | \$ 3.700        | 3.602             |
| 5,000 % fällig am 04.06.2028                                                        | 3.700           | 3.694             | NGPL PipeCo LLC                                                           |                 |                   |
| Commerzbank AG                                                                      |                 |                   | 4,875 % fällig am 15.08.2027                                              | 3.170           | 3.135             |
| 2,500 % fällig am 25.02.2028                                                        | € 3.000         | 3.140             | IMCD NV                                                                   |                 |                   |
| REWE International Finance BV                                                       |                 |                   | 2,125 % fällig am 31.03.2027                                              | € 2.700         | 3.036             |
| 2,750 % fällig am 03.07.2028                                                        | 2.600           | 3.039             | Enel Finance International NV                                             |                 |                   |
| Edenred SE                                                                          |                 |                   | 3,125 % fällig am 26.06.2029                                              | \$ 3.000        | 3.011             |
| 3,250 % fällig am 27.08.2030                                                        | 2.900           | 3.036             | Nissan Motor Acceptance Co. LLC                                           |                 |                   |
| Schaeffler AG                                                                       |                 |                   | 5,300 % fällig am 13.09.2027                                              | 3.000           | 2.974             |
| 4,250 % fällig am 01.04.2028                                                        | 2.600           | 2.808             | ONEOK, Inc.                                                               |                 |                   |
| ConocoPhillips Co.                                                                  |                 |                   | 4,400 % fällig am 15.10.2029                                              | 3.000           | 2.925             |
| 4,700 % fällig am 15.01.2030                                                        | \$ 2.800        | 2.758             | ConocoPhillips Co.                                                        |                 |                   |
| Wessex Water Services Finance PLC                                                   |                 |                   | 4,700 % fällig am 15.01.2030                                              | 2.800           | 2.802             |
| 1,500 % fällig am 17.09.2029                                                        | £ 2.300         | 2.677             | Studio City Co. Ltd.                                                      |                 |                   |
| Vmed O2 UK Financing PLC                                                            |                 |                   | 3,900 % fällig am 15.02.2027                                              | 2.700           | 2.711             |
| 5,625 % fällig am 15.04.2032                                                        | € 2.200         | 2.614             | Venture Global LNG, Inc.                                                  |                 |                   |
| GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.                                                          |                 |                   | 8,125 % fällig am 01.06.2028                                              | 2.550           | 2.568             |
| 4,742 % fällig am 03.06.2030                                                        | AUD 4.000       | 2.577             | American Tower Corp.                                                      |                 |                   |
| Pacific Life Global Funding                                                         |                 |                   | 3,900 % fällig am 16.05.2030                                              | € 2.100         | 2.477             |
| 4,850 % fällig am 10.02.2030                                                        | \$ 2.500        | 2.507             | Medtronic, Inc.                                                           |                 |                   |
| VMware LLC                                                                          |                 |                   | 3,650 % fällig am 15.10.2029                                              | 2.100           | 2.475             |
| 1,400 % fällig am 15.08.2026                                                        | 2.600           | 2.485             | Elevance Health, Inc.                                                     |                 |                   |
| BNP Paribas S.A.                                                                    |                 |                   | 5,150 % fällig am 15.06.2029                                              | \$ 2.400        | 2.437             |
| 2,591 % fällig am 20.01.2028                                                        | 2.600           | 2.484             | Schaeffler AG                                                             |                 |                   |
| Southern Co.                                                                        |                 |                   | 4,500 % fällig am 14.08.2026                                              | € 2.300         | 2.429             |
| 4,000 % fällig am 15.01.2051                                                        | 2.500           | 2.466             | Argenta Spaarbank NV                                                      |                 |                   |
|                                                                                     |                 |                   | 2,500 % fällig am 25.10.2027                                              | 2.300           | 2.361             |

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



| BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                                          | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                 |                   | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                 |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 60.071.855      | \$ 598.930        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                             | 59.783.834      | \$ 596.086        |
|                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                                       | PARI<br>(000\$) |                   |
| Elstree Funding<br>4,943 % fällig am 21.01.2065                                  | £ 16.900        | 21.895            | Red & Black Auto Italy SRL<br>3,673 % fällig am 28.07.2036                                            | € 27.028        | 30.076            |
| Mars, Inc.<br>4,600 % fällig am 01.03.2028                                       | \$ 18.500       | 18.500            | Asset-Backed European Securitisation<br>Transaction Twenty-Three SARL<br>3,425 % fällig am 21.03.2034 | 25.629          | 27.987            |
| Israel Government International Bond<br>5,375 % fällig am 19.02.2030             | 18.200          | 18.045            | Auto ABS Spanish Loans<br>3,713 % fällig am 28.09.2038                                                | 24.058          | 26.225            |
| Athene Global Funding<br>3,534 % fällig am 23.02.2027                            | € 15.700        | 17.112            | Hill FL BV<br>3,803 % fällig am 18.10.2032                                                            | 22.800          | 25.766            |
| Koromo Italy Compartment<br>2,614 % fällig am 26.02.2032                         | 16.600          | 17.100            | Dilosk RMBS DAC<br>3,522 % fällig am 24.09.2060                                                       | 20.841          | 22.633            |
| KazMunayGas National Co. JSC<br>4,750 % fällig am 19.04.2027                     | \$ 17.000       | 16.867            | Elstree Funding<br>4,943 % fällig am 21.01.2065                                                       | £ 16.900        | 21.478            |
| Latitude Australia Personal Loans Series<br>4,721 % fällig am 17.09.2033         | AUD 26.300      | 16.568            | Jubilee Place BV<br>3,643 % fällig am 17.09.2060                                                      | € 18.705        | 20.379            |
| Gaci First Investment Co.<br>5,250 % fällig am 29.01.2030                        | \$ 16.300       | 16.201            | London Wall Mortgage Capital PLC<br>5,718 % fällig am 15.05.2057                                      | £ 15.667        | 19.972            |
| Galderma Finance Europe BV<br>3,500 % fällig am 26.03.2030                       | € 14.500        | 15.755            | Israel Government International Bond<br>5,000 % fällig am 30.10.2026                                  | € 16.500        | 19.426            |
| Barings Euro CLO DAC<br>4,139 % fällig am 15.10.2034                             | 15.000          | 15.613            | Tower Bridge Funding PLC<br>5,894 % fällig am 20.01.2066                                              | £ 14.934        | 19.051            |
| SRC Sukuk Ltd.<br>5,000 % fällig am 27.02.2028                                   | \$ 15.600       | 15.571            | Mars, Inc.<br>4,600 % fällig am 01.03.2028                                                            | \$ 18.500       | 18.561            |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2026 (b) | 15.725          | 15.539            | Sabadell Consumo FT<br>3,595 % fällig am 22.10.2035                                                   | € 16.020        | 17.453            |
| Taco Bell Funding LLC<br>1,946 % fällig am 25.08.2051                            | 16.408          | 15.507            | Koromo Italy Compartment<br>2,614 % fällig am 26.02.2032                                              | 15.982          | 17.430            |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,170 % fällig am 15.10.2034          | € 14.800        | 15.310            | Golden Bar Securitisation SRL<br>3,669 % fällig am 22.09.2043                                         | 15.297          | 17.361            |
| Poland Government International Bond<br>4,875 % fällig am 12.02.2030             | \$ 15.300       | 15.220            | Mortimer BTL PLC<br>5,897 % fällig am 22.12.2056                                                      | £ 13.511        | 17.282            |
| Romania Government International Bond<br>5,250 % fällig am 10.03.2030            | € 14.700        | 15.136            | Imperial Brands Finance Netherlands BV<br>5,250 % fällig am 15.02.2031                                | € 13.900        | 17.239            |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028       | \$ 14.800       | 14.778            | Gaci First Investment Co.<br>5,250 % fällig am 29.01.2030                                             | \$ 16.300       | 16.503            |
| Golden Bar Securitisation SRL<br>2,747 % fällig am 20.12.2044                    | € 12.700        | 14.551            | Golden Bar Securitisation SRL<br>3,889 % fällig am 22.09.2043                                         | € 14.155        | 16.119            |
| BBVA Consumer Auto<br>3,565 % fällig am 19.03.2038                               | 12.431          | 13.616            | SRC Sukuk Ltd.<br>5,000 % fällig am 27.02.2028                                                        | \$ 15.600       | 15.736            |

(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                 |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|------------------------------------------------------------------------------|-----|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                           |     |                |                  | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                |                  |
| U.S. Treasury Notes<br>4,250 % fällig am 15.11.2034                          | \$  | 40.800         | 39.503           | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating NAV Fund (a)     | 4.282.477      | 42.700           |
|                                                                              |     | AKTIEN         |                  |                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar<br>Short-Term Floating NAV Fund (a) |     | 3.710.676      | 37.000           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,375 % fällig am 15.07.2033 (b) | \$ 42.395      | 39.766           |
|                                                                              |     | PARI<br>(000S) |                  |                                                                                  | AKTIEN         |                  |
| South Africa Government International Bond<br>7,000 % fällig am 28.02.2031   | ZAR | 267.500        | 13.841           | Amazon.com, Inc.                                                                 | 59.600         | 13.311           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.04.2055             | \$  | 6.713          | 6.901            | AT&T, Inc.                                                                       | 566.300        | 12.407           |
| Colombia Government International Bond<br>1,000 % fällig am 28.04.2028       | COP | 29.255.700     | 6.470            | Exxon Mobil Corp.                                                                | 104.500        | 11.652           |
| Japan Government International Bond<br>2,000 % fällig am 20.12.2044          | ¥   | 980.000        | 6.402            | Apple, Inc.                                                                      | 26.700         | 6.351            |
| Japan Government International Bond<br>2,300 % fällig am 20.12.2054          |     | 750.000        | 4.849            |                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |
| Colombia Government International Bond<br>1,000 % fällig am 18.09.2030       | COP | 20.316.400     | 4.305            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,125 % fällig am 15.01.2033 (b) | \$ 5.659       | 5.330            |
| Japan Government International Bond<br>2,200 % fällig am 20.03.2064          | ¥   | 418.000        | 2.404            | Peru Government International Bond<br>6,150 % fällig am 12.08.2032               | PEN 18.800     | 5.106            |
| Cooperatieve Rabobank UA<br>4,875 % fällig am 01.11.2030                     | £   | 1.800          | 2.267            | Mundys SpA<br>1,875 % fällig am 12.02.2028                                       | € 3.900        | 4.064            |
| SRC Sukuk Ltd.<br>5,375 % fällig am 27.02.2035                               | \$  | 2.100          | 2.083            | Virginia Electric & Power Co.<br>3,750 % fällig am 15.05.2027                    | \$ 2.900       | 2.869            |
| Vmed O2 UK Financing PLC<br>5,625 % fällig am 15.04.2032                     | €   | 1.700          | 2.020            | Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,223 % fällig am 01.05.2029                        | 2.500          | 2.476            |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,937 % fällig am 23.04.2028                    | \$  | 2.000          | 2.000            | CTP NV<br>1,500 % fällig am 27.09.2031                                           | € 2.500        | 2.453            |
| Ashtead Capital, Inc.<br>5,950 % fällig am 15.10.2033                        |     | 1.700          | 1.731            | Cooperatieve Rabobank UA<br>4,875 % fällig am 01.11.2030                         | £ 1.800        | 2.351            |
| Palmer Square European Loan Funding DAC<br>3,203 % fällig am 15.02.2035      | €   | 1.500          | 1.692            | American Medical Systems Europe BV<br>1,375 % fällig am 08.03.2028               | € 2.000        | 2.225            |
| IHO Verwaltungs GmbH<br>6,750 % fällig am 15.11.2029                         |     | 1.500          | 1.647            | SRC Sukuk Ltd.<br>5,375 % fällig am 27.02.2035                                   | \$ 2.100       | 2.119            |
| Israel Government International Bond<br>5,625 % fällig am 19.02.2035         | \$  | 1.600          | 1.568            | NE Property BV<br>2,000 % fällig am 20.01.2030                                   | € 2.000        | 2.114            |
| Flora Food Management BV<br>6,875 % fällig am 02.07.2029                     | €   | 1.400          | 1.495            | Enbridge, Inc.<br>5,700 % fällig am 08.03.2033                                   | \$ 2.000       | 2.048            |
| Mexico Government International Bond<br>5,850 % fällig am 02.07.2032         | \$  | 1.300          | 1.299            | Duke Energy Progress LLC<br>5,250 % fällig am 15.03.2033                         | 2.000          | 2.036            |
| BP Capital Markets BV<br>3,360 % fällig am 12.09.2031                        | €   | 1.200          | 1.291            | Goldman Sachs Group, Inc.<br>4,937 % fällig am 23.04.2028                        | 2.000          | 2.008            |
|                                                                              |     |                |                  | South Africa Government International Bond<br>8,000 % fällig am 31.01.2030       | ZAR 40.100     | 1.960            |

(a) Der Low Duration Opportunities Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                               |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                    | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|--------------------------------------------|-----|----------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                |     |                |                  | VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025                                                  |                |                  |
| U.S. Treasury Notes                        |     |                |                  | U.S. Treasury Notes                                                             |                |                  |
| 4,250 % fällig am 15.11.2034               | \$  | 248            | \$ 240           | 5,000 % fällig am 30.09.2025                                                    | \$ 400         | \$ 401           |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.   |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                                    |                |                  |
| 5,699 % fällig am 11.04.2045               |     | 200            | 200              | 1,875 % fällig am 15.07.2034 (a)                                                | 101            | 98               |
| Coöperatieve Rabobank UA                   |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                                    |                |                  |
| 4,875 % fällig am 01.11.2030               | £   | 100            | 126              | 0,625 % fällig am 15.07.2032 (a)                                                | 109            | 98               |
| South Africa Government International Bond |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                                    |                |                  |
| 7,000 % fällig am 28.02.2031               | ZAR | 2.100          | 109              | 1,125 % fällig am 15.01.2033 (a)                                                | 53             | 49               |
| Commerzbank AG                             |     |                |                  | Mars, Inc.                                                                      |                |                  |
| 3,625 % fällig am 14.01.2032               | €   | 100            | 103              | 5,000 % fällig am 01.03.2032                                                    | 10             | 10               |
| Norsk Hydro ASA                            |     |                |                  | (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                  |                |                  |
| 3,625 % fällig am 23.01.2032               |     | 100            | 103              | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % |                |                  |
| Japan Government International Bond        |     |                |                  | der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der               |                |                  |
| 2,200 % fällig am 20.03.2064               | ¥   | 7.000          | 40               | Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe      |                |                  |
| Bank of America Corp.                      |     |                |                  | und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen  |                |                  |
| 4,623 % fällig am 09.05.2029               | \$  | 30             | 30               | getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.               |                |                  |
| Starwood Property Trust, Inc.              |     |                |                  | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können |                |                  |
| 6,500 % fällig am 15.10.2030               |     | 10             | 10               | und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit     |                |                  |
| Public Service Enterprise Group, Inc.      |     |                |                  | gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden,         |                |                  |
| 4,900 % fällig am 15.03.2030               |     | 10             | 10               | wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung          |                |                  |
| Mars, Inc.                                 |     |                |                  | ausgenommen.                                                                    |                |                  |
| 5,000 % fällig am 01.03.2032               |     | 10             | 10               |                                                                                 |                |                  |

| BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | AKTIEN  | ERLÖSE<br>(000\$) |
|---------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                        |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |         |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 1.128.514       | \$ 11.253         | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 982.837 | \$ 9.800          |
| Hess Midstream LP 'A'                                                     | 196.870         | 7.725             | ONEOK, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 59.700  | 5.391             |
| Targa Resources Corp.                                                     | 20.800          | 4.005             | DTE Midstream LLC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 44.300  | 4.551             |
| ONEOK, Inc.                                                               | 28.700          | 2.412             | Cheniere Energy, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 8.100   | 1.849             |
| Enbridge, Inc.                                                            | 38.800          | 1.743             | Williams Cos., Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 29.500  | 1.673             |
| DTE Midstream LLC                                                         | 14.100          | 1.414             | TC Energy Corp.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 21.800  | 1.023             |
| Williams Cos., Inc.                                                       | 22.100          | 1.309             | EQT Corp.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 15.900  | 902               |
| TC Energy Corp.                                                           | 23.500          | 1.133             | Expand Energy Corp.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 6.800   | 790               |
| Expand Energy Corp.                                                       | 9.500           | 982               | Kinder Morgan, Inc.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 27.500  | 758               |
| EQT Corp.                                                                 | 12.400          | 603               | Targa Resources Corp.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 2.200   | 405               |
| Cheniere Energy, Inc.                                                     | 1.800           | 380               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |         |                   |
|                                                                           | PARI<br>(000\$) |                   | (a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.                                                                                                                                                                                                                                                                                |         |                   |
| Tidewater, Inc.<br>9,125 % fällig am 15.07.2030                           | \$ 40           | 40                | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |         |                   |
|                                                                           |                 |                   | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |         |                   |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Mortgage Opportunities Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                       | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|------------------------------------|----------------|------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b> |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                |                  |
| Ginnie Mae                         |                |                  | Ginnie Mae                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                |                  |
| 3,500 % fällig am 20.04.2052       | \$ 201.057     | \$ 181.910       | 3,500 % fällig am 20.04.2052                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | \$ 159.205     | \$ 142.927       |
| Fannie Mae                         |                |                  | Ginnie Mae                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                |                  |
| 5,505 % fällig am 25.12.2053       | 50.000         | 49.938           | 3,500 % fällig am 20.05.2052                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 49.616         | 44.770           |
| Ginnie Mae                         |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                |                  |
| 3,500 % fällig am 20.05.2052       | 53.750         | 48.160           | 6,500 % fällig am 01.06.2054                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 16.341         | 16.637           |
| Ginnie Mae                         |                |                  | Ginnie Mae                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                |                  |
| 3,500 % fällig am 20.06.2052       | 49.000         | 44.333           | 3,500 % fällig am 20.06.2052                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 15.372         | 13.731           |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  | VCL Multi-Compartment S.A.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.04.2055       | 39.864         | 40.481           | 2,389 % fällig am 21.12.2030                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | € 9.139        | 10.295           |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  | Bavarian Sky S.A.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.05.2054       | 31.172         | 31.837           | 2,367 % fällig am 21.02.2033                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 7.700          | 8.665            |
| Freddie Mac                        |                |                  | Uniform Mortgage-Backed Security                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                |                  |
| 5,285 % fällig am 25.02.2055       | 30.000         | 30.000           | 6,500 % fällig am 01.08.2054                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | \$ 6.843       | 6.967            |
| Polaris PLC                        |                |                  | Ginnie Mae                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                |                  |
| 5,044 % fällig am 26.02.2068       | £ 20.000       | 25.035           | 3,500 % fällig am 20.04.2055                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 5.989          | 5.373            |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  | Auburn PLC                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.04.2055       | \$ 21.591      | 22.196           | 5,559 % fällig am 20.07.2045                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | £ 3.225        | 4.248            |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  | Asset-Backed European Securitisation                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.05.2055       | 20.742         | 21.063           | Transaction Twenty-Three SARL                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                |                  |
| Ocean Trails CLO                   |                |                  | 3,425 % fällig am 21.03.2034                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | € 3.098        | 3.524            |
| 5,299 % fällig am 20.07.2034       | 21.000         | 21.000           | Tudor Rose Mortgages                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                |                  |
| MF1 LLC                            |                |                  | 6,977 % fällig am 20.06.2048                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | £ 2.000        | 2.452            |
| 5,635 % fällig am 18.02.2040       | 20.500         | 20.449           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                |                  |
| Ginnie Mae                         |                |                  | 0,125 % fällig am 15.04.2025 (a)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | \$ 1.139       | 1.142            |
| 3,500 % fällig am 20.12.2054       | 22.862         | 20.361           | Uniform Mortgage-Backed Security                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                |                  |
| Freddie Mac                        |                |                  | 3,000 % fällig am 01.02.2052                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 898            | 773              |
| 5,305 % fällig am 25.02.2055       | 20.000         | 20.006           | Freddie Mac                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                |                  |
| Fannie Mae                         |                |                  | 2,500 % fällig am 25.03.2051                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 3.917          | 656              |
| 5,855 % fällig am 25.06.2055       | 20.000         | 19.994           | Structured Asset Investment Loan Trust                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                |                  |
| Fannie Mae                         |                |                  | 5,053 % fällig am 25.04.2036                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 451            | 223              |
| 5,755 % fällig am 25.08.2054       | 18.750         | 18.747           | (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                |                  |
| Ginnie Mae                         |                |                  | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt. |                |                  |
| 3,500 % fällig am 20.04.2055       | 20.000         | 17.897           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.                                                       |                |                  |
| 5,500 % fällig am 01.07.2053       | 17.898         | 17.683           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.01.2055       | 16.973         | 17.395           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| ACREC LLC                          |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,625 % fällig am 18.08.2042       | 17.200         | 17.157           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.02.2055       | 16.000         | 16.044           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Ginnie Mae                         |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,304 % fällig am 20.06.2055       | 15.000         | 15.000           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Towd Point Mortgage Funding PLC    |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,074 % fällig am 20.04.2051       | £ 10.600       | 12.976           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Curzon Mortgages PLC               |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049       | 9.980          | 12.928           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Trinitas CLO Ltd.                  |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,309 % fällig am 20.07.2035       | \$ 12.900      | 12.900           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| MF1 LLC                            |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 6,107 % fällig am 18.02.2040       | 12.930         | 12.898           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Harbour PLC                        |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,332 % fällig am 28.10.2054       | £ 9.936        | 12.847           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Dutch Property Finance BV          |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 3,972 % fällig am 28.04.2062       | € 11.818       | 12.831           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.       |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,299 % fällig am 21.10.2034       | \$ 12.800      | 12.800           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security   |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 6,000 % fällig am 01.10.2054       | 12.328         | 12.615           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| Freddie Mac                        |                |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |
| 5,000 % fällig am 25.11.2053       | 46.895         | 12.508           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                |                  |

| BESCHREIBUNG                                                               | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)  | 134.489.294    | \$ 1.341.000     | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 130.173.776    | \$ 1.298.000     |
|                                                                            | PARI<br>(000S) |                  |                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |
| Citibank N.A.<br>4,576 % fällig am 29.05.2027                              | \$ 39.500      | 39.500           | U.S. Treasury Notes<br>4,375 % fällig am 31.07.2026                              | \$ 452.900     | 455.843          |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>5,074 % fällig am 20.04.2051            | £ 25.451       | 31.156           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.04.2029 (b) | 147.423        | 151.811          |
| Freddie Mac<br>5,245 % fällig am 25.11.2054                                | \$ 25.800      | 25.800           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,500 % fällig am 01.07.2054                 | 132.725        | 134.882          |
| Fannie Mae<br>4,600 % fällig am 01.04.2030                                 | 24.700         | 24.839           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.08.2054                 | 93.500         | 93.122           |
| ABN AMRO Bank NV<br>4,718 % fällig am 22.01.2027                           | 23.800         | 23.800           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.01.2053                 | 65.025         | 66.389           |
| NYSEG Storm Funding LLC<br>4,866 % fällig am 01.05.2032                    | 22.500         | 22.496           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,500 % fällig am 01.08.2054                 | 39.633         | 40.277           |
| Curzon Mortgages PLC<br>5,482 % fällig am 28.07.2049                       | £ 16.434       | 21.288           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.07.2054                 | 31.010         | 31.480           |
| Voya Euro CLO DAC<br>3,249 % fällig am 15.10.2034                          | € 20.000       | 20.864           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.07.2054                 | 30.092         | 30.659           |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028 | \$ 19.100      | 19.072           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.06.2054                 | 30.358         | 30.654           |
| Fannie Mae<br>1,630 % fällig am 01.05.2027                                 | 19.900         | 18.634           | RevoCar S.A., Compartment<br>3,406 % fällig am 25.07.2037                        | € 21.033       | 23.814           |
| Equitable Financial Life Global Funding<br>4,600 % fällig am 01.04.2027    | 17.200         | 17.185           | Cars Alliance Auto Loans France<br>3,395 % fällig am 23.10.2034                  | 20.000         | 22.701           |
| Royal Bank of Canada<br>5,153 % fällig am 04.02.2031                       | 16.900         | 16.900           | NYSEG Storm Funding LLC<br>4,866 % fällig am 01.05.2032                          | \$ 22.500      | 22.545           |
| Bank of America Corp.<br>5,162 % fällig am 24.01.2031                      | 16.800         | 16.800           | Pony S.A., Compartment German Auto Loans<br>3,542 % fällig am 14.11.2032         | € 15.087       | 17.135           |
| Freddie Mac<br>2,862 % fällig am 25.07.2054                                | 15.600         | 14.931           | Pony S.A., Compartment German Auto Loans<br>3,422 % fällig am 14.01.2033         | 12.275         | 13.914           |
| Freddie Mac<br>5,255 % fällig am 25.03.2055                                | 14.400         | 14.414           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,500 % fällig am 01.09.2054                 | \$ 11.678      | 11.656           |
| Bank of Nova Scotia<br>5,130 % fällig am 14.02.2031                        | 14.400         | 14.400           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,500 % fällig am 01.09.2054                 | 11.337         | 11.378           |
| Fannie Mae<br>4,250 % fällig am 01.04.2030                                 | 14.267         | 14.073           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.04.2053                 | 11.317         | 11.114           |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc.<br>5,050 % fällig am 15.03.2030      | 13.000         | 12.997           | Silverstone Master Issuer PLC<br>5,263 % fällig am 21.01.2070                    | £ 7.900        | 10.443           |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.<br>5,269 % fällig am 23.04.2035               | 12.900         | 12.900           | Toronto-Dominion Bank<br>4,814 % fällig am 16.07.2027                            | \$ 10.000      | 10.162           |

(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.



| BESCHREIBUNG                                                                 | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                 | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                           |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                        |                |                  |
| Plenti Auto ABS<br>4,853 % fällig am 12.08.2033                              | AUD 500        | \$ 314           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,500 % fällig am 01.08.2054             | \$ 200         | \$ 206           |
|                                                                              | AKTIEN         |                  |                                                                              | AKTIEN         |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (a) | 21.063         | 210              | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term<br>Floating NAV Fund (a) | 20.058         | 200              |
|                                                                              | PARI<br>(000S) |                  |                                                                              | PARI<br>(000S) |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,500 % fällig am 01.08.2054             | \$ 200         | 205              | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,500 % fällig am 01.10.2054             | \$ 196         | 197              |
| Polaris PLC<br>5,044 % fällig am 26.02.2068                                  | £ 100          | 125              | Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,500 % fällig am 01.09.2052             | 180            | 173              |
| Province of Quebec<br>4,450 % fällig am 01.09.2034                           | CAD 100        | 73               | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.04.2054             | 84             | 85               |
| Canada Government International Bond<br>3,000 % fällig am 01.06.2034         | 100            | 71               | Province of Quebec<br>4,450 % fällig am 01.09.2034                           | CAD 100        | 75               |
| Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033         | 100            | 69               | Canada Government International Bond<br>3,000 % fällig am 01.06.2034         | 100            | 70               |
| Southern California Edison Co.<br>2,950 % fällig am 01.02.2051               | \$ 100         | 60               | Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033         | 100            | 69               |
| Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2055          | ¥ 6.000        | 38               | Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>2,750 % fällig am 09.03.2028              | \$ 50          | 46               |
|                                                                              |                |                  | Mexico Government International Bond<br>8,500 % fällig am 01.03.2029         | MXN 300        | 14               |

(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                               |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 92.405.509     | \$ 921.398       | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 79.346.163     | \$ 791.200       |
|                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.03.2055                 | \$ 37.175      | 35.758           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.11.2054                 | \$ 198.649     | 190.277          |
| Ginnie Mae<br>3,500 % fällig am 20.05.2055                                       | 36.444         | 32.342           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>6,000 % fällig am 01.06.2054                 | 106.914        | 107.507          |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,375 % fällig am 15.07.2033 (b) | 32.317         | 30.045           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.03.2055                 | 37.175         | 35.903           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.09.2054                 | 27.000         | 25.971           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,375 % fällig am 15.07.2033 (b) | 32.313         | 30.062           |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2026 (b) | 17.709         | 17.499           | Romania Government International Bond<br>5,478 % fällig am 27.09.2026            | € 26.000       | 27.604           |
| Angle Asset Finance Radian Trust<br>4,952 % fällig am 16.03.2033                 | AUD 24.000     | 15.464           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.09.2054                 | \$ 27.000      | 26.076           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.03.2055                 | \$ 15.394      | 14.807           | Tower Bridge Funding PLC<br>5,000 % fällig am 20.12.2066                         | £ 19.995       | 26.067           |
| Jubilee Place BV<br>2,724 % fällig am 18.09.2062                                 | € 13.800       | 14.513           | Red & Black Auto Italy SRL<br>3,673 % fällig am 28.07.2036                       | € 20.724       | 22.734           |
| Gaci First Investment Co.<br>5,250 % fällig am 29.01.2030                        | \$ 10.500      | 10.436           | London Wall Mortgage Capital PLC<br>5,478 % fällig am 15.05.2051                 | £ 17.416       | 21.325           |
|                                                                                  | AKTIEN         |                  | BBVA Consumer Auto<br>3,565 % fällig am 19.03.2038                               | € 19.272       | 21.110           |
| Vinci S.A.                                                                       | 71.203         | 9.762            | Sabadell Consumo FT<br>3,595 % fällig am 22.10.2035                              | 17.798         | 19.541           |
|                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  | U.S. Treasury Notes<br>2,875 % fällig am 30.04.2029                              | \$ 17.400      | 16.352           |
| Flexicommercial ABS Trust<br>4,876 % fällig am 14.06.2031                        | AUD 14.000     | 9.053            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.03.2055                 | 15.394         | 14.867           |
| Chile Government International Bond<br>3,750 % fällig am 14.01.2032              | € 8.700        | 8.993            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,500 % fällig am 15.02.2053 (b) | 18.469         | 14.848           |
| SELP Finance SARL<br>3,750 % fällig am 16.01.2032                                | 8.700          | 8.916            |                                                                                  | AKTIEN         |                  |
| Centene Corp.<br>3,375 % fällig am 15.02.2030                                    | \$ 10.000      | 8.872            | AbbVie, Inc.                                                                     | 71.247         | 12.657           |
|                                                                                  | AKTIEN         |                  |                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |
| Host Hotels & Resorts, Inc.                                                      | 568.138        | 8.832            | U.S. Treasury Notes<br>1,250 % fällig am 30.06.2028                              | \$ 14.000      | 12.613           |
|                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  | Chile Government International Bond<br>3,750 % fällig am 14.01.2032              | € 8.700        | 10.053           |
| Credit Agricole S.A.<br>5,862 % fällig am 09.01.2036                             | \$ 8.700       | 8.700            | ABN AMRO Bank NV<br>4,988 % fällig am 03.12.2028                                 | \$ 9.800       | 9.796            |
| Mexico Government International Bond<br>6,875 % fällig am 13.05.2037             | 8.700          | 8.665            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,875 % fällig am 15.02.2047 (b) | 13.271         | 9.688            |
| Commerzbank AG<br>3,625 % fällig am 14.01.2032                                   | € 8.400        | 8.653            |                                                                                  |                |                  |
| Barclays PLC<br>6,224 % fällig am 09.05.2034                                     | \$ 8.400       | 8.600            |                                                                                  |                |                  |

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                               | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)  | 183.698.317    | \$ 1.831.698     | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 189.144.502    | \$ 1.886.000     |
|                                                                            | PARI<br>(000S) |                  |                                                                                  | PARI<br>(000S) |                  |
| United Kingdom Gilt<br>3,750 % fällig am 07.03.2027                        | £ 49.800       | 65.868           | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | \$ 32.021      | 32.093           |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                        | \$ 23.400      | 23.113           | Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033             | CAD 28.200     | 19.763           |
| Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033       | CAD 28.200     | 19.804           | Uniform Mortgage-Backed Security<br>4,810 % fällig am 01.12.2054                 | \$ 16.000      | 15.345           |
| Province of Quebec<br>4,450 % fällig am 01.09.2034                         | 23.900         | 17.500           | Canada Government International Bond<br>3,000 % fällig am 01.06.2034             | CAD 21.500     | 14.909           |
| Uniform Mortgage-Backed Security<br>5,000 % fällig am 01.12.2054           | \$ 16.000      | 15.741           | Nissan Motor Co. Ltd.<br>4,610 % fällig am 17.09.2030                            | \$ 15.600      | 14.443           |
| Peru Government International Bond<br>7,300 % fällig am 12.08.2033         | PEN 52.500     | 14.948           | U.S. Treasury Bonds<br>3,375 % fällig am 15.05.2044                              | 17.000         | 14.007           |
| Canada Government International Bond<br>3,000 % fällig am 01.06.2034       | CAD 21.500     | 14.910           | UBS Group AG<br>6,537 % fällig am 12.08.2033                                     | 13.000         | 13.817           |
| U.S. Treasury Bonds<br>2,250 % fällig am 15.08.2049                        | \$ 22.400      | 14.355           | International Development Association<br>0,750 % fällig am 21.09.2028            | £ 11.000       | 12.537           |
| Japan Government International Bond<br>2,000 % fällig am 20.12.2044        | ¥ 1.830.000    | 11.940           | U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.05.2044                              | \$ 12.000      | 12.101           |
| Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2055        | 1.754.000      | 11.598           | U.S. Treasury Bonds<br>4,375 % fällig am 15.08.2043                              | 11.600         | 11.019           |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>3,375 % fällig am 05.03.2032 | € 9.500        | 9.922            | Province of Quebec<br>3,600 % fällig am 01.09.2033                               | CAD 15.200     | 11.016           |
| Japan Government International Bond<br>2,300 % fällig am 20.12.2054        | ¥ 1.400.000    | 9.031            | Logicor Financing SARL<br>2,000 % fällig am 17.01.2034                           | € 11.600       | 10.873           |
| Universal Music Group NV<br>3,750 % fällig am 30.06.2032                   | € 7.800        | 8.612            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>3,000 % fällig am 01.12.2051                 | \$ 12.022      | 10.136           |
| BMW U.S. Capital LLC<br>4,750 % fällig am 21.03.2028                       | \$ 8.300       | 8.296            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>3,000 % fällig am 01.11.2051                 | 11.901         | 10.034           |
| Mars, Inc.<br>4,800 % fällig am 01.03.2030                                 | 8.100          | 8.091            | U.S. Treasury Bonds<br>3,250 % fällig am 15.05.2042                              | 11.800         | 9.737            |
| Edison International<br>6,250 % fällig am 15.03.2030                       | 8.100          | 8.006            | Uniform Mortgage-Backed Security<br>3,000 % fällig am 01.01.2052                 | 10.996         | 9.271            |
| BGC Group, Inc.<br>6,150 % fällig am 02.04.2030                            | 8.000          | 7.988            | Pacific Gas & Electric Co.<br>6,400 % fällig am 15.06.2033                       | 8.700          | 8.902            |
| Japan Government International Bond<br>2,400 % fällig am 20.03.2045        | ¥ 1.117.400    | 7.942            | Saudi Arabia Government International Bond<br>4,750 % fällig am 16.01.2030       | 8.700          | 8.726            |
| Bayfront Infrastructure Capital Pte Ltd.<br>5,699 % fällig am 11.04.2045   | \$ 7.000       | 7.000            | Bayer U.S. Finance LLC<br>6,500 % fällig am 21.11.2033                           | 8.400          | 8.706            |

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN         | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                        |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                     |                |                  |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 2.108.995      | \$ 21.029        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 2.276.550      | \$ 22.700        |
|                                                                           | PARI<br>(000S) |                  | PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)             | 85.290         | 8.541            |
| Fannie Mae                                                                |                |                  | Apple, Inc.                                                               | 29.800         | 6.634            |
| 5,205 % fällig am 25.09.2054                                              | \$ 3.500       | 3.504            |                                                                           | PARI<br>(000S) |                  |
| Citigroup, Inc.                                                           |                |                  | Greenleaves Capital DAC                                                   | \$ 5.200       | 3.500            |
| 1,122 % fällig am 28.01.2027                                              | 2.400          | 2.316            | 0,000 % fällig am 18.09.2030                                              |                |                  |
| Ginnie Mae                                                                |                |                  | Aries Capital DAC                                                         | 5.200          | 3.500            |
| 5,204 % fällig am 20.06.2055                                              | 1.800          | 1.800            | 0,000 % fällig am 18.09.2030                                              |                |                  |
| Israel Government International Bond                                      |                |                  | Fannie Mae                                                                | 3.422          | 3.413            |
| 5,375 % fällig am 19.02.2030                                              | 1.800          | 1.785            | 5,205 % fällig am 25.09.2054                                              |                |                  |
| Elstree Funding                                                           |                |                  | Mitsubishi HC Capital, Inc.                                               | 2.301          | 2.298            |
| 4,943 % fällig am 21.01.2065                                              | £ 1.400        | 1.763            | 3,637 % fällig am 13.04.2025                                              |                |                  |
| Pacific Gas & Electric Co.                                                |                |                  | Svenska Handelsbanken AB                                                  | 1.900          | 1.903            |
| 3,150 % fällig am 01.01.2026                                              | \$ 1.700       | 1.670            | 5,115 % fällig am 28.05.2027                                              |                |                  |
| Goldman Sachs Group, Inc.                                                 |                |                  | PSP Capital, Inc.                                                         | 1.900          | 1.900            |
| 5,798 % fällig am 10.08.2026                                              | 1.405          | 1.410            | 4,698 % fällig am 03.03.2025                                              |                |                  |
| MPLX LP                                                                   |                |                  | Metropolitan Life Global Funding                                          | AUD 2.900      | 1.862            |
| 1,750 % fällig am 01.03.2026                                              | 1.300          | 1.262            | 4,936 % fällig am 01.12.2025                                              |                |                  |
| Deutsche Bank AG                                                          |                |                  | Cooperatieve Rabobank UA                                                  | \$ 1.800       | 1.807            |
| 2,129 % fällig am 24.11.2026                                              | 1.200          | 1.176            | 5,369 % fällig am 09.01.2026                                              |                |                  |
| ORDE Trust                                                                |                |                  | PNC Bank N.A.                                                             | 1.800          | 1.800            |
| 4,905 % fällig am 11.06.2056                                              | AUD 1.800      | 1.137            | 4,775 % fällig am 15.01.2027                                              |                |                  |
| Barclays PLC                                                              |                |                  | Corebridge Financial, Inc.                                                | 1.800          | 1.798            |
| 5,304 % fällig am 09.08.2026                                              | \$ 1.100       | 1.100            | 3,500 % fällig am 04.04.2025                                              |                |                  |
| American Honda Finance Corp.                                              |                |                  | Bank of Queensland Ltd.                                                   | AUD 2.800      | 1.786            |
| 4,925 % fällig am 21.05.2026                                              | 1.100          | 1.093            | 5,497 % fällig am 14.05.2025                                              |                |                  |
| MUFG Bank Ltd.                                                            |                |                  | VMware LLC                                                                | \$ 1.700       | 1.700            |
| 5,296 % fällig am 17.02.2026                                              | AUD 1.700      | 1.080            | 4,500 % fällig am 15.05.2025                                              |                |                  |
| JPMorgan Chase & Co.                                                      |                |                  | Nomura Holdings, Inc.                                                     | 1.700          | 1.689            |
| 5,171 % fällig am 22.09.2027                                              | \$ 1.046       | 1.038            | 1,851 % fällig am 16.07.2025                                              |                |                  |
| Elevance Health, Inc.                                                     |                |                  | Mizuho Bank Ltd.                                                          | AUD 2.600      | 1.687            |
| 5,350 % fällig am 15.10.2025                                              | 1.000          | 1.004            | 5,310 % fällig am 14.09.2026                                              |                |                  |
| Mercedes-Benz Finance North America LLC                                   |                |                  | Pacific Gas & Electric Co.                                                | \$ 1.700       | 1.677            |
| 5,375 % fällig am 26.11.2025                                              | 1.000          | 1.003            | 3,150 % fällig am 01.01.2026                                              |                |                  |
| Pinnacle West Capital Corp.                                               |                |                  | UBS AG                                                                    | AUD 2.500      | 1.628            |
| 5,250 % fällig am 10.06.2026                                              | 1.000          | 1.001            | 5,717 % fällig am 12.05.2026                                              |                |                  |
| T-Mobile USA, Inc.                                                        |                |                  | Sumitomo Mitsui Banking Corp.                                             | 2.500          | 1.621            |
| 3,500 % fällig am 15.04.2025                                              | 1.000          | 1.000            | 5,515 % fällig am 07.11.2025                                              |                |                  |
| Cox Communications, Inc.                                                  |                |                  | General Motors Financial Co., Inc.                                        | \$ 1.600       | 1.601            |
| 3,350 % fällig am 15.09.2026                                              | 1.000          | 980              | 5,980 % fällig am 07.04.2025                                              |                |                  |
| Freddie Mac                                                               |                |                  | Goldman Sachs Group, Inc.                                                 | 1.500          | 1.504            |
| 5,205 % fällig am 25.09.2054                                              | 900            | 901              | 5,564 % fällig am 10.08.2026                                              |                |                  |
| Fannie Mae                                                                |                |                  | American Honda Finance Corp.                                              | 1.500          | 1.501            |
| 5,402 % fällig am 25.07.2055                                              | 900            | 900              | 5,368 % fällig am 23.04.2025                                              |                |                  |
| Freddie Mac                                                               |                |                  | Goldman Sachs Group, Inc.                                                 | 1.405          | 1.408            |
| 5,255 % fällig am 25.03.2055                                              | 800            | 801              | 5,798 % fällig am 10.08.2026                                              |                |                  |
| Curzon Mortgages PLC                                                      |                |                  | Shinhan Bank Co. Ltd.                                                     | AUD 2.000      | 1.302            |
| 5,482 % fällig am 28.07.2049                                              | £ 599          | 776              | 6,376 % fällig am 16.11.2025                                              |                |                  |
| Canada Government International Bond                                      |                |                  | Amgen, Inc.                                                               | \$ 1.300       | 1.300            |
| 2,750 % fällig am 01.06.2033                                              | CAD 1.100      | 731              | 5,250 % fällig am 02.03.2025                                              |                |                  |
| U.S. Bancorp                                                              |                |                  | Pacific Life Global Funding                                               | 1.200          | 1.203            |
| 5,727 % fällig am 21.10.2026                                              | \$ 700         | 704              | 5,062 % fällig am 04.06.2026                                              |                |                  |
| Goldman Sachs Bank USA                                                    |                |                  | Lloyds Banking Group PLC                                                  | 1.170          | 1.169            |
| 5,173 % fällig am 18.03.2027                                              | 700            | 702              | 3,511 % fällig am 18.03.2026                                              |                |                  |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.                                              |                |                  |                                                                           |                |                  |
| 5,299 % fällig am 21.10.2034                                              | 700            | 700              |                                                                           |                |                  |
| Freddie Mac                                                               |                |                  |                                                                           |                |                  |
| 5,205 % fällig am 25.11.2054                                              | 700            | 699              |                                                                           |                |                  |
| Berry Global, Inc.                                                        |                |                  |                                                                           |                |                  |
| 1,570 % fällig am 15.01.2026                                              | 700            | 678              |                                                                           |                |                  |

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                                           | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                           | AKTIEN         | ERLÖSE<br>(000S) |
|----------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                     |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                  |                |                  |
| United Kingdom Gilt<br>3,750 % fällig am 07.03.2027                                    | £ 12.300       | £ 12.254         | PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity<br>UCITS ETF (a)        | 107.100        | £ 11.039         |
| United Kingdom Gilt<br>1,625 % fällig am 22.10.2054                                    | 20.300         | 9.422            |                                                                        | PARI<br>(000S) |                  |
| United Kingdom Gilt<br>1,500 % fällig am 31.07.2053                                    | 14.900         | 6.971            | United Kingdom Gilt<br>1,625 % fällig am 22.10.2054                    | £ 11.000       | 4.950            |
| Wessex Water Services Finance PLC<br>6,125 % fällig am 19.09.2034                      | 1.500          | 1.481            | United Kingdom Gilt<br>1,500 % fällig am 31.07.2053                    | 6.150          | 2.718            |
| Whitbread Group PLC<br>5,500 % fällig am 31.05.2032                                    | 1.400          | 1.389            | Lloyds Banking Group PLC<br>2,000 % fällig am 12.04.2028               | 2.500          | 2.344            |
| Westfield Stratford City Finance PLC<br>1,642 % fällig am 04.08.2031                   | 1.400          | 1.350            | Barclays PLC<br>5,851 % fällig am 21.03.2035                           | 1.600          | 1.582            |
| Lloyds Banking Group PLC<br>8,500 % fällig am 27.03.2028                               | 1.200          | 1.239            | UBS Group AG<br>7,375 % fällig am 07.09.2033                           | 1.200          | 1.325            |
| J Sainsbury PLC<br>5,125 % fällig am 29.06.2030                                        | 1.200          | 1.198            | JPMorgan Chase & Co.<br>1,895 % fällig am 28.04.2033                   | 1.500          | 1.252            |
| Yorkshire Water Finance PLC<br>5,250 % fällig am 28.04.2030                            | 1.100          | 1.087            | WMG Acquisition Corp.<br>2,250 % fällig am 15.08.2031                  | € 1.600        | 1.232            |
| Slovenia Government International Bond<br>3,500 % fällig am 14.04.2055                 | € 1.300        | 1.069            | BNP Paribas S.A.<br>2,875 % fällig am 24.02.2029                       | £ 1.300        | 1.207            |
| Flora Food Management BV<br>6,875 % fällig am 02.07.2029                               | 1.200          | 1.040            | Aviva PLC<br>6,875 % fällig am 20.05.2058                              | 1.125          | 1.129            |
| Electricite de France S.A.<br>6,000 % fällig am 29.01.2026                             | £ 1.000        | 1.001            | Mercedes-Benz International Finance BV<br>5,625 % fällig am 17.08.2026 | 1.100          | 1.109            |
| Blend Funding PLC<br>5,260 % fällig am 11.06.2032                                      | 1.000          | 1.000            | Northwestern Mutual Global Funding<br>4,880 % fällig am 12.12.2029     | 1.100          | 1.108            |
| National Grid Electricity Distribution South Wales PLC<br>1,625 % fällig am 07.10.2035 | 1.300          | 895              | Slovenia Government International Bond<br>3,500 % fällig am 14.04.2055 | € 1.300        | 1.087            |
| Credit Agricole S.A.<br>5,875 % fällig am 23.03.2035                                   | € 1.000        | 833              | Mexico Government International Bond<br>4,000 % fällig am 24.08.2034   | MXN 29.953     | 1.065            |
| Stepstone Group Midco GmbH<br>0,000 % fällig am 04.12.2031                             | 1.000          | 821              | Flora Food Management BV<br>6,875 % fällig am 02.07.2029               | € 1.200        | 1.050            |
| BMW International Investment BV<br>5,000 % fällig am 24.01.2028                        | £ 800          | 800              | CPUK Finance Ltd.<br>5,940 % fällig am 28.02.2047                      | £ 1.000        | 1.022            |
| RAC Bond Co. PLC<br>5,750 % fällig am 06.05.2046                                       | 800            | 799              | Electricite de France S.A.<br>5,500 % fällig am 27.03.2037             | 1.000          | 943              |
| J Sainsbury PLC<br>5,625 % fällig am 29.01.2035                                        | 800            | 793              | Heathrow Funding Ltd.<br>2,750 % fällig am 13.10.2031                  | 1.000          | 900              |
| Anglian Water Osprey Financing PLC<br>2,000 % fällig am 31.07.2028                     | 900            | 783              | Bureau Veritas S.A.<br>3,125 % fällig am 15.11.2031                    | € 1.000        | 825              |
|                                                                                        |                |                  | Stepstone Group Midco GmbH<br>0,000 % fällig am 04.12.2031             | 1.000          | 821              |

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                               |     | PARI<br>(000S) | KOSTEN<br>(000S) | BESCHREIBUNG                                                                    |    | PARI<br>(000S) | ERLÖSE<br>(000S) |
|--------------------------------------------|-----|----------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------------|----|----------------|------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>         |     |                |                  | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                           |    |                |                  |
| United Kingdom Gilt                        |     |                |                  | United Kingdom Gilt                                                             |    |                |                  |
| 4,375 % fällig am 31.07.2054               | £   | 5.200          | £ 4.511          | 4,375 % fällig am 31.07.2054                                                    | £  | 5.200          | £ 4.501          |
| United Kingdom Gilt                        |     |                |                  | U.S. Treasury Inflation Protected Securities                                    |    |                |                  |
| 4,750 % fällig am 22.10.2043               |     | 3.100          | 2.968            | 2,125 % fällig am 15.04.2029 (a)                                                | \$ | 3.775          | 3.064            |
| United Kingdom Gilt                        |     |                |                  | United Kingdom Gilt                                                             |    |                |                  |
| 4,500 % fällig am 07.03.2035               |     | 2.200          | 2.182            | 4,750 % fällig am 22.10.2043                                                    | £  | 2.400          | 2.285            |
| United Kingdom Gilt                        |     |                |                  | United Kingdom Gilt                                                             |    |                |                  |
| 4,000 % fällig am 22.10.2031               |     | 1.500          | 1.493            | 4,000 % fällig am 22.10.2031                                                    |    | 1.500          | 1.484            |
| Towd Point Mortgage Funding PLC            |     |                |                  | Greene King Finance PLC                                                         |    |                |                  |
| 5,074 % fällig am 20.04.2051               |     | 1.000          | 1.001            | 5,106 % fällig am 15.03.2034                                                    |    | 1.467          | 1.443            |
| Elstree Funding                            |     |                |                  | Tesco Property Finance PLC                                                      |    |                |                  |
| 4,943 % fällig am 21.01.2065               |     | 1.000          | 1.000            | 5,744 % fällig am 13.04.2040                                                    |    | 1.302          | 1.284            |
| Northumbrian Water Finance PLC             |     |                |                  | Electricite de France S.A.                                                      |    |                |                  |
| 5,500 % fällig am 02.10.2037               |     | 1.000          | 944              | 5,500 % fällig am 27.03.2037                                                    |    | 1.300          | 1.223            |
| FCT Ponant                                 |     |                |                  | United Utilities Water Finance PLC                                              |    |                |                  |
| 2,564 % fällig am 27.09.2038               | €   | 1.000          | 833              | 2,000 % fällig am 03.07.2033                                                    |    | 1.600          | 1.219            |
| DWR Cymru Financing UK PLC                 |     |                |                  | United Kingdom Gilt                                                             |    |                |                  |
| 5,750 % fällig am 10.09.2044               | £   | 800            | 771              | 4,500 % fällig am 07.03.2035                                                    |    | 1.200          | 1.191            |
| Athene Global Funding                      |     |                |                  | Verizon Communications, Inc.                                                    |    |                |                  |
| 5,146 % fällig am 01.11.2029               |     | 700            | 700              | 3,375 % fällig am 27.10.2036                                                    |    | 1.300          | 1.056            |
| Nordea Bank Abp                            |     |                |                  | Land Securities Capital Markets PLC                                             |    |                |                  |
| 4,750 % fällig am 25.02.2029               |     | 700            | 700              | 2,625 % fällig am 22.09.2039                                                    |    | 1.373          | 1.033            |
| Koromo Italy Compartment                   |     |                |                  | E.ON International Finance BV                                                   |    |                |                  |
| 2,614 % fällig am 26.02.2032               | €   | 800            | 675              | 6,125 % fällig am 06.07.2039                                                    |    | 1.000          | 1.008            |
| Mitsubishi HC Capital UK PLC               |     |                |                  | Elstree Funding                                                                 |    |                |                  |
| 5,105 % fällig am 27.02.2028               | £   | 600            | 600              | 4,943 % fällig am 21.01.2065                                                    |    | 983            | 984              |
| Nederlandse Waterschapsbank NV             |     |                |                  | HSBC Holdings PLC                                                               |    |                |                  |
| 4,750 % fällig am 31.01.2028               |     | 600            | 600              | 6,000 % fällig am 29.03.2040                                                    |    | 1.000          | 964              |
| Cooperatieve Rabobank UA                   |     |                |                  | Lloyds Bank PLC                                                                 |    |                |                  |
| 4,875 % fällig am 01.11.2030               |     | 600            | 599              | 6,500 % fällig am 17.09.2040                                                    |    | 900            | 951              |
| Province of Quebec                         |     |                |                  | AT&T, Inc.                                                                      |    |                |                  |
| 4,750 % fällig am 22.01.2030               |     | 600            | 598              | 4,250 % fällig am 01.06.2043                                                    |    | 1.200          | 946              |
| Saudi Arabia Government International Bond |     |                |                  | Eramet S.A.                                                                     |    |                |                  |
| 5,125 % fällig am 13.01.2028               | \$  | 700            | 559              | 7,000 % fällig am 22.05.2028                                                    | €  | 1.100          | 941              |
| New South Wales Treasury Corp.             |     |                |                  | Telereal Secured Finance PLC                                                    |    |                |                  |
| 4,750 % fällig am 20.09.2035               | AUD | 1.100          | 529              | 4,010 % fällig am 10.12.2033                                                    | £  | 990            | 939              |
| Deutsche Bank AG                           |     |                |                  | Arbour CLO DAC                                                                  |    |                |                  |
| 5,000 % fällig am 26.02.2029               | £   | 500            | 498              | 4,320 % fällig am 15.11.2037                                                    | €  | 1.100          | 932              |
| J Sainsbury PLC                            |     |                |                  | Towd Point Mortgage Funding PLC                                                 |    |                |                  |
| 5,625 % fällig am 29.01.2035               |     | 500            | 496              | 5,074 % fällig am 20.04.2051                                                    | £  | 920            | 921              |
| Bunzl Finance PLC                          |     |                |                  |                                                                                 |    |                |                  |
| 5,750 % fällig am 18.03.2036               |     | 500            | 495              | (a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.                  |    |                |                  |
| Venture Global LNG, Inc.                   |     |                |                  |                                                                                 |    |                |                  |
| 8,125 % fällig am 01.06.2028               | \$  | 600            | 483              | Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % |    |                |                  |
| British Telecommunications PLC             |     |                |                  | der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der               |    |                |                  |
| 5,750 % fällig am 13.02.2041               | £   | 500            | 480              | Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe      |    |                |                  |
| New York Life Global Funding               |     |                |                  | und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen  |    |                |                  |
| 3,200 % fällig am 15.01.2032               | €   | 500            | 417              | getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.               |    |                |                  |
| ACREC LLC                                  |     |                |                  |                                                                                 |    |                |                  |
| 5,625 % fällig am 18.08.2042               | \$  | 500            | 408              | Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können |    |                |                  |
|                                            |     |                |                  | und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit     |    |                |                  |
|                                            |     |                |                  | gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden,         |    |                |                  |
|                                            |     |                |                  | wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung          |    |                |                  |
|                                            |     |                |                  | ausgenommen.                                                                    |    |                |                  |



# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US High Yield Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                              | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                   | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|---------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                        |                 |                   | <b>VERKAUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                          |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 18.769.375      | \$ 187.166        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)      | 15.764.363      | \$ 157.200        |
|                                                                           | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                | PARI<br>(000\$) |                   |
| Carnival Corp.<br>5,750 % fällig am 15.03.2030                            | \$ 13.350       | 13.337            | Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.<br>8,750 % fällig am 15.04.2030          | \$ 11.200       | 11.368            |
| TransDigm, Inc.<br>6,829 % fällig am 28.02.2031                           | 12.829          | 12.839            | ams-OSRAM AG<br>12,250 % fällig am 30.03.2029                                  | 10.100          | 10.333            |
| B.C. Ltd.<br>10,000 % fällig am 15.04.2032                                | 10.025          | 10.033            | Prime Healthcare Services, Inc.<br>9,375 % fällig am 01.09.2029                | 7.600           | 7.321             |
| Owens & Minor, Inc.<br>10,000 % fällig am 15.04.2030                      | 9.600           | 9.600             |                                                                                | AKTIEN          |                   |
| IQVIA, Inc.<br>6,250 % fällig am 01.06.2032                               | 9.075           | 9.138             | PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a) | 661.211         | 7.214             |
| Albion Financing 1 SARL<br>7,000 % fällig am 21.05.2030                   | 8.725           | 8.725             |                                                                                | PARI<br>(000\$) |                   |
| Opal Bidco S.A.S.<br>6,500 % fällig am 31.03.2032                         | 7.900           | 7.900             | Intelsat Jackson Holdings S.A.<br>6,500 % fällig am 15.03.2030                 | \$ 7.125        | 6.648             |
| Quikrete Holdings, Inc.<br>6,375 % fällig am 01.03.2032                   | 7.675           | 7.727             | Viridien<br>10,000 % fällig am 15.10.2030                                      | 6.925           | 6.525             |
| Hilcorp Energy LP<br>6,875 % fällig am 15.05.2034                         | 8.036           | 7.609             | Carnival Corp.<br>5,750 % fällig am 15.03.2030                                 | 6.275           | 6.213             |
| Snap, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.03.2033                                | 7.200           | 7.276             | Mavis Tire Express Services Topco Corp.<br>6,500 % fällig am 15.05.2029        | 5.725           | 5.559             |
| Viridien<br>10,000 % fällig am 15.10.2030                                 | 7.150           | 7.150             |                                                                                | AKTIEN          |                   |
| Stepstone Group Midco GmbH<br>0,000 % fällig am 04.12.2031                | 6.425           | 6.361             | Intelsat Emergence S.A.                                                        | 152.416         | 5.277             |
| Iron Mountain, Inc.<br>4,875 % fällig am 15.09.2027                       | 6.176           | 6.120             |                                                                                | PARI<br>(000\$) |                   |
| Alumina Pty. Ltd.<br>6,125 % fällig am 15.03.2030                         | 6.100           | 6.100             | DISH Network Corp.<br>11,750 % fällig am 15.11.2027                            | \$ 4.725        | 4.735             |
| Rocket Cos., Inc.<br>6,125 % fällig am 01.08.2030                         | 5.725           | 5.725             | GN Bondco LLC<br>9,500 % fällig am 15.10.2031                                  | 4.575           | 4.685             |
| Level 3 Financing, Inc.<br>6,875 % fällig am 30.06.2033                   | 5.450           | 5.450             | Olympus Water U.S. Holding Corp.<br>5,375 % fällig am 01.10.2029               | € 4.600         | 4.641             |
| Beach Acquisition Bidco LLC<br>10,000 % fällig am 15.07.2033              | 4.475           | 4.475             | Venture Global Calcasieu Pass LLC<br>3,875 % fällig am 15.08.2029              | \$ 5.000        | 4.598             |
| Cleveland-Cliffs, Inc.<br>6,875 % fällig am 01.11.2029                    | 4.375           | 4.293             | Cleveland-Cliffs, Inc.<br>7,000 % fällig am 15.03.2032                         | 4.525           | 4.514             |
| AMC Networks, Inc.<br>4,250 % fällig am 15.02.2029                        | 5.450           | 4.259             | Univision Communications, Inc.<br>8,500 % fällig am 31.07.2031                 | 4.750           | 4.487             |
|                                                                           |                 |                   | Service Properties Trust<br>8,375 % fällig am 15.06.2029                       | 4.525           | 4.468             |
|                                                                           |                 |                   | Embecta Corp.<br>5,000 % fällig am 15.02.2030                                  | 4.875           | 4.433             |
|                                                                           |                 |                   | Royal Caribbean Cruises Ltd.<br>5,500 % fällig am 01.04.2028                   | 4.400           | 4.426             |
|                                                                           |                 |                   | TGP Holdings LLC<br>7,707 % fällig am 29.06.2028                               | 5.296           | 4.418             |

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Investment Grade Corporate Bond Fund

30. Juni 2025

| BESCHREIBUNG                                                                        | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | PARI<br>(000\$) | ERLÖSE<br>(000\$) |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                                  |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (a) | 992.063         | \$ 10.000         | U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                              | \$ 5.595        | \$ 5.499          |
|                                                                                     | PARI<br>(000\$) |                   | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.04.2029 (b) | 5.428           | 5.423             |
| U.S. Treasury Bonds<br>4,625 % fällig am 15.02.2055                                 | \$ 5.595        | 5.573             | U.S. Treasury Bonds<br>2,250 % fällig am 15.08.2049                              | 8.000           | 4.810             |
|                                                                                     | AKTIEN          |                   | U.S. Treasury Bonds<br>3,000 % fällig am 15.02.2048                              | 5.804           | 4.173             |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)           | 350.983         | 3.500             |                                                                                  | AKTIEN          |                   |
|                                                                                     | PARI<br>(000\$) |                   | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 361.893         | 3.609             |
| U.S. Treasury STRIPS<br>0,000 % fällig am 15.08.2049                                | \$ 11.700       | 3.296             |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| U.S. Treasury Notes<br>4,625 % fällig am 15.02.2035                                 | 3.100           | 3.209             | U.S. Treasury Notes<br>4,625 % fällig am 15.02.2035                              | \$ 3.100        | 3.123             |
| NN Group NV<br>5,750 % fällig am 11.09.2034                                         | € 2.000         | 2.106             | Southern Co. Gas Capital Corp.<br>3,250 % fällig am 15.06.2026                   | 2.700           | 2.643             |
| Universal Music Group NV<br>3,750 % fällig am 30.06.2032                            | 1.800           | 1.987             | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>1,500 % fällig am 15.02.2053 (b) | 3.297           | 2.601             |
| U.S. Treasury STRIPS<br>0,000 % fällig am 15.08.2050                                | \$ 6.800        | 1.845             | Pacific Life Global Funding<br>1,375 % fällig am 14.04.2026                      | 2.600           | 2.494             |
| Wessex Water Services Finance PLC<br>6,125 % fällig am 19.09.2034                   | £ 1.200         | 1.536             | TD SYNnex Corp.<br>1,750 % fällig am 09.08.2026                                  | 2.300           | 2.198             |
| Japan Government International Bond<br>2,000 % fällig am 20.12.2044                 | ¥ 230.000       | 1.500             | Equitable Financial Life Global Funding<br>5,500 % fällig am 02.12.2025          | 2.100           | 2.117             |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>5,734 % fällig am 28.01.2056                           | \$ 1.500        | 1.500             | Citigroup, Inc.<br>6,270 % fällig am 17.11.2033                                  | 2.000           | 2.108             |
| TDC Net A/S<br>5,000 % fällig am 09.08.2032                                         | € 1.000         | 1.130             | Apple, Inc.<br>4,850 % fällig am 10.05.2053                                      | 2.100           | 1.944             |
| Marex Group PLC<br>5,829 % fällig am 08.05.2028                                     | \$ 1.100        | 1.100             | Pacific National Finance Pty. Ltd.<br>4,750 % fällig am 22.03.2028               | 1.700           | 1.640             |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028          | 1.100           | 1.098             | Deutsche Bank AG<br>3,375 % fällig am 13.03.2029                                 | € 1.500         | 1.581             |
| UnitedHealth Group, Inc.<br>4,950 % fällig am 15.01.2032                            | 1.062           | 1.066             | Banca Monte dei Paschi di Siena SpA<br>6,750 % fällig am 05.09.2027              | 1.300           | 1.547             |
| DCP Midstream Operating LP<br>5,125 % fällig am 15.05.2029                          | 1.000           | 1.005             | Bristol-Myers Squibb Co.<br>5,200 % fällig am 22.02.2034                         | \$ 1.300        | 1.323             |
| Entergy Texas, Inc.<br>5,250 % fällig am 15.04.2035                                 | 1.000           | 1.002             | Nissan Motor Acceptance Co. LLC<br>2,750 % fällig am 09.03.2028                  | 1.400           | 1.288             |
| Itau Unibanco Holding S.A.<br>6,000 % fällig am 27.02.2030                          | 1.000           | 1.000             | U.S. Bancorp<br>6,787 % fällig am 26.10.2027                                     | 1.250           | 1.286             |
| Pacific Life Global Funding<br>4,955 % fällig am 27.01.2028                         | 1.000           | 1.000             | Schaeffler AG<br>4,750 % fällig am 14.08.2029                                    | € 1.200         | 1.258             |
| Broadcom, Inc.<br>5,200 % fällig am 15.04.2032                                      | 1.000           | 999               |                                                                                  |                 |                   |

(a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG                                                               | AKTIEN          | KOSTEN<br>(000\$) | BESCHREIBUNG                                                                     | AKTIEN          | ERLÖSE<br>(000\$) |
|----------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| <b>KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                         |                 |                   | <b>VERKÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2025</b>                                            |                 |                   |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)  | 43.309.824      | \$ 431.838        | PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)        | 41.430.909      | \$ 413.100        |
|                                                                            | PARI<br>(000\$) |                   |                                                                                  | PARI<br>(000\$) |                   |
| U.S. Treasury Notes<br>4,000 % fällig am 31.05.2030                        | \$ 64.000       | 63.909            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | \$ 34.093       | 34.243            |
| Freddie Mac<br>5,245 % fällig am 25.11.2054                                | 31.300          | 31.300            | U.S. Treasury Notes<br>4,125 % fällig am 31.10.2029                              | 25.300          | 25.075            |
| Fannie Mae<br>4,205 % fällig am 25.09.2054                                 | 24.600          | 24.646            | Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028       | 23.400          | 23.715            |
| Saudi Arabia Government International Bond<br>5,125 % fällig am 13.01.2028 | 23.400          | 23.366            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>2,125 % fällig am 15.04.2029 (b) | 22.747          | 23.101            |
| Aircastle Ltd.<br>4,250 % fällig am 15.06.2026                             | 21.800          | 21.694            | DBS Group Holdings Ltd.<br>4,976 % fällig am 21.03.2028                          | 19.100          | 19.110            |
| Bain Capital Credit CLO Ltd.<br>0,000 % fällig am 22.04.2035               | 21.500          | 21.500            | Cars Alliance Auto Loans Germany<br>3,365 % fällig am 18.01.2036                 | € 18.003        | 18.780            |
| Kommunalbanken A/S<br>4,760 % fällig am 03.03.2028                         | 20.000          | 20.045            | Goldman Sachs Bank USA<br>5,173 % fällig am 13.01.2027                           | \$ 11.847       | 11.874            |
| DBS Group Holdings Ltd.<br>4,976 % fällig am 21.03.2028                    | 19.100          | 19.100            | Nykredit Realkredit A/S<br>1,000 % fällig am 01.04.2025                          | DKK 78.200      | 11.003            |
| Ginnie Mae<br>5,204 % fällig am 20.06.2055                                 | 18.300          | 18.296            | Morgan Stanley Bank N.A.<br>5,306 % fällig am 15.10.2027                         | \$ 10.800       | 10.779            |
| Pinnacle West Capital Corp.<br>5,250 % fällig am 10.06.2026                | 18.000          | 17.974            | Citibank N.A.<br>5,224 % fällig am 06.08.2026                                    | 9.000           | 9.009             |
| Freddie Mac<br>5,255 % fällig am 25.03.2055                                | 17.500          | 17.522            | PNC Bank N.A.<br>4,870 % fällig am 15.01.2027                                    | 9.000           | 9.000             |
| ORDE Trust<br>4,905 % fällig am 11.06.2056                                 | AUD 24.500      | 15.475            | UBS AG<br>5,261 % fällig am 30.07.2025                                           | AUD 13.725      | 8.764             |
| Southern California Edison Co.<br>1,200 % fällig am 01.02.2026             | \$ 15.700       | 15.183            | Wells Fargo & Co.<br>5,133 % fällig am 24.01.2028                                | \$ 7.953        | 7.919             |
| Santander UK Group Holdings PLC<br>6,833 % fällig am 21.11.2026            | 14.800          | 14.960            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.10.2025 (b) | 7.868           | 7.872             |
| BNP Paribas S.A.<br>1,323 % fällig am 13.01.2027                           | 15.100          | 14.641            | Chevron USA, Inc.<br>4,828 % fällig am 26.02.2028                                | 7.300           | 7.320             |
| ABN AMRO Bank NV<br>4,817 % fällig am 24.02.2027                           | £ 11.500        | 14.499            | U.S. Treasury Inflation Protected Securities<br>0,125 % fällig am 15.04.2025 (b) | 7.105           | 7.121             |
| Athene Global Funding<br>5,097 % fällig am 16.07.2026                      | \$ 14.000       | 14.000            | Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.<br>5,364 % fällig am 13.03.2030                  | 7.000           | 7.048             |
| Freddie Mac<br>5,305 % fällig am 25.10.2052                                | 13.500          | 13.496            | Canada Government International Bond<br>2,750 % fällig am 01.06.2033             | CAD 10.400      | 6.909             |
| United Airlines, Inc.<br>4,375 % fällig am 15.04.2026                      | 13.600          | 13.400            | U.S. Treasury Notes<br>4,250 % fällig am 31.01.2030                              | \$ 6.600        | 6.576             |

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteilen eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen)

### Abkürzungen der Kontrahenten:

|            |                                                  |             |                                                    |            |                                        |
|------------|--------------------------------------------------|-------------|----------------------------------------------------|------------|----------------------------------------|
| <b>AZD</b> | Australia and New Zealand Banking Group          | <b>DBL</b>  | Deutsche Bank AG London                            | <b>MYC</b> | Morgan Stanley Capital Services LLC    |
| <b>BAR</b> | Barclays PLC Corporate RRP/REPO trading          | <b>DEU</b>  | Deutsche Bank Securities, Inc.                     | <b>MYI</b> | Morgan Stanley & Co. International PLC |
| <b>BOA</b> | Bank of America N.A.                             | <b>DUB</b>  | Deutsche Bank AG                                   | <b>NOM</b> | Nomura Securities International, Inc.  |
| <b>BOM</b> | Bank of Montreal                                 | <b>FAR</b>  | Wells Fargo Bank National Association              | <b>RBC</b> | Royal Bank of Canada                   |
| <b>BOS</b> | BofA Securities, Inc.                            | <b>FCT</b>  | Credit Suisse Capital LLC                          | <b>RCE</b> | Royal Bank of Canada Europe Limited    |
| <b>BPG</b> | BNP Paribas Securities Corp.                     | <b>FICC</b> | Fixed Income Clearing Corporation                  | <b>RYL</b> | NatWest Markets Plc                    |
| <b>BPS</b> | BNP Paribas S.A.                                 | <b>GLM</b>  | Goldman Sachs Bank USA                             | <b>SAL</b> | Citigroup Global Markets, Inc.         |
| <b>BRC</b> | Barclays Bank PLC                                | <b>GSC</b>  | Goldman Sachs & Co. LLC                            | <b>SBI</b> | Citigroup Global Markets Ltd.          |
| <b>BSH</b> | Banco Santander S.A. - New York Branch           | <b>GST</b>  | Goldman Sachs International                        | <b>SCX</b> | Standard Chartered Bank, London        |
| <b>BSN</b> | The Bank of Nova Scotia - Toronto                | <b>IND</b>  | Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A. | <b>SGY</b> | Societe Generale, NY                   |
| <b>BSS</b> | Banco Santander S.A.                             | <b>ING</b>  | ING Bank NV                                        | <b>SNF</b> | Sanford C. Bernstein & Co.             |
| <b>BUS</b> | The Bank of Nova Scotia - Toronto                | <b>JML</b>  | JP Morgan Securities Plc                           | <b>SOG</b> | Societe Generale Paris                 |
| <b>BYR</b> | The Bank of Nova Scotia - Toronto                | <b>JPM</b>  | JP Morgan Chase Bank N.A.                          | <b>SSB</b> | State Street Bank and Trust Co.        |
| <b>CBK</b> | Citibank N.A.                                    | <b>JPS</b>  | J.P. Morgan Securities LLC                         | <b>STR</b> | State Street FICC Repo                 |
| <b>CDI</b> | Natixis Singapore                                | <b>MAC</b>  | Macquarie Bank Limited                             | <b>TDL</b> | Toronto Dominion Bank London           |
| <b>CEW</b> | Canadian Imperial Bank of Commerce World Markets | <b>MBC</b>  | HSBC Bank Plc                                      | <b>TDM</b> | TD Securities (USA) LLC                |
| <b>CIB</b> | Canadian Imperial Bank of Commerce               | <b>MEI</b>  | Merrill Lynch International                        | <b>TOR</b> | The Toronto-Dominion Bank              |
| <b>CKL</b> | Citibank N.A. London                             | <b>MFK</b>  | Barclays Capital, Inc.                             | <b>UAG</b> | UBS AG Stamford                        |
| <b>COM</b> | Commerz Bank AG                                  | <b>MSC</b>  | Morgan Stanley & Co. LLC.                          | <b>WST</b> | Westpac Banking Corp.                  |

### Währungskürzel:

|                     |                                           |                     |                         |                      |                        |
|---------------------|-------------------------------------------|---------------------|-------------------------|----------------------|------------------------|
| <b>AED</b>          | Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate | <b>HUF</b>          | Ungarischer Forint      | <b>PYG</b>           | Paraguayischer Guarani |
| <b>ARS</b>          | Argentinischer Peso                       | <b>IDR</b>          | Indonesische Rupie      | <b>QAR</b>           | Katar-Riyal            |
| <b>AUD</b>          | Australischer Dollar                      | <b>ILS</b>          | Israelischer Schekel    | <b>RON</b>           | Rumänischer neuer Leu  |
| <b>BRL</b>          | Brasilianischer Real                      | <b>INR</b>          | Indische Rupie          | <b>RSD</b>           | Serbischer Dinar       |
| <b>CAD</b>          | Kanadischer Dollar                        | <b>JPY (oder ¥)</b> | Japanischer Yen         | <b>RUB</b>           | Russischer Rubel       |
| <b>CHF</b>          | Schweizer Franken                         | <b>KES</b>          | Kenia-Schilling         | <b>SEK</b>           | Schwedische Krone      |
| <b>CLP</b>          | Chilenischer Peso                         | <b>KRW</b>          | Südkoreanischer Won     | <b>SGD</b>           | Singapur-Dollar        |
| <b>CNH</b>          | Chinesischer Renminbi (Offshore)          | <b>KWD</b>          | Kuwaitischer Dinar      | <b>THB</b>           | Thailändischer Baht    |
| <b>CNY</b>          | Chinesischer Renminbi (Festlandchina)     | <b>KZT</b>          | Kasachischer Tenge      | <b>TRY</b>           | Türkische neue Lira    |
| <b>COP</b>          | Kolumbianischer Peso                      | <b>MXN</b>          | Mexikanischer Peso      | <b>TWD</b>           | Taiwanesischer Dollar  |
| <b>CZK</b>          | Tschechische Krone                        | <b>MYR</b>          | Malaysischer Ringgit    | <b>UGX</b>           | Uganda-Schilling       |
| <b>DKK</b>          | Dänische Krone                            | <b>NGN</b>          | Nigerianischer Naira    | <b>USD (oder \$)</b> | US-Dollar              |
| <b>DOP</b>          | Dominikanischer Peso                      | <b>NOK</b>          | Norwegische Krone       | <b>UYU</b>           | Uruguayischer Peso     |
| <b>EGP</b>          | Ägyptisches Pfund                         | <b>NZD</b>          | Neuseeländischer Dollar | <b>UZS</b>           | Usbekische So'm        |
| <b>EUR (oder €)</b> | Euro                                      | <b>PEN</b>          | Peruanischer neuer Sol  | <b>VND</b>           | Vietnamesischer Dong   |
| <b>GBP (oder £)</b> | Britisches Pfund                          | <b>PHP</b>          | Philippinischer Peso    | <b>ZAR</b>           | Südafrikanischer Rand  |
| <b>GHS</b>          | Ghanaischer Cedi                          | <b>PKR</b>          | Pakistanische Rupie     | <b>ZMW</b>           | Sambischer Kwacha      |
| <b>HKD</b>          | Hongkong-Dollar                           | <b>PLN</b>          | Polnischer Zloty        |                      |                        |

### Börsenkürzel:

|             |                             |              |                                |            |                           |
|-------------|-----------------------------|--------------|--------------------------------|------------|---------------------------|
| <b>BIST</b> | Borsa Istanbul Exchange     | <b>EUREX</b> | Eurex Exchange                 | <b>ICE</b> | IntercontinentalExchange® |
| <b>CBOT</b> | Chicago Board of Trade      | <b>FTSE</b>  | Financial Times Stock Exchange | <b>OTC</b> | Over the Counter          |
| <b>CME</b>  | Chicago Mercantile Exchange |              |                                |            |                           |

### Index-/Spread-Kürzel:

|                  |                                                                     |                 |                                                                                                       |                    |                                                                                                      |
|------------------|---------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>ABX.HE</b>    | Asset-Backed Securities Index - Home Equity                         | <b>CPALEMU</b>  | Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index                                                     | <b>OMX</b>         | Stockholm 30 Index                                                                                   |
| <b>ACS</b>       | Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index                 | <b>CPTFEMU</b>  | Eurozone HICP ex-Tobacco Index                                                                        | <b>PIMCOBDBU</b>   | PIMCO Custom Commodity Basket                                                                        |
| <b>AMZX</b>      | Alerian MLP Total Return Index                                      | <b>CPURNSA</b>  | Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index                                                | <b>PRIME</b>       | Daily US Prime Rate                                                                                  |
| <b>BCOMF1NTC</b> | Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return Custom Index | <b>DAX</b>      | Deutscher Aktien Index 30                                                                             | <b>PrimeX.ARM</b>  | Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage                                    |
| <b>BCOMTR</b>    | Bloomberg Commodity Index Total Return                              | <b>FEDL01</b>   | Federal Funds Effective Rate                                                                          | <b>S&amp;P 500</b> | Standard & Poor's 500 Index                                                                          |
| <b>BOBL</b>      | Bundesobligation                                                    | <b>FRCPXTOB</b> | Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak                                                        | <b>SIBCSORA</b>    | Singapore Overnight Rate Average                                                                     |
| <b>BOVESPA</b>   | Brazil Bovespa Index                                                | <b>FTSE/JSE</b> | South African Performance Index                                                                       | <b>SONIO</b>       | Sterling Overnight Interbank Average Rate                                                            |
| <b>CAC</b>       | Cotation Assistée en Continu                                        | <b>FTSE/MIB</b> | Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana | <b>SPI 200</b>     | Australian Equity Futures Index                                                                      |
| <b>CAONREPO</b>  | Canadian Overnight Repo Rate Average                                | <b>IBEX 35</b>  | Spanish Continuous Exchange Index                                                                     | <b>SRFXON3</b>     | Swiss Overnight Rate Average (6PM)                                                                   |
| <b>CDX.EM</b>    | Credit Derivatives Index — Emerging Markets                         | <b>IBR</b>      | Indicador Bancario de Referencia                                                                      | <b>TOPIX</b>       | Tokyo Price Index                                                                                    |
| <b>CDX.HY</b>    | Credit Derivatives Index - High Yield                               | <b>JMABNIU5</b> | J.P. Morgan Custom Commodity Index                                                                    | <b>TRNGLU</b>      | FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD                                                         |
| <b>CDX.IG</b>    | Credit Derivatives Index – Investment Grade                         | <b>KOSPI</b>    | Korea Composite Stock Price Index                                                                     | <b>UKRPI</b>       | United Kingdom Retail Prices Index                                                                   |
| <b>CIXBSTR3</b>  | Individuell zusammengestellter Rohstoffindex                        | <b>KOSPI2</b>   | Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index                                                                  | <b>VSTOXX</b>      | Euro Stoxx 50 Volatility Index                                                                       |
| <b>CMBX</b>      | Commercial Mortgage-Backed Index                                    | <b>MUTKCALM</b> | Tokyo Overnight Average Rate                                                                          | <b>WIG20</b>       | Nach Marktkapitalisierung gewichteter Börsenindex der 20 größten Unternehmen an der Warschauer Börse |
| <b>CNREPOFIX</b> | China Fixing Repo Rates 7-Day                                       | <b>NDUEACWF</b> | MSCI ACWI Index Future                                                                                |                    |                                                                                                      |

## Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen) (Forts.)

### Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:

|                         |                                                                                  |                |                                         |               |                                                                                                     |
|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------------|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>AGM</b>              | Assured Guaranty Municipal                                                       | <b>NPFGC</b>   | National Public Finance Guarantee Corp. | <b>ST</b>     | State                                                                                               |
| <b>Sonstige Kürzel:</b> |                                                                                  |                |                                         |               |                                                                                                     |
| <b>ABS</b>              | Asset-Backed Security<br>(forderungsbesichertes Wertpapier)                      | <b>HIBOR</b>   | Hong Kong Interbank Offered Rate        | <b>REIT</b>   | Real Estate Investment Trust<br>(Immobilieninvestmentfonds)                                         |
| <b>ALT</b>              | Alternate Loan Trust                                                             | <b>JIBAR</b>   | Johannesburg Interbank Agreed Rate      | <b>REMIC</b>  | Real Estate Mortgage Investment<br>Conduit                                                          |
| <b>ATM</b>              | At-the-money                                                                     | <b>JSC</b>     | Joint Stock Company                     | <b>RMBS</b>   | Residential Mortgage-Backed Security                                                                |
| <b>BABs</b>             | Build America Bonds                                                              | <b>KLIBOR</b>  | Kuala Lumpur Interbank Offered Rate     | <b>SOR</b>    | Swap Offer Rate                                                                                     |
| <b>BBR</b>              | Bank Bill Rate                                                                   | <b>KORIBOR</b> | Korea Interbank Offered Rate            | <b>STIBOR</b> | Stockholm Interbank Offered Rate                                                                    |
| <b>BBSW</b>             | Bank Bill Swap Reference Rate                                                    | <b>LIBOR</b>   | London Interbank Offered Rate           | <b>TAIBOR</b> | Taipei Interbank Offered Rate                                                                       |
| <b>BRL-CDI</b>          | Brazil Interbank Deposit Rate                                                    | <b>MIBOR</b>   | Mumbai Interbank Offered Rate           | <b>TBA</b>    | To-Be-Announced                                                                                     |
| <b>BTP</b>              | Buoni del Tesoro Poliennali<br>(„langfristige Staatsanleihen“)                   | <b>MSCI</b>    | Morgan Stanley Capital International    | <b>TBD</b>    | To-Be-Determined                                                                                    |
| <b>CBO</b>              | Collateralised Bond Obligation                                                   | <b>NIBOR</b>   | Norwegian Interbank Offered Rate        | <b>TBD%</b>   | Bei Abrechnung des Darlehens oder<br>zum Zeitpunkt der Finanzierung zu<br>ermittelnder Zinssatz     |
| <b>CHILIBOR</b>         | Chile Interbank Offered Rate                                                     | <b>OAT</b>     | Obligations Assimilables du Trésor      | <b>TELBOR</b> | Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate                                                                    |
| <b>CLO</b>              | Collateralised Loan Obligation<br>(durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere) | <b>OIS</b>     | Overnight Index Swap                    | <b>THOR</b>   | Thai Overnight Baht Repurchase Rate                                                                 |
| <b>CMBS</b>             | Collateralised Mortgage-Backed<br>Security                                       | <b>PIK</b>     | Payment-in-Kind (Sachausschüttung)      | <b>TIIE</b>   | Tasa de Interés Interbancaria de<br>Equilibrio („Gleichgewichtszinssatz<br>im Interbankengeschäft“) |
| <b>DAC</b>              | Designated Activity Company                                                      | <b>PRIBOR</b>  | Prague Interbank Offered Rate           | <b>WIBOR</b>  | Warsaw Interbank Offered Rate                                                                       |
| <b>EURIBOR</b>          | Euro Interbank Offered Rate                                                      |                |                                         |               |                                                                                                     |

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,  
Third Floor,  
Harcourt Building,  
Harcourt Street,  
Dublin,  
D02 F721,  
Irland.

**ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT**

Pacific Investment Management  
Company LLC,  
650 Newport Center Drive,  
Newport Beach, California 92660,  
USA.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Vereinigtes Königreich.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstraße 24–24a,  
80335 München,  
Deutschland.

**ADMINISTRATOR**

State Street Fund Services (Ireland) Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERWAHRSTELLE**

State Street Custodial Services (Ireland)  
Limited,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERTRIEBSSTELLEN**

PIMCO Europe GmbH,  
Seidlstraße 24–24a,  
80335 München,  
Deutschland.

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Vereinigtes Königreich.

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street, Central,  
Hongkong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,  
Level 19, 5 Martin Place,  
363 George Street,  
Sydney, New South Wales 2000,  
Australien.

**ÖSTERREICHISCHE ZAHLSTELLE**

UniCredit Bank Austria AG,  
Schottengasse 6–8,  
1010 Wien,  
Österreich.

**BELGISCHE ZAHLSTELLE**

ABN AMRO BANK S.A.,  
Borsbeeksebrug 30,  
2600 Antwerpen,  
Belgien.

**ZAHLSTELLE IN ZYPERN**

EUROBANK CYPRUS LTD.,  
28, Spyrou Kyprianou Avenue,  
1075 Nicosia,  
Zypern.

**ZAHLSTELLE IN DER TSCHECHISCHEN REPUBLIK**

European Investment Centre,  
Veveří 2581/102,  
616 00 Brno,  
Tschechische Republik.

**FRANZÖSISCHE ZENTRALISIERUNGS- UND FINANZSTELLE**

Société Générale,  
29, Boulevard Haussmann,  
75009 Paris,  
Frankreich.

**DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONSTELLE**

Marcard, Stein & Co AG,  
Ballindamm 36,  
20095 Hamburg,  
Deutschland.

**GRIECHISCHE ZAHLSTELLE**

Eurobank Asset Management M.F.M.C.,  
10 Stadiou Street,  
GR 10564 Athen,  
Griechenland.

**REPRÄSENTANT IN HONGKONG**

PIMCO Asia Limited,  
22nd Floor, Suite 2201,  
Two International Finance Centre,  
8 Finance Street,  
Hongkong.

**UNGARISCHE ZAHLSTELLE**

European Investment Centre,  
Tomasikova 64,  
831 04 Bratislava,  
Slowakische Republik.

**ITALIENISCHE KORRESPONDEZBANKEN**

AllFunds Bank S.A.U.,  
Succursale di Milano,  
Via Bocchetto, 6,  
20123 Mailand,  
Italien.

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,  
Piazza Velasca, 7/9,  
20122 Mailand,  
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,  
Piazza Gaudenzio Sella, 1,  
13900 Biella,  
Italien.

CACEIS Bank, Zweigniederlassung Italien,  
Piazza Cavour 2,  
20121 Mailand,  
Italien.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,  
Via Verii, 14,  
Mantua,  
Italien.

RBC Investor Services Bank S.A., Zweigstelle  
Mailand,  
Via Vittor Pisani, 26,  
20124 Mailand,  
Italien.

Société Générale Securities Services  
S.p.A. („SGSS“),  
Via Santa Chiara, 19,  
Turin,  
Italien.

State Street Bank International GmbH  
– Succursale Italia,  
Via Ferrante Aporti, 10,  
Mailand,  
Italien.

**ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN**

LGT Bank Ltd.,  
Herrengasse 12,  
FL-9490 Vaduz,  
Liechtenstein.

**LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE**

Société Générale Luxembourg,  
(Centre Opérationnel / FED),  
28-32, Place de la Gare,  
L-1616, Luxemburg.

**PORTUGIESISCHE ZAHLSTELLE**

Banco Activobank (Portugal) S.A.,  
Rua Augusta 84,  
1149-023, Lissabon,  
Portugal.



**REPRÄSENTANT IN SINGAPUR**

PIMCO Asia Pte Ltd.,  
8 Marina View, #30-01,  
Asia Square Tower 1,  
Singapur 018960.

**SCHWEDISCHE ZAHLSTELLE**

SEB Merchant Banking,  
SE-106 40,  
Stockholm,  
Schweden.

**ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANT IN DER SCHWEIZ**

BNP PARIBAS Paris,  
Zweigstelle Zürich,  
Selnastrasse 16,  
8002 Zürich,  
Schweiz.

**BRITISCHER REPRÄSENTANT**

PIMCO Europe Ltd.,  
11 Baker Street,  
London W1U 3AH,  
Vereinigtes Königreich.

**RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irland.

**RECHTSBERATER FÜR US-RECHT**

Dechert LLP,  
1900 K Street N.W.,  
Washington, D.C. 20006,  
USA.

**UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER**

PricewaterhouseCoopers  
Chartered Accountants und Statutory  
Audit Firm,  
One Spencer Dock,  
North Wall Quay,  
Dublin 1,  
D01 X9R7,  
Irland.

**SEKRETÄR**

Walkers Corporate Services (Ireland) Limited,  
The Exchange,  
George's Dock,  
Dublin D01 P2V6,  
Irland.

**BETREUENDER MAKLER**

Dillon Eustace LLP,  
33 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 XK09,  
Irland.

**EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ**

PIMCO Funds: Global Investors  
Series plc,  
78 Sir John Rogerson's Quay,  
Dublin 2,  
D02 HD32,  
Irland.

**VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

V. Mangala Ananthanarayanan<sup>1</sup> (Indien)  
Ryan P. Blute<sup>1</sup> (USA)  
Craig A. Dawson<sup>1</sup> (USA)  
David M. Kennedy (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)  
Myles Lee (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)  
Frances Ruane (unabhängiges  
Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Prospekt, Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung, die Basisinformationsblätter sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos beim Repräsentanten oder Agenten jedes Rechtsraums bezogen werden.

Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 30. Juni 2025 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anteilhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

<sup>1</sup> Mitarbeiter von PIMCO.

**PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517, 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich)** wurde von der Financial Conduct Authority (FCA) (12 Endeavour Square, London E20 1JN) im Vereinigten Königreich zugelassen und steht unter deren Aufsicht. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.

Die **PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24–24a, 80335 München, Deutschland)**, die **italienische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 10005170963, via Turati nn. 25/27 (angolo via Cavaliere n. 4), 20121 Mailand, Italien)**, die **irische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 909462, 57B Harcourt Street Dublin D02 F721, Irland)**, die **britische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 2604517, 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich)**, die **spanische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (N.I.F. W2765338E, Paseo de la Castellana 43, Oficina 05-111, 28046 Madrid, Spanien)** und die **französische Zweigniederlassung der PIMCO Europe GmbH (Registernummer 918745621 R.C.S. Paris, 50–52 Boulevard Haussmann, 75009 Paris, Frankreich)** sind von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24–28, 60439 Frankfurt am Main) in Deutschland zugelassen und werden von dieser gemäß § 15 des Gesetzes zur Beaufsichtigung von Wertpapierinstituten (WpIG) reguliert. Die italienische Zweigniederlassung, die irische Zweigniederlassung, die britische Zweigniederlassung, die spanische Zweigniederlassung und die französische Zweigniederlassung werden zusätzlich beaufsichtigt durch: (1) italienische Zweigniederlassung: die Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) (Giovanni Battista Martini, 3 – 00198 Rom) gemäß Artikel 27 des italienischen konsolidierten Finanzgesetzes; (2) irische Zweigniederlassung: die Central Bank of Ireland (New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1 D01 F7X3) gemäß Verordnung 43 der Verordnungen der European Union (Markets in Financial Instruments) Regulations 2017 in der jeweils gültigen Fassung; (3) britische Zweigniederlassung: die Financial Conduct Authority (FCA) (12 Endeavour Square, London E20 1JN); (4) spanische Zweigniederlassung: die Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) (Edison, 4, 28006 Madrid) gemäß den in den Artikeln 168 und 203 bis 224 festgelegten Verpflichtungen sowie den in Titel V, Abschnitt I des Gesetzes über den Wertpapiermarkt (LSM) und in den Artikeln 111, 114 und 117 des Königlichen Erlasses 217/2008 enthaltenen Verpflichtungen; und (5) französische Zweigniederlassung: die ACPR/Banque de France (4 Place de Budapest, CS 92459, 75436 Paris Cedex 09) gemäß Art. 35 der Richtlinie 2014/65/EU über Märkte für Finanzinstrumente und unter der Überwachung der ACPR und der AMF. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

**PIMCO (Schweiz) GmbH (eingetragen in der Schweiz, Registernummer CH-020.4.038.582-2, Brandschenkestrasse 41, 8002 Zürich, Schweiz).** Die von PIMCO (Schweiz) GmbH erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.